PIMCO

PIMCO FUNDS: GLOBAL INVESTORS SERIES PLC

# Halbjahresbericht

30. Juni 2022

Eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital und gesonderter Haftung zwischen den Fonds und mit beschränkter Haftung gemäß dem Companies Act 2014, die unter der Register-Nr. 276928 eingetragen und von der Zentralbank von Irland nach den Rechtsvorschriften der Europäischen Gemeinschaften von 2011 (Organismen für die gemeinsame Anlage in übertragbaren Wertpapieren [„OGAW"-Richtlinien]) (in der jeweils geltenden Fassung) genehmigt wurde.

A company of Allianz

## ALLGEMEINE KENNDATEN

### Fondstyp:
OGAW

### Anzahl an Fonds der Gesellschaft:
53 Fonds

### Zum 30. Juni 2022 angebotene Anteilsklassen der Gesellschaft:*
Institutional
Institutional AUD (Hedged)
Institutional BRL (Hedged)
Institutional CAD (Hedged)
Institutional CHF (Hedged)
Institutional CHF (Partially Hedged)
Institutional CZK (Hedged)
Institutional EUR (Currency Exposure)
Institutional EUR (Hedged)
Institutional EUR (Partially Hedged)
Institutional EUR (Unhedged)
Institutional GBP (Currency Exposure)
Institutional GBP (Hedged)
Institutional GBP (Partially Hedged)
Institutional GBP (Unhedged)
Institutional HKD (Unhedged)
Institutional JPY (Hedged)
Institutional MXN (Hedged)
Institutional NOK (Hedged)
Institutional NOK (Partially Hedged)
Institutional NZD (Hedged)
Institutional PLN (Hedged)
Institutional RMB (Hedged)
Institutional SEK (Hedged)
Institutional SGD (Hedged)
Institutional USD (Currency Exposure)
Institutional USD (Hedged)
Investor
Investor AUD (Hedged)
Investor CAD (Hedged)
Investor CHF (Hedged)
Investor EUR (Hedged)
Investor EUR (Unhedged)
Investor GBP (Hedged)
Investor NOK (Hedged)
Investor RMB (Hedged)
Investor SEK (Hedged)
Investor SGD (Hedged)
Investor USD (Hedged)
Administrative
Administrative AUD (Hedged)
Administrative CHF (Hedged)
Administrative EUR (Hedged)
Administrative GBP (Hedged)
Administrative HKD (Unhedged)
Administrative JPY (Hedged)
Administrative SEK (Hedged)
Administrative SGD (Hedged)
BE Retail
BM Retail
BM Retail AUD (Hedged)
BM Retail USD (Hedged)
BN Retail
E Class
E Class AUD (Hedged)
E Class CHF (Hedged)
E Class EUR (Currency Exposure)
E Class EUR (Hedged)
E Class EUR (Partially Hedged)
E Class EUR (Unhedged)
E Class GBP (Hedged)
E Class HKD (Unhedged)
E Class JPY (Hedged)
E Class NOK (Hedged)
E Class RMB (Hedged)
E Class SGD (Hedged)
E Class USD (Currency Exposure)
E Class USD (Hedged)
G Retail EUR (Hedged)
G Retail EUR (Unhedged)
H Institutional
H Institutional EUR (Hedged)
H Institutional USD (Currency Exposure)
H Institutional USD (Hedged)
M Retail
M Retail AUD (Hedged)
M Retail HKD (Unhedged)
M Retail SEK (Hedged)
M Retail SGD (Hedged)
M Retail USD (Hedged)
N Retail
R Class
R Class AUD (Hedged)
R Class EUR (Hedged)
R Class GBP (Hedged)
T Class
T Class EUR (Hedged)
T Class USD (Hedged)
W Class
W Class CAD (Hedged)
W Class CHF (Hedged)
W Class EUR (Hedged)
W Class GBP (Hedged)
W Class NOK (Hedged)
W Class SEK (Hedged)
W Class SGD (Hedged)
W Class USD (Currency Exposure)
Z Class
Z Class AUD (Hedged)
Z Class EUR (Hedged)
Z Class GBP (Hedged)

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

### Nettovermögen (Angaben in Tausend):
USD 156.689.032

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

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

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

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

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

ALLGEMEINE KENNDATEN (Forts.)

## Zulassung in Hongkong:

Die Gesellschaft und bestimmte ihrer Fonds sind von der Securities and Futures Commission in Hongkong („SFC“) zugelassen und unterliegen den Anforderungen des von der SFC herausgegebenen Code on Unit Trusts and Mutual Funds („Code“). Derzeit können die folgenden Fonds Finanzderivate zu Anlagezwecken, zur Absicherung und/oder zur effizienten Portfolioverwaltung erwerben. Der Einsatz von Finanzderivaten erfolgt vorbehaltlich der voraussichtlichen Höchstgrenzen im überarbeiteten Code, wie nachstehend aufgeführt. Die Einstufung der Fonds entweder als Derivatfonds oder als Nicht-Derivatfonds ist ebenfalls nachstehend angegeben. Es gibt keine Änderungen bezüglich des Einsatzes von Finanzderivaten durch die folgenden Fonds:

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

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

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

## Zulassung in Singapur

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

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

## Reuters-Seite:

PAFPPLC

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

# Inhaltsverzeichnis


| | Seite |
|---|---|
| Schreiben des Vorsitzenden* | 4 |
| Wichtige Angaben zu den Fonds | 5 |
| Beschreibungen der Vergleichsindizes | 64 |
| Finanzstatus | 70 |
| Betriebsergebnisrechnung | 88 |
| Ausweis der Nettovermögensänderungen | 106 |
| Aufstellung der Wertpapieranlagen | 112 |
| Erläuterungen zum Abschluss | 728 |
| Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung | 784 |
| Begriffsbestimmungen | 837 |
| Allgemeine Informationen | 839 |

| FONDS | Fonds-überblick* | Aufstellung der Wertpapieranlagen |
|---|---|---|
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund | 6 | 112 |
| Asia Strategic Interest Bond Fund | 7 | 121 |
| PIMCO Capital Securities Fund | 8 | 129 |
| PIMCO Climate Bond Fund | 10 | 138 |
| Commodity Real Return Fund | 11 | 146 |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | 12 | 157 |
| Diversified Income Fund | 13 | 167 |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | 15 | 186 |
| Dynamic Bond Fund | 16 | 197 |
| Dynamic Multi-Asset Fund | 17 | 213 |
| Emerging Local Bond Fund | 18 | 224 |
| Emerging Markets Bond Fund | 19 | 244 |
| Emerging Markets Bond ESG Fund | 20 | 259 |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | 21 | 271 |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | 22 | 278 |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 23 | 290 |
| PIMCO ESG Income Fund | 24 | 303 |
| Euro Bond Fund | 25 | 313 |
| Euro Credit Fund | 26 | 322 |
| Euro Income Bond Fund | 27 | 329 |
| Euro Long Average Duration Fund | 28 | 338 |
| Euro Short-Term Fund | 29 | 344 |
| PIMCO European High Yield Bond Fund | 30 | 349 |
| PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | 31 | 355 |
| Global Advantage Fund | 32 | 361 |
| Global Bond Fund | 33 | 380 |
| Global Bond ESG Fund | 35 | 405 |
| Global Bond Ex-US Fund | 36 | 422 |
| PIMCO Global Core Asset Allocation Fund | 37 | 440 |
| Global High Yield Bond Fund | 38 | 454 |
| Global Investment Grade Credit Fund | 39 | 464 |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund | 41 | 486 |
| Global Low Duration Real Return Fund | 42 | 499 |
| Global Real Return Fund | 43 | 507 |
| Income Fund | 44 | 517 |
| Income Fund II | 46 | 553 |
| Inflation Multi-Asset Fund | 47 | 560 |
| Low Average Duration Fund | 48 | 569 |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 49 | 578 |
| Low Duration Income Fund | 50 | 588 |
| Low Duration Opportunities Fund | 51 | 601 |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | 52 | 615 |

| FONDS | Fonds-überblick* | Aufstellung der Wertpapieranlagen |
|---|---|---|
| Mortgage Opportunities Fund | 53 | 618 |
| StocksPLUS™ Fund | 54 | 629 |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | 55 | 638 |
| Strategic Income Fund | 56 | 644 |
| Total Return Bond Fund | 57 | 660 |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 58 | 673 |
| UK Corporate Bond Fund | 59 | 686 |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | 60 | 693 |
| US High Yield Bond Fund | 61 | 700 |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | 62 | 709 |
| US Short-Term Fund | 63 | 720 |


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 Gesellschaft, und diese Meinungen können sich ohne Vorankündigung ändern. Dieses Material wurde ausschließlich zu Informationszwecken verteilt. Prognosen, Schätzungen und bestimmte hierin enthaltene Informationen beruhen auf firmeneigenem Research und sollten nicht als Anlageberatung oder Empfehlung eines bestimmten Wertpapiers, einer bestimmten Strategie oder eines bestimmten Anlageprodukts erachtet werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. Die hierin enthaltenen Informationen wurden aus Quellen bezogen, die als verlässlich erachtet werden. Eine diesbezügliche Garantie wird jedoch nicht abgegeben. Kein Teil dieses Dokuments darf ohne ausdrückliche schriftliche Zustimmung in jedweder Form reproduziert werden, und es ist ebenso untersagt, in anderen Veröffentlichungen darauf Bezug zu nehmen. PIMCO ist in den USA und weltweit eine Marke von Allianz Asset Management of America L.P. ©2022, PIMCO.

## Schreiben des Vorsitzenden

**Sehr geehrte Anteilinhaber,**

Wir hoffen, dass Sie und Ihre Familie in diesen schwierigen Zeiten sicher und gesund bleiben. Wir arbeiten weiterhin unermüdlich daran, die Märkte zu navigieren und die Vermögenswerte, die Sie uns anvertraut haben, zu verwalten. Im Anschluss an dieses Schreiben folgt der Halbjahresbericht von PIMCO Funds: Global Investors Series plc, der den am 30. Juni 2022 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 2022**

Die Weltwirtschaft wurde weiterhin von der COVID-19-Pandemie („COVID-19“) und ihren Varianten beeinträchtigt. Der Krieg in der Ukraine und seine Auswirkungen führten auch zu erhöhten Unsicherheiten rund um die Welt. In seinem World Economic Outlook Update vom April 2022 erklärte der Internationale Währungsfonds („IWF“), dass er für 2022 ein Wachstum des US-Bruttoinlandsprodukts („BIP“) von 3,7 % erwartet, verglichen mit 5,7 % im Jahr 2021. Andernorts erwartet der IWF für 2022 ein BIP-Wachstum von 2,8 % in der Eurozone (nach 5,3 % im Jahr 2021), 3,7 % im Vereinigten Königreich (nach 7,4 % im Jahr 2021) und 2,4 % in Japan (nach 1,6 % im Jahr 2021).

Während des Berichtszeitraums begannen mehrere Zentralbanken mit der Straffung ihrer Geldpolitik. Im Dezember 2021 überraschte die Bank of England (die „BoE“) den Markt und hob die Zinsen erstmals seit Beginn von COVID-19 an. Die BoE hob bei ihren Sitzungen im Februar, März, Mai und Juni 2022 erneut die Zinsen an. Die Europäische Zentralbank („EZB“) deutete an, dass sie beabsichtigt, bei ihren Sitzungen im Juli und September 2022 die Zinssätze anzuheben. Die Bank of Japan (die „BoJ“) hielt an ihrer lockeren Geldpolitik fest und dürfte diese in naher Zukunft angesichts des Gegenwinds für die Wirtschaft beibehalten.

In den USA ergriff die US-Notenbank („Fed“) mehrere Maßnahmen zur Straffung der Geldpolitik, um die hohe Inflation zu bekämpfen. Die Fed reduzierte das monatliche Tempo ihrer Nettokäufe von Treasury-Papieren und Agency-MBS im November 2021 und erneut im Dezember. Die Fed hat ihre monatlichen Käufe von Vermögenswerten Mitte März 2022 eingestellt. Die Fed hob danach den Leitzins im März 2022 um 0,25 % auf eine Spanne zwischen 0,25 % und 0,50 % an. Dies war die erste Zinserhöhung seit 2018. Anschließend erhöhte die Zentralbank die Zinsen bei ihrer Sitzung im Mai 2022 um 0,50 % und bei der Juni-Sitzung um 0,75 %. Am 27. Juli 2022 schließlich - nach Ablauf des Berichtszeitraums - erhöhte die Fed die Zinsen um 0,75 % auf eine Spanne von 2,25 % bis 2,50 %.

Während des Berichtszeitraums stiegen die Renditen der kurz- und der langfristigen US-Staatsanleihen deutlich an. Die Rendite auf die als Benchmark angesetzten 10-jährigen US-Staatsanleihen lag am 30. Juni 2022 bei 2,98 %, nachdem sie zum 31. Dezember 2021 noch 1,52 % betragen hatte. Der Bloomberg Global Treasury Index (USD Hedged), der festverzinsliche, auf Lokalwährung lautende staatliche Schuldtitel von Ländern mit Investment Grade-Rating abdeckt und Industrie- und Schwellenländer umfasst, erzielte eine Rendite von -8,07 %. Der Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged), ein weitläufig verwendeter Index für globale Anleihen mit Investment Grade-Rating, rentierte derweil mit -12,83 %. Mit höherem Risiko behaftete festverzinsliche Anlageklassen wie etwa hochverzinsliche Unternehmensanleihen und Schuldtitel aus Schwellenländern waren ebenfalls schwach. 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 -13,85 %, während Auslandsschulden von Schwellenländern, die vom JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (USD Hedged) abgebildet werden, mit -18,83 % rentierten. Auf Landeswährungen lautende Schwellenmarktanleihen, die vom JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged) abgebildet werden, rentierten mit -14,53 %.

Vor dem Hintergrund volatiler Phasen verzeichneten die globalen Aktien während des Berichtszeitraums allgemein schwache Ergebnisse, da wirtschaftliche und geopolitische Sorgen die Anlegerstimmung belasteten. US-Aktien verzeichneten gemessen am S&P 500-Index insgesamt ein Plus von -19,96 %. Die am MSCI World Index gemessenen globalen Aktien rentierten mit -20,51 %, während die Schwellenmarktaktien, gemessen am MSCI Emerging Markets Index, eine Rendite von -17,63 % erzielten. Japanische Aktien verbuchten derweil am Nikkei 225 Index (in JPY) gemessen ein Plus von -8,33 %, während die vom MSCI Europe Index (in EUR) abgebildeten europäischen Aktien mit -13,84 % rentierten.

Die Rohstoffpreise waren volatil und erzielten gemischte Renditen. Der Preis für Rohöl der Sorte Brent, das zu Beginn des Berichtszeitraums rund 78 USD je Barrel kostete, stieg Ende Juni 2022 auf rund 112 USD je Barrel. Unserer Ansicht nach wurde der Ölpreisanstieg durch Versorgungsengpässe und eine stärkere Nachfrage aufgrund der Wiedereröffnung der Wirtschaft im Zuge der Lockerung der COVID-19-Beschränkungen verursacht. Die Auswirkungen des Krieges in der Ukraine trugen ebenfalls zum Anstieg der Ölpreise bei. Die Preise für andere Rohstoffe wie Kupfer und Gold gaben während des Berichtszeitraums nach.

Schließlich gab es auch Phasen der Volatilität an den Devisenmärkten. Unserer Ansicht nach war dies auf mehrere Faktoren zurückzuführen, darunter die Erwartungen an das Wirtschaftswachstum und die Änderung der Geldpolitik der Zentralbanken sowie die steigende Inflation, COVID-19-Varianten und geopolitische Ereignisse. Der US-Dollar legte gegenüber verschiedenen wichtigen Währungen zu. So gab der US-Dollar während des Berichtszeitraums gegenüber dem Euro, dem britischen Pfund und dem japanischen Yen beispielsweise jeweils um 7,79 %, 10,01 % bzw. 15,21 % nach.

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

Mit freundlichem Gruß

Craig A. Dawson
Vorsitzender

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

## Wichtige Angaben zu den Fonds

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

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

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

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

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

Bestimmte Wertpapiere und Instrumente, in die ein Fonds investieren kann, stützen sich gegebenenfalls in bestimmter Weise auf den London Interbank Offered Rate („LIBOR“). Der LIBOR ist ein durchschnittlicher Zinssatz, den die ICE Benchmark Administration bestimmt und den sich Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel berechnen. In Anbetracht der schrittweisen Einstellung der Verwendung des LIBOR müssen die betreffenden Fonds auf eine andere Benchmark umstellen (z. B. den besicherten Tagesgeldsatz (Secured Overnight Financing Rate), der den USD-LIBOR ersetzen soll und die Kosten von Übernachtkrediten in der Form von mit US-Schatzpapieren besicherten Pensionsgeschäften misst). Die möglichen Auswirkungen des Übergangs weg vom LIBOR auf einen Fonds oder auf bestimmte Wertpapiere und Instrumente, in die ein Fonds investiert, lassen sich gegebenenfalls nur mit Schwierigkeiten ermitteln, und sie können in Abhängigkeit von u. a. den folgenden Faktoren unterschiedlich ausfallen: (i) bestehende Ausweich- oder Kündigungsbestimmungen in Einzelverträgen und (ii) ob, wie und wann die Branchenteilnehmer neue Referenzzinssätze und Ausweichregelungen sowohl für bestehende als auch für neue Produkte und Instrumente entwickeln und annehmen. Beispielsweise können bestimmte Wertpapiere und Anlagen eines Fonds einzelne Verträge beinhalten, die keine bestehende Ausweichklausel oder Formulierung beinhalten, die die Abschaffung des LIBOR vorsieht, und diese Anlagen könnten infolge des Übergangsprozesses eine erhöhte Volatilität oder eine verringerte Liquidität verzeichnen. Darüber hinaus müssen die in solchen Verträgen enthaltenen Zinsbestimmungen möglicherweise unter Berücksichtigung des Übergangs weg vom LIBOR neu ausgehandelt werden. Der Übergang kann außerdem zu einer Verringerung des Werts bestimmter von einem Fonds gehaltener Anlagen oder zu einer Verringerung der Wirksamkeit damit verbundener Fondstransaktionen wie z.B. Absicherungen führen. Darüber hinaus kann der Übergangsprozess auch Änderungen an den Anlagezielen und der Anlagepolitik eines Fonds erfordern. Derartige Auswirkungen des Übergangs weg vom LIBOR sowie andere unvorhergesehene Auswirkungen könnten dazu führen, dass ein Fonds Verluste erleidet oder zusätzliche Kosten tragen muss.

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

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

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

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2019) | (19,32 %) | (5,21 %) |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019) | (19,33 %) | (5,20 %) |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2021) | (19,52 %) | (27,25 %) |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 20. Aug. 2020) | (19,44 %) | (14,43 %) |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019) | (19,54 %) | (5,67 %) |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 01. Jul. 2020) | (19,71 %) | (12,27 %) |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019) | (19,70 %) | (6,05 %) |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Mrz. 2021) | (19,42 %) | (22,14 %) |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 12. Mrz. 2021) | (19,43 %) | (22,16 %) |
| M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019) | (19,71 %) | (6,03 %) |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2019) | (19,05 %) | (4,57 %) |
| J.P. Morgan JACI Non-Investment Grade Index | (18,78 %) | (5,70 %)[2] |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jul. 2021) | (19,61 %) | (26,05 %) |
| Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 30. Sep. 2020) | (19,76 %) | (15,22 %) |
| J.P. Morgan JACI Non-Investment Grade Index (AUD Hedged) | (19,15 %) | (15,58 %)[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 23. Okt. 2020) | (19,76 %) | (16,16 %) |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung 23. Okt. 2020) | (19,84 %) | (16,22 %) |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 23. Okt. 2020) | (20,09 %) | (16,90 %) |
| Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung 23. Okt. 2020) | (20,08 %) | (16,90 %) |
| J.P. Morgan JACI Non-Investment Grade Index (CHF Hedged) | (19,41 %) | (16,60 %) |
| **Auf CNH lautende Klassen** | | |
| Institutional RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jul. 2021) | (18,47 %) | (24,06 %) |
| Investor RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung 09. Okt. 2020) | (18,61 %) | (13,28 %) |
| J.P. Morgan JACI Non-Investment Grade Index (CNH Hedged) | (17,89 %) | (13,40 %)[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Sep. 2020) | (19,89 %) | (15,39 %) |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 25. Sep. 2020) | (19,92 %) | (15,35 %) |
| Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 10. Sep. 2020) | (20,06 %) | (16,18 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Sept. 2020) | (20,30 %) | (16,10 %) |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 25. Sep. 2020) | (20,29 %) | (16,12 %) |
| J.P. Morgan JACI Non-Investment Grade Index (EUR Hedged) | (19,52 %) | (16,54 %)[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jul. 2021) | (19,47 %) | (26,40 %) |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 06. Mai 2021) | (19,35 %) | (25,85 %) |
| J.P. Morgan JACI Non-Investment Grade Index (GBP Hedged) | (19,13 %) | (26,38 %)[2] |
| **Auf HKD lautende Klassen** | | |
| Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019) | (19,13 %) | (6,01 %) |
| M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019) | (19,14 %) | (6,03 %) |
| J.P. Morgan JACI Non-Investment Grade Index (HKD Unhedged) | (18,26 %) | (5,71 %) |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jul. 2021) | (19,25 %) | (25,64 %) |
| Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 20. Aug. 2020) | (19,44 %) | (14,43 %) |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019) | (19,67 %) | (6,29 %) |
| M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019) | (19,68 %) | (6,28 %) |
| J.P. Morgan JACI Non-Investment Grade Index (SGD Hedged) | (18,83 %) | (6,03 %)[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 Asia High Yield Bond Fund strebt eine maximale Gesamtrendite bei umsichtiger Anlageverwaltung an, indem er in einen Mix aus festverzinslichen Instrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) von Emittenten, die wirtschaftlich mit asiatischen Ländern, ausgenommen Japan, verbunden sind, sowie verbundenen Derivaten auf diese Wertpapiere investiert. Vom Fonds gekaufte Rentenwerte (wie im Verkaufsprospekt definiert) sind von Moody's mindestens mit C oder von S&P oder Fitch gleichwertig bewertet (oder weisen, falls sie kein Rating haben, nach Meinung der Anlageberatungsgesellschaft eine vergleichbare Qualität auf). Ausgenommen davon sind hypothekarisch gesicherte Wertpapiere, für die es kein vorgeschriebenes Mindest-Kreditrating gibt.

## Kommentare zum Fonds

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

» Die untergewichtete Positionierung in der US-Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinssätze im Laufe des Berichtszeitraums stiegen.

» Die Untergewichtung ausgewählter Emittenten von indischen Einzelhandels- und Versorgungsunternehmen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die ausgewählten Titel eine Underperformance verzeichneten.

» Das untergewichtete Engagement in einem bestimmten Finanzunternehmen aus Hongkong trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich der Emittent unterdurchschnittlich entwickelte.

» Die Schuldtitelauswahl bei chinesischen Unternehmensanleihen, insbesondere eine Übergewichtung chinesischer Immobilien, schmälerte die relative Wertentwicklung.

» Das Engagement in benchmarkfernen Unternehmensanleihen aus Nicht-Schwellenmärkten belastete die relative Wertentwicklung.

» Die Schuldtitelauswahl bei quasistaatlichen Anleihen aus Asien, insbesondere die Übergewichtung eines bestimmten quasistaatlichen Emittenten des chinesischen Finanzsektors, schmälerte die relative Wertentwicklung.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung 04. Sep. 2020) | (13,15 %) | (8,51 %) |
| Class E, thesaurierend (Auflegung 04. Sep. 2020) | (13,52 %) | (9,26 %) |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 01. Jun. 2010) | (13,54 %) | 2,15 % |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung 01. Dez. 2020) | (12,83 %) | (9,85 %) |
| J.P. Morgan Asia Credit Index[3] | (10,73 %) | 3,15 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 05. Mrz. 2021) | (13,75 %) | (13,51 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Mrz. 2021) | (14,09 %) | (14,19 %) |
| J.P. Morgan Asia Credit Index (EUR Hedged)[3] | (11,50 %) | (10,33 %) |
| **Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)** | | |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung 03. Jun. 2011) | (5,96 %) | 3,12 % |
| JPMorgan Asia Credit Index (EUR Unhedged)[3] | (2,90 %) | 4,67 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 13. Aug. 2021) | (13,31 %) | (17,34 %) |
| J.P. Morgan Asia Credit Index (GBP Hedged)[3] | (10,99 %) | (13,13 %) |
| **Auf HKD lautende Klassen (nicht abgesichert)** | | |
| Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung 04. Sep. 2020) | (12,99 %) | (8,66 %) |
| M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mrz. 2011) | (12,90 %) | 0,68 % |
| JPMorgan Asia Credit Index (HKD Unhedged)[3] | (10,17 %) | 2,00 %[2] |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 09. Okt. 2020) | (13,17 %) | (8,51 %) |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 09. Okt. 2020) | (13,44 %) | (9,21 %) |
| J.P. Morgan Asia Credit Index (SGD Hedged)[3] | (10,75 %) | (6,85 %) |

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

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

[3] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Asia Strategic Interest Bond Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 31. Mai 2016: [90 % JPMorgan Asia Credit Index (JACI) + 10 % 1 Month USD Libor] * [JPMorgan Emerging Local Markets Index (ELMI+)] / [3 Month USD Libor]; seit dem 01. Juni 2016: J.P. Morgan Asia Credit Index.*

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Die Währungspositionierung trug zur absoluten Wertentwicklung bei.

» Es gab keine sonstigen Faktoren, die einen wesentlichen Beitrag zu diesem Fonds leisteten.

» Die Positionierung in der US-Duration belastete die absolute Wertentwicklung, da die Zinssätze im Laufe des Berichtszeitraums stiegen.

» Das Engagement in chinesischen Unternehmensanleihen belastete die absolute Wertentwicklung, insbesondere im Immobiliensektor.

» Das Engagement in Unternehmensanleihen des breiteren asiatischen Markts belastete die absolute Wertentwicklung, insbesondere bei Glücksspielunternehmen in Macau und indischen Industriewerten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jul. 2013) | (14,38 %) | 4,61 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Sep. 2014) | (14,38 %) | 3,59 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 19. Mai 2014) | (14,58 %) | 3,18 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2014) | (14,54 %) | 3,19 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013) | (14,58 %) | 4,01 % |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2013) | (14,58 %) | 4,00 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Okt. 2013) | (14,75 %) | 3,33 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2014) | (14,77 %) | 2,63 % |
| M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013) | (14,76 %) | 3,09 % |
| Class R, ausschüttend (Auflegung: 18. Mrz. 2014) | (14,45 %) | 3,54 % |
| Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (14,96 %) | 2,59 % |
| Class Z, ausschüttend (Auflegung: 31. Okt. 2013) | (13,98 %) | 5,04 % |
| 3 Month USD LIBOR Index | 0,31 % | 0,97 %[2] |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jul. 2021) | (14,84 %) | (14,53 %) |
| Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018) | (14,94 %) | 0,70 % |
| Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Aug. 2015) | (14,45 %) | 3,91 % |
| Bloomberg AusBond Bank Bills Index | 0,08 % | 1,24 %[2] |
| **Auf BRL lautende Klassen** | | |
| Institutional BRL (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jan. 2018) | (4,21 %) | (5,55 %) |
| ICE BofAML 3 Month USD LIBOR Index Hedged BRL Denominated in USD | 11,99 % | (5,32 %) |
| **Auf CAD lautende Klassen** | | |
| Investor CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018) | (14,60 %) | 1,41 % |
| 3 Month USD LIBOR (CAD Hedged) Index | 0,02 % | 0,92 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013) | (15,03 %) | 2,59 % |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Jun. 2014) | (15,37 %) | 0,37 % |
| ICE BofA SARON Overnight Rate Index[3] | (0,34 %) | (0,85 %)[2] |
| **Auf CNH lautende Klassen** | | |
| Institutional RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jul. 2021) | (13,56 %) | (12,14 %) |
| Investor RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018) | (13,71 %) | 3,60 % |
| 3 Month USD LIBOR (CNH Hedged) Index | 1,12 % | 2,88 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013) | (15,10 %) | 2,94 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2013) | (15,16 %) | 2,94 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 29. Jul. 2014) | (15,08 %) | 1,75 % |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2016) | (15,26 %) | 2,38 % |
| Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013) | (15,38 %) | 2,42 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Okt. 2013) | (15,50 %) | 1,74 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015) | (15,49 %) | 0,60 % |
| Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jun. 2014) | (15,21 %) | 1,49 % |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014) | (15,71 %) | 0,66 % |
| Euro Short-Term Rate (ESTER) Index[4] | (0,29 %) | (0,24 %)[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013) | (14,63 %) | 3,61 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2013) | (14,65 %) | 3,70 % |
| Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2020) | (14,77 %) | (3,85 %) |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jun. 2014) | (14,68 %) | 2,18 % |
| ICE BofA SONIA Overnight Rate Index[5] | 0,32 % | 0,50 %[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 der Ergänzung zu diesem Fonds angegebenen Richtlinien mindestens 80 % in Capital Securities angelegt werden. Der Fonds bewirbt ökologische Merkmale, hat jedoch keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel. Weitere Informationen finden Sie in der Ergänzung im Prospekt mit dem Titel „Bewerben ökologischer Merkmale“.

## Kommentare zum Fonds

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

» Ausgewählte Zinsswap-Positionen trugen zur Wertentwicklung bei.

» Das Engagement in und die Titelauswahl bei Additional Tier 1- und nachrangigen Hybridanleihen schmälerten die Wertentwicklung, insbesondere bei ausgewählten Emittenten der Randländer und nicht kündbaren unbefristeten Anleihen, die unterdurchschnittlich abschnitten.

» Das taktische Engagement in Nichtfinanzwerten und hybriden Unternehmensanleihen schmälerte die Wertentwicklung aufgrund einer Underperformance in der ersten Hälfte des Geschäftsjahrs, die auf die Weitung der Spreads zurückzuführen war.

» Das Engagement in und die Titelauswahl bei Tier-2-Anleihen und CoCo-Bonds schmälerten die Wertentwicklung, insbesondere bei ausgewählten italienischen Emittenten.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1] (Forts.)

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf HKD lautende Klassen** | | |
| M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017) | (14,20 %) | 1,33 % |
| 3 Month HIBOR Index | 0,23 % | 1,26 % |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jul. 2021) | (14,40 %) | (14,02 %) |
| Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018) | (14,62 %) | 1,25 % |
| M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II (Auflegung 23. Dez. 2013) | (14,80 %) | 2,91 % |
| 3 Month SGD LIBOR Index | 0,40 % | 0,99 %[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 PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 30. Juni 2021: 3 Month USD LIBOR (Hedged to CHF) Index; ab 01. Juli 2021: ICE BofA SARON Overnight Rate Index.*

[4] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 30. Juni 2021: 3 Month Euribor Index; ab 01. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index.*

[5] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 30. Juni 2021: 3 Month GBP LIBOR Index; ab 01. Juli 2021: SONIA ICE BofA SONIA Overnight Rate Index.*

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung 23. Sep. 2020) | (12,17 %) | (6,50 %) |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 01. Jun. 2021) | (12,30 %) | (11,45 %) |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung 23. Sep. 2020) | (11,98 %) | (6,03 %) |
| Bloomberg MSCI Green Bond Index (USD Hedged) | (13,47 %) | (8,29 %)[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 13. Nov. 2020) | (12,92 %) | (8,66 %) |
| Bloomberg MSCI Green Bond Index (CHF Hedged) | (14,28 %) | (10,62 %) |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2020) | (13,10 %) | (7,64 %) |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Dez. 2020) | (13,05 %) | (9,01 %) |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Jun. 2021) | (13,10 %) | (13,39 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sept. 2020) | (13,45 %) | (8,42 %) |
| Bloomberg MSCI Green Bond Index (EUR Hedged) | (14,30 %) | (9,36 %)[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2020) | (12,40 %) | (6,80 %) |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2021) | (12,44 %) | (10,43 %) |
| Bloomberg MSCI Green Bond Index (GBP Hedged) | (13,79 %) | (8,61 %)[2] |
| **Auf SEK lautende Klassen** | | |
| Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2021) | (12,73 %) | (13,28 %) |
| Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Okt. 2021) | (12,94 %) | (13,46 %) |
| Bloomberg MSCI Green Bond Index (SEK Hedged) | (14,14 %) | (14,48 %)[2] |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2021) | (12,20 %) | (8,72 %) |
| Bloomberg MSCI Green Bond Index (SGD Hedged) | (13,51 %) | (10,20 %) |

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Die Positionierung in Bezug auf die europäischen Kernzinsen trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da die Renditen stiegen.

» Ein moderates Long-Engagement in der Duration entwickelter Märkte, insbesondere der USA, belastete die absolute Wertentwicklung, da die Renditen stiegen.

» Das Long-Engagement in Investment-Grade-Unternehmensanleihen, insbesondere Finanztiteln und Immobilieninvestment-gesellschaften, belastete die absolute Wertentwicklung, da sich die Spreads weiteten.

» Das Long-Engagement in Hochzinsanleihen belastete die absolute Wertentwicklung, da sich die Spreads weiteten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Aug. 2006) | 15,61 % | 0,04 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 11. Aug. 2011) | 15,54 % | (1,27 %) |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2007) | 15,08 % | (1,27 %) |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2022) | — | (11,60 %) |
| Bloomberg Commodity Index Total Return | 18,44 % | (1,47 %)[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2010) | 15,49 % | (0,01 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Mrz. 2012) | 14,97 % | (2,53 %) |
| Bloomberg Commodity Index Total Return (EUR Hedged) | 17,79 % | (1,49 %)[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)** | | |
| Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Jun. 2021) | 25,84 % | 39,74 % |
| Bloomberg Commodity Index Total Return (EUR Unhedged) | 28,84 % | 40,70 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 2017) | 16,15 % | 6,44 % |
| Bloomberg Commodity Index Total Return (GBP Hedged) | 18,40 % | 5,06 % |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Class E SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2021) | 15,41 % | 19,10 % |
| Bloomberg Commodity Index Total Return (SGD Hedged) | 18,40 % | 21,72 % |

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Ein Engagement in breiten Rohstoffkategorien trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da breite Rohstoffkategorien, gemessen am Bloomberg Commodity Index Total Return (BCOM), Zugewinne verbuchten.

» Eine Untergewichtung in US-Zinsen trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen allgemein stiegen.

» Die strukturelle Allokation auf globale inflationsgebundene Anleihen (ILB) als Sicherheiten zur Deckung des Rohstoffengagements des Fonds schmälerte die absolute Wertentwicklung, da globale ILB, gemessen am Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged), Verluste verbuchten.

» Die Kurvenpositionierung bei der US-amerikanischen Breakeven-Inflation (BEI oder die Renditedifferenz zwischen nominalen Staatsanleihen und inflationsgebundenen Anleihen mit gleicher Laufzeit), insbesondere eine Untergewichtung am vorderen Ende der Kurve im Vergleich zu längerfristigen Laufzeiten, war der relativen Performance abträglich, da das hintere Ende der Kurve mehr als das vordere Ende nachgab.

» Das untergewichtete Engagement in U.K. BEI schmälerte die relative Rendite, da U.K. BEI in den ersten 5 Monaten des Berichtszeitraums zulegte.

» Die Kurvenpositionierung in der BEI der Eurozone, insbesondere eine Untergewichtung in kürzeren Laufzeiten, war der relativen Performance abträglich, da das vordere Ende der Kurve stärker zulegte als längere Laufzeiten.

» Cash-Management-Strategien schmälerten die relative Wertentwicklung.

» Die Kurvenpositionierung der US-Breakeven-Inflation, insbesondere eine Untergewichtung in mittleren Laufzeiten gegenüber längeren Laufzeiten, war für die relative Performance von Nachteil, da mittlere Laufzeiten einer Underperformance aufwiesen.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2011) | (7,10 %) | 2,54 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Dez. 2012) | (7,50 %) | 0,86 % |
| 3 Month USD LIBOR Index | 0,31 % | 0,87 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2012) | (7,78 %) | 0,07 % |
| ICE BofA SARON Overnight Rate Index[3] | (0,34 %) | (0,80 %) |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2011) | (7,69 %) | 1,33 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Dez. 2012) | (8,06 %) | (0,45 %) |
| Euro Short-Term Rate (ESTER) Index[4] | (0,29 %) | (0,09 %)[2] |

1 *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ*
2 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*
3 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Credit Opportunities Bond Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 30. Juni 2021: 3 Month USD LIBOR (Hedged to CHF) Index; ab 01. Juli 2021: ICE BofA SARON Overnight Rate Index.*
4 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Credit Opportunities Bond Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 30. Juni 2021: 3 Month Euribor Index; ab 01. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index.*

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Die Makro-Strategien, insbesondere die Positionierung auf der Euro-Zinsstrukturkurve, trugen vor dem Hintergrund der Zinsanhebungen zur Wertentwicklung bei.

» Die Titelauswahl im Investment-Grade-Bereich trug zur Wertentwicklung bei, insbesondere das übergewichtete Engagement in einem bestimmten Finanztitel, der eine Outperformance aufwies.

» Das Engagement im Hochzinsbereich des Bausektors schmälerte die Wertentwicklung, da sich ausgewählte Emittenten unterdurchschnittlich entwickelten.

» Die Titelauswahl in den Schwellenmärkten schmälerte die Wertentwicklung, da das Engagement in Schuldtiteln aus Macau eine Underperformance verzeichnete.

» Die Titelauswahl bei chinesischen Unternehmensanleihen schmälerte die Wertentwicklung, da ausgewählte Emittenten im Immobilienbereich eine Underperformance verzeichneten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005) | (17,69 %) | 5,06 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 08. Sep. 2008) | (17,67 %) | 5,04 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 30. Apr. 2013) | (17,83 %) | 1,77 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2013) | (17,85 %) | 1,76 % |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2011) | (17,86 %) | 2,91 % |
| BM Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022) | — | (6,83 %) |
| BN Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022) | — | (6,83 %) |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006) | (18,02 %) | 4,05 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006) | (18,02 %) | 4,14 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2011) | (17,75 %) | 3,24 % |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Mai 2020) | (17,74 %) | (3,73 %) |
| M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010) | (18,06 %) | 2,79 % |
| M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013) | (18,06 %) | 1,78 % |
| N Retail, ausschüttend II (Auflegung 30. Okt. 2020) | (18,11 %) | (9,30 %) |
| Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (18,22 %) | 1,03 % |
| Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (18,17 %) | 1,03 % |
| Class W, thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (17,60 %) | (7,87 %) |
| Class W, ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (17,63 %) | (7,87 %) |
| jeweils 1/3 Bloomberg 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] | (14,91 %) | 4,85 %[2] |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| Administrative AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Mai 2019) | (18,41 %) | (3,20 %) |
| M Retail AUD (Hedged) ausschüttend (Auflegung 19. Dez. 2012) | (18,59 %) | 1,96 % |
| jeweils 1/3 Bloomberg 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] | (15,47 %) | 2,93 %[2] |
| **Auf CAD lautende Klassen** | | |
| Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Feb. 2019) | (17,79 %) | (1,18 %) |
| Class W CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (17,73 %) | (8,04 %) |
| jeweils 1/3 Bloomberg 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] | (15,06 %) | (0,66 %)[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011) | (18,34 %) | 1,72 % |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Aug. 2012) | (18,40 %) | 0,90 % |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Sept. 2019) | (18,78 %) | (6,07 %) |
| Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (18,36 %) | (9,08 %) |
| Class W CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (18,38 %) | (9,09 %) |
| jeweils 1/3 Bloomberg 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] | (15,75 %) | 1,83 %[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 (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

» Die Titelauswahl bei hochverzinslichen Industrietiteln trug zur Wertentwicklung bei, insbesondere das nicht vorhandene Engagement in einem bestimmten Emittenten aus dem Gesundheitswesen, der eine Underperformance verzeichnete.

» Das untergewichtete Engagement in Investment-Grade-Industrietiteln, insbesondere in ausgewählten Emittenten aus den Sektoren Gesundheitswesen und Lebensmittel, die eine Underperformance verzeichneten, trug zur Wertentwicklung bei.

» Die Titelauswahl bei chinesischen Unternehmensanleihen schmälerte die Wertentwicklung, da ausgewählte Emittenten im Immobilienbereich aufgrund von Liquiditätsengpässen eine Underperformance verzeichneten.

» Das Engagement in quasi-staatlichen Anleihen aus Russland schmälerte die Wertentwicklung, da diese angesichts der Schwäche russlandbezogener Emittenten infolge des Russland/Ukraine-Krieges einen Abverkauf verzeichneten.

» Die Titelauswahl bei hochverzinslichen Finanzwerten schmälerte die Wertentwicklung, insbesondere das Engagement in einer europäischen Bank und einem Emittenten aus dem europäischen Immobilienbereich, die eine Underperformance verzeichneten.

## Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1] (Forts.)

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2007) | (18,47 %) | 3,86 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Okt. 2007) | (18,48 %) | 3,86 % |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Jul. 2007) | (18,60 %) | 3,66 % |
| Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Feb. 2013) | (18,63 %) | 0,51 % |
| Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jul. 2007) | (18,67 %) | 3,50 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jul. 2007) | (18,79 %) | 3,12 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2009) | (18,80 %) | 2,47 % |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014) | (19,00 %) | (0,77 %) |
| Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014) | (19,02 %) | (0,77 %) |
| Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (18,40 %) | (8,96 %) |
| Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (18,40 %) | (8,94 %) |
| jeweils 1/3 Bloomberg 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] | (15,82 %) | 3,45 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2006) | (18,05 %) | 4,76 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2006) | (18,05 %) | 4,70 % |
| Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2011) | (18,23 %) | 2,26 % |
| Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (17,95 %) | (8,27 %) |
| Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (17,91 %) | (8,26 %) |
| jeweils 1/3 Bloomberg 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] | (15,32 %) | 4,38 %[2] |
| **Auf JPY lautende Klassen** | | |
| Administrative JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Okt. 2021) | (18,48 %) | (18,40 %) |
| jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, JPY Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, JPY Hedged; und JPMorgan EMBI Global, JPY Hedged[3] | (15,83 %) | (15,33 %) |
| **Auf MXN lautende Klassen** | | |
| Institutional MXN (Hedged), thesaurierend (Auflegung 09. Dez. 2020) | (14,99 %) | (6,67 %) |
| jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, MXN Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, MXN Hedged; und JPMorgan EMBI Global, MXN Hedged[3] | (12,22 %) | (4,19 %) |
| **Auf SEK lautende Klassen** | | |
| Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | (18,35 %) | 4,22 % |
| Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung 30. Dez. 2020) | (18,56 %) | (13,45 %) |
| jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, SEK Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, SEK Hedged; und JPMorgan EMBI Global, SEK Hedged[3] | (15,74 %) | 3,82 %[2] |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Nov. 2019) | (17,73 %) | (4,11 %) |
| Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mai 2019) | (17,95 %) | (2,51 %) |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 01. Okt. 2019) | (18,09 %) | (4,85 %) |
| M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II (Auflegung 11. Mrz. 2021) | (18,17 %) | (13,49 %) |
| Class W SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (17,71 %) | (7,86 %) |
| jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, SGD Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, SGD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, SGD Hedged[3] | (15,04 %) | (1,21 %)[2] |

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

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

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

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2011) | (11,20 %) | 2,62 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015) | (11,26 %) | 2,44 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014) | (11,32 %) | 1,28 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2013) | (11,61 %) | 0,97 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2011) | (11,63 %) | 1,73 % |
| Gleichgewichtete Mischung von drei Indizes mit einer konstanten Duration von 0,25 Jahren, wie von PIMCO berechnet: Bloomberg 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] | (7,73 %) | 2,55 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2011) | (11,96 %) | 1,64 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 01. Okt. 2013) | (11,92 %) | 0,32 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Aug. 2011) | (12,32 %) | 0,85 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 07. Mai 2013) | (12,38 %) | (0,81 %) |
| Eine Mischung aus folgenden drei Indizes bei konstanter 0,25-Jahres-Duration: jeweils 1/3 Bloomberg 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] | (8,49 %) | 1,77 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2011) | (11,35 %) | 2,42 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2013) | (11,37 %) | 0,97 % |
| Eine Mischung aus folgenden drei Indizes bei konstanter 0,25-Jahres-Duration: jeweils 1/3 Bloomberg 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] | (7,94 %) | 2,43 %[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.*

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 Global Aggregate Credit (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch High Yield BB-B Rated Developed Markets Constrained (USD Hedged), JPMorgan EMBI Global; seit dem 10. November 2015: Eine Mischung aus folgenden drei Indizes bei konstanter Duration von 25 Jahren: jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged).*

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Die Titelauswahl bei hochverzinslichen Industrietiteln trug aufgrund des nicht vorhandenen Engagements in einem bestimmten Emittenten aus dem Gesundheitswesen, der eine Underperformance verzeichnete, zur Wertentwicklung bei.

» Das untergewichtete Engagement in ausgewählten Investment-Grade-Emittenten aus dem Bankwesen, die eine Underperformance verzeichneten, trug zur Wertentwicklung bei.

» Die Titelauswahl bei chinesischen Unternehmensanleihen schmälerte die Wertentwicklung, da ausgewählte übergewichtete Emittenten im Immobilienbereich eine Underperformance verzeichneten.

» Die Titelauswahl in hochverzinslichen Finanztiteln schmälerte die Wertentwicklung, da ausgewählte übergewichtete Emittenten eine Underperformance verzeichneten.

» Die Titelauswahl bei hochverzinslichen Anleihen im Automobilsektor schmälerte die Wertentwicklung, da ausgewählte übergewichtete Emittenten eine Underperformance verzeichneten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Dez. 2008) | (7,05 %) | 2,36 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Feb. 2010) | (7,07 %) | 1,98 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 24. Sep. 2010) | (7,27 %) | 1,28 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 24. Sep. 2010) | (7,22 %) | 1,27 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2010) | (7,27 %) | 1,46 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Mai 2010) | (7,45 %) | 0,92 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 11. Mai 2010) | (7,48 %) | 0,93 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018) | (7,22 %) | 0,78 % |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2020) | (7,17 %) | (1,00 %) |
| Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (7,14 %) | 1,18 % |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2021) | (6,65 %) | (7,30 %) |
| 1 Month USD LIBOR Index | 0,23 % | 0,63 %[2] |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Mrz. 2014) | (7,01 %) | 2,94 % |
| Bloomberg AusBond Bank Bills Index | 0,08 % | 1,47 % |
| **Auf CAD lautende Klassen** | | |
| Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2018) | (7,10 %) | 0,53 % |
| 1 Month USD LIBOR Index (CAD Hedged) | 0,23 % | 0,70 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Sep. 2010) | (7,86 %) | 0,17 % |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Apr. 2011) | (8,22 %) | (0,78 %) |
| ICE BofA SARON Overnight Rate Index[3] | (0,34 %) | (0,48 %)[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Mai 2009) | (7,75 %) | 1,49 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Dez. 2009) | (7,78 %) | 1,05 % |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2011) | (7,93 %) | 0,29 % |
| Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2010) | (7,98 %) | 0,48 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Nov. 2009) | (8,14 %) | 0,15 % |
| G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Dez. 2010) | (8,13 %) | (0,20 %) |
| Euro Short-Term Rate (ESTER) Index[4] | (0,29 %) | (0,01 %)[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Dez. 2009) | (7,20 %) | 1,63 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Feb. 2012) | (7,27 %) | 1,24 % |
| Class E GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Mrz. 2010) | (7,55 %) | 0,61 % |
| ICE BofA SONIA Overnight Rate Index[5] | 0,32 % | 0,48 %[2] |
| **Auf NOK lautende Klassen** | | |
| Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Apr. 2011) | (7,19 %) | 1,83 % |
| 1 Month NIBOR Rate Index | 0,46 % | 1,23 % |
| **Auf SEK lautende Klassen** | | |
| Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Nov. 2011) | (7,73 %) | 0,47 % |
| 1 Month SEK LIBOR Index | (0,02 %) | 0,17 % |

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

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

3 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Bond Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 30. Juni 2021: 1 Month CHF LIBOR Index; ab 01. Juli 2021: ICE BofA SARON Overnight Rate Index.*

4 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Bond Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 30. Juni 2021: 1 Month Euribor Index; ab 01. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index.*

5 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Bond Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 30. Juni 2021: 1 Month GBP LIBOR Index; ab 01. Juli 2021: SONIA ICE BofA SONIA Overnight Rate Index.*

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Das Long-Engagement in ausgewählten Schwellenmarktwährungen trug zur Wertentwicklung bei, da diese Währungen gegenüber dem US-Dollar aufwerteten.

» Das Short-Engagement in der britischen Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen im Vereinigten Königreich stiegen.

» Short-Engagements gegenüber dem Euro trugen zur Wertentwicklung bei, da sie gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

» Das Long-Engagement in der US-Duration war der Wertentwicklung abträglich, da die US-Zinsen stiegen.

» Positionen in Investment-Grade-Unternehmensanleihen schmälerten die Wertentwicklung, da sich die Spreads dieser Wertpapiere weiteten.

» Das Long-Engagement in der italienischen Duration war der Wertentwicklung abträglich, da die italienischen Zinsen stiegen.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016) | (10,43 %) | 3,51 % |
| Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 25. Feb. 2016) | (10,43 %) | 3,52 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung 14. Aug. 2020) | (10,65 %) | (1,45 %) |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016) | (10,86 %) | 2,45 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung 10. Sep. 2020) | (10,86 %) | (1,73 %) |
| Class T, thesaurierend (Auflegung: 20. Okt. 2016) | (11,06 %) | 1,33 % |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 01. Aug. 2019) | (10,07 %) | 3,84 % |
| Euro Short-Term Rate (ESTER) Index[3] | (0,29 %) | (0,44 %)[2] |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| BM Retail AUD (Hedged) ausschüttend II (Auflegung 28. Apr. 2022) | — | (2,60 %) |
| M Retail AUD (Hedged) ausschüttend II (Auflegung 08. Apr. 2021) | (10,79 %) | (8,53 %) |
| 1 Month USD LIBOR Index | 0,08 % | 0,09 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Mrz. 2018) | (10,53 %) | 1,79 % |
| ICE BofA SARON Overnight Rate Index[4] | (0,34 %) | (0,77 %) |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016) | (9,99 %) | 4,30 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2019) | (9,93 %) | 4,36 % |
| ICE BofA SONIA Overnight Rate Index[5] | 0,32 % | 0,40 %[2] |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 30. Jul. 2021) | (9,70 %) | (9,70 %) |
| M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung 18. Dez. 2020) | (10,23 %) | (5,72 %) |
| Compounded SG Overnight Rate Avg SORA Index | 0,26 % | 0,29 %[2] |
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016) | (9,70 %) | 5,52 % |
| Institutional USD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 30. Apr. 2021) | (9,68 %) | (7,35 %) |
| Investor USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Mai 2021) | (9,88 %) | (6,98 %) |
| BM Retail USD (Hedged) ausschüttend II (Auflegung 28. Apr. 2022) | — | (2,40 %) |
| Class E USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Mrz. 2017) | (10,17 %) | 3,39 % |
| Class E USD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Mrz. 2021) | (10,22 %) | (6,76 %) |
| Class E USD (Hedged), ausschüttend II Q (Auflegung: 09. Sep. 2021) | (10,10 %) | (11,45 %) |
| H Institutional USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 05. Aug. 2020) | (9,79 %) | (0,74 %) |
| M Retail USD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung 08. Jan. 2020) | (10,13 %) | 2,22 % |
| Class T USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Sep. 2021) | (10,27 %) | (11,80 %) |
| 1 Month USD LIBOR Index | 0,23 % | 1,06 %[2] |
| Secured Overnight Financing Rate (SOFR)[6] | 0,19 % | 0,21 % |

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 Dynamic Multi-Asset Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 30. Juni 2021: 1 Month Euribor Index; ab 01. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index.*

4 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Multi-Asset Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 30. Juni 2021: 1 Month CHF LIBOR Index; ab 01. Juli 2021: SARON ICE BofA SARON Overnight Rate Index.*

5 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Multi-Asset Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 30. Juni 2021: 1 Month GBP LIBOR Index; ab 01. Juli 2021: SONIA ICE BofA SONIA Overnight Rate Index.*

6 *Wertentwicklung des Vergleichsindex nur für die Klasse E USD (Hedged), ausschüttend II*

## 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 Fonds vorsieht.

## Kommentare zum Fonds

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

» Das Long-Engagement in US-Aktien schmälerte die Rendite, da die Kurse nachgaben.

» Das Long-Engagement in taiwanesischen Aktien belastete die Wertentwicklung, da die Kurse fielen.

» Das Long-Engagement in der US-amerikanischen, australischen und kanadischen Duration schmälerte die Rendite, da die Renditen auf US-amerikanische, australische und kanadische Staatsanleihen stiegen.

» Das Long-Engagement in Schwellenmarktwährungen trug zur Rendite bei, da diese Währungen gegenüber dem Euro aufwerteten.

» Das Short-Engagement in europäischem Aktien trug zur Rendite bei, da die Kurse fielen.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 11. Dez. 2007) | (12,57 %) | 1,16 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2008) | (12,54 %) | 0,92 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Aug. 2010) | (12,71 %) | (0,95 %) |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 19. Nov. 2008) | (13,05 %) | 1,94 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung 08. Jul. 2010) | (13,02 %) | (1,21 %) |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2021) | (12,59 %) | (12,75 %) |
| Class Z, ausschüttend (Auflegung: 18. Nov. 2008) | (12,18 %) | 3,79 % |
| JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged) | (14,53 %) | 1,23 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2010) | (4,88 %) | 1,82 % |
| Institutional EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Jun. 2010) | (4,96 %) | 1,21 % |
| Investor EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Dez. 2019) | (5,03 %) | (4,63 %) |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2009) | (5,35 %) | 2,41 % |
| Class E EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018) | (5,39 %) | 0,62 % |
| JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged) | (7,03 %) | 3,48 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jun. 2008) | (2,49 %) | 4,77 % |
| JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (GBP Unhedged) | (4,68 %) | 4,82 % |

[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 Fonds legt grundsätzlich mindestens 80 % seiner Vermögenswerte in Rentenwerte (wie im Verkaufsprospekt definiert) an, die auf Währungen von Ländern mit Schwellenwertpapiermärkten lauten, die Terminkontrakte oder Derivate wie Optionen, Futures oder Swap-Vereinbarungen enthalten können.

## Kommentare zum Fonds

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

» Das untergewichtete Engagement in der lokalen russischen Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die lokalen Anleihekurse in Russland deutlich fielen.

» Das untergewichtete Engagement in der lokalen polnischen Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die lokalen Renditen in Polen stiegen.

» Das untergewichtete Engagement in der lokalen tschechischen Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die lokalen Renditen in Tschechien stiegen.

» Das übergewichtete Engagement in der lokalen brasilianischen Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die lokalen Renditen in Brasilien stiegen.

» Das übergewichtete Engagement im kolumbianischen Peso schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung nachgab.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jul. 2001) | (18,74 %) | 7,37 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 13. Dez. 2001) | (18,77 %) | 6,72 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 25. Apr. 2002) | (18,89 %) | 5,97 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 29. Mai 2003) | (18,95 %) | 4,86 % |
| BM Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022) | — | (6,93 %) |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | (19,10 %) | 3,51 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005) | (19,14 %) | 3,67 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 17. Okt. 2002) | (18,80 %) | 6,89 % |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung 03. Sep. 2020) | (18,80 %) | (10,34 %) |
| M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010) | (19,10 %) | 2,00 % |
| M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013) | (19,11 %) | 1,02 % |
| Class Z, ausschüttend (Auflegung: 18. Nov. 2008) | (18,41 %) | 6,82 % |
| JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global | (18,83 %) | 6,58 %[2] |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| M Retail AUD (Hedged) ausschüttend (Auflegung 19. Dez. 2012) | (19,64 %) | 0,55 % |
| JPMorgan EMBI Global (AUD Hedged) | (19,41 %) | 1,44 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Dez. 2005) | (19,43 %) | 2,61 % |
| JPMorgan EMBI Global (CHF Hedged) | (19,66 %) | 2,78 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2002) | (19,53 %) | 5,38 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Dez. 2010) | (19,60 %) | 1,70 % |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Dez. 2019) | (19,68 %) | (7,91 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | (19,88 %) | 2,29 % |
| JPMorgan EMBI Global (Euro Hedged) | (19,77 %) | 5,25 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)** | | |
| Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Feb. 2018) | (11,63 %) | 2,72 % |
| JPMorgan EMBI Global (EUR Unhedged) | (11,70 %) | 2,45 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2004) | (19,12 %) | 4,97 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005) | (19,22 %) | 3,92 % |
| JPMorgan EMBI Global (GBP Hedged) | (19,31 %) | 5,20 %[2] |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2018) | (18,83 %) | (0,76 %) |
| Class E SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2007) | (19,17 %) | 2,59 % |
| JPMorgan EMBI Global (SGD Hedged) | (18,97 %) | 3,87 %[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.

## Kommentare zum Fonds

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

» Das untergewichtete Engagement in Spreads von Schwellenländern trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads weiteten.

» Das untergewichtete Engagement in der US-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen in den USA stiegen.

» Das übergewichtete Engagement in ukrainischen staatlichen und quasi-staatlichen Schuldtiteln schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads in der Ukraine weiteten.

» Das Engagement in chinesischen Unternehmensanleihen schmälerte die Wertentwicklung, da ausgewählte chinesische Immobiliengesellschaften negative Renditen verzeichneten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2010) | (20,42 %) | 2,79 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 10. Jul. 2019) | (20,40 %) | (4,98 %) |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 10. Jul. 2019) | (20,62 %) | (5,43 %) |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 10. Jul. 2019) | (20,59 %) | (5,42 %) |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2021) | (20,76 %) | (17,29 %) |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 05. Feb. 2021) | (20,72 %) | (17,31 %) |
| JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified[3] | (21,13 %) | 3,19 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Apr. 2021) | (21,08 %) | (17,51 %) |
| JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (CHF Hedged)[3] | (21,94 %) | (17,71 %) |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2013) | (21,21 %) | (0,27 %) |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2017) | (21,27 %) | (3,94 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Aug. 2018) | (21,54 %) | (3,98 %) |
| JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (EUR Hedged)[3] | (22,08 %) | 0,16 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2019) | (20,86 %) | (7,53 %) |
| JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (GBP Hedged)[3] | (21,64 %) | (8,20 %) |
| **Auf GBP lautende Klassen (nicht abgesichert)** | | |
| Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung 11. Dez. 2020) | (11,25 %) | (9,97 %) |
| JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (GBP Unhedged)[3] | (12,03 %) | (10,22 %) |
| **Auf NOK lautende Klassen** | | |
| Investor NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Mrz. 2014) | (20,96 %) | 0,47 % |
| JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (NOK Hedged)[3] | (21,58 %) | 0,98 % |
| **Auf SEK lautende Klassen** | | |
| Investor SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Feb. 2014) | (21,31 %) | (0,58 %) |
| Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Okt. 2021) | (21,39 %) | (22,14 %) |
| JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (SEK Hedged)[3] | (22,09 %) | 0,14 %[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 Emerging Markets Bond ESG Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 01. August 2019: JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global, bereinigt um den Socially Responsible Investment (SRI) Filter; seit dem 02. August 2019: JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified.*

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Markets Bond ESG Fund strebt eine maximale Gesamtrendite an, bei gleichzeitigem Kapitalerhalt, umsichtiger Anlageverwaltung und nachhaltiger Anlage (durch die ausdrückliche Einbeziehung von ökologischen, sozialen und Unternehmensführungsfaktoren in das Anlageverfahren, wie ausführlicher in der Ergänzung beschrieben). Hierzu investiert er mindestens 80 % seines Vermögens in ein aktiv verwaltetes diversifiziertes Portfolio von Festzinsinstrumenten (gemäß deren Definition im Prospekt) von Emittenten, die wirtschaftlich mit Ländern mit Schwellenmarkt-Wertpapiermärkten verbunden sind. Die Beteiligung an solchen Emittenten lässt sich über die direkte Anlage in Rentenpapiere (wie im Verkaufsprospekt definiert) oder über den Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten (wie im Fondsnachtrag näher definiert) erreichen. Alle Wertpapiere werden gemäß dem internen verantwortungsbezogenen Auswahlverfahren der Anlageberatungsgesellschaft ausgewählt, das darauf ausgelegt ist, ESG-Faktoren (Umwelt, Soziales und Governance) zu berücksichtigen, und das unter anderem ein ethisches Auswahlverfahren umfasst, das die sozial verantwortliche Anlageberatungsgesellschaft (wie im Verkaufsprospekt definiert) von Zeit zu Zeit vorgibt.

## Kommentare zum Fonds

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

» Ein untergewichtetes Portfolio-Engagement in Spreads von Schwellenländern trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads weiteten.

» Die Untergewichtung russischer Staatsanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads in Russland weiteten.

» Das nicht vorhandene Engagement in Belarus trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads in Belarus weiteten.

» Ein übergewichtetes Portfolio-Engagement in ukrainischen staatlichen und quasi-staatlichen Schuldtiteln schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads in der Ukraine weiteten.

» Das nicht vorhandene bzw. untergewichtete Engagement in ölbezogenen Staatsanleihen (Saudi-Arabien bzw. VAE) schmälerte die Wertentwicklung, da diese Länder den Vergleichsindex übertrafen.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Nov. 2009) | (17,11 %) | 3,16 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 27. Feb. 2012) | (17,52 %) | 1,15 % |
| JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI) | (14,73 %) | 4,63 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2012) | (18,02 %) | (0,55 %) |
| JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (CHF Hedged) | (15,41 %) | 1,81 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Feb. 2010) | (17,79 %) | 1,87 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mrz. 2010) | (18,17 %) | 0,84 % |
| JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (EUR Hedged) | (15,48 %) | 3,29 %[2] |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Das untergewichtete Engagement in Spreads von Unternehmensanleihen aus Schwellenländern trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads weiteten.

» Das übergewichtete Engagement in brasilianischen Unternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da brasilianische Unternehmensanleihen den Index (JP Morgan Corporate Emerging Market Bond Index (EMBI) Diversified Composite Index) übertrafen.

» Das übergewichtete Engagement in ukrainischen Unternehmensanleihen schmälerte die Wertentwicklung, da ukrainische Unternehmensanleihen gegenüber dem Index eine Underperformance verzeichneten.

» Die Titelauswahl bei chinesischen Unternehmensanleihen schmälerte die Wertentwicklung, da ausgewählte Immobilientitel Kursverluste hinnehmen mussten.

» Das übergewichtete Engagement in russischen Unternehmensanleihen schmälerte die Wertentwicklung, da russische Unternehmensanleihen gegenüber dem Index eine Underperformance verzeichneten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 04. Jun. 2019) | (10,82 %) | (0,36 %) |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2022) | — | (3,50 %) |
| 50 % JPMorgan EMBI Global Index / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD) Unhedged | (16,69 %) | (3,81 %) |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Jun. 2019) | (9,42 %) | (0,95 %) |
| Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Apr. 2022) | — | (6,30 %) |
| 50 % JPMorgan EMBI Global Index (EUR Hedged) / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged) | (13,57 %) | (3,53 %)[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Mrz. 2022) | — | (6,52 %) |
| 50 % JPMorgan EMBI Global Index (GBP Hedged) / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (GBP Unhedged) | — | (6,12 %) |

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Das untergewichtete Engagement in der US-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen in den USA stiegen.

» Das untergewichtete Engagement in der polnischen Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen in Polen stiegen.

» Das untergewichtete Engagement im Euro trug zur Wertentwicklung bei, da die Währung nachgab.

» Das untergewichtete Engagement im mexikanischen Peso schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung zulegte.

» Das untergewichtete Engagement im südafrikanischen Rand schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung im ersten Quartal zulegte und im zweiten Quartal nachgab. Dies führte zu einer insgesamt negativen Wertentwicklung.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 19. Nov. 2008) | (7,54 %) | 0,88 % |
| JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged) | (9,84 %) | 0,78 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2010) | 0,94 % | 2,70 % |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2009) | 0,61 % | 2,21 % |
| JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (EUR Unhedged) | (1,93 %) | 2,84 %[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 Fonds nach Ländern und Währungen auf der Grundlage ihrer Bewertung von bestimmten Faktoren aus. Zu diesen Faktoren gehören Zinsprognosen, Inflationsraten, Devisenkurse, Geld- und Fiskalpolitik, Handels- und Leistungsbilanz, aktienmarktspezifische Faktoren und andere spezifische Faktoren, die der Anlageberatungsgesellschaft relevant erscheinen. Der Anlageschwerpunkt des Fonds wird wahrscheinlich auf Asien, Afrika, dem Nahen Osten, Lateinamerika und den aufstrebenden Ländern Europas liegen. Der Fonds kann in Instrumente investieren, deren Renditen auf den Renditen von Wertpapieren aus den Schwellenmärkten basieren, etwa derivative Instrumente, anstatt direkt in Wertpapiere oder Wertpapiere aus Schwellenmärkten zu investieren. Die durchschnittliche Duration des Portfolios dieses Fonds richtet sich nach den Zinsprognosen der Anlageberatungsgesellschaft. Unter normalen Marktbedingungen wird davon ausgegangen, dass sie nicht länger als zwei Jahre ist. Der Fonds kann seine Vermögenswerte insgesamt in hochrentierliche Wertpapiere anlegen, wobei höchstens 15 % der Vermögenswerte in Wertpapiere angelegt werden können, die von Moody's oder S&P niedriger als B bewertet werden bzw. die von Fitch ein entsprechendes Rating erhalten haben (oder, falls sie nicht bewertet sind, von der Anlageberatungsgesellschaft als von vergleichbarer Qualität eingestuft sind).

## Kommentare zum Fonds

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

» Das Engagement im russischen Rubel trug zur Wertentwicklung bei, da die Währung zulegte.

» Das untergewichtete Engagement in der Türkischen Lira trug zur Wertentwicklung bei, da die Währung nachgab.

» Das übergewichtete Engagement im chilenischen Peso und kolumbianischen Peso schmälerte die Wertentwicklung, da beide Währungen nachgaben.

» Das übergewichtete Engagement in der lokalen südafrikanischen Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die lokalen Renditen stiegen.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021) | (7,62 %) | (5,76 %) |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021) | (7,60 %) | (5,73 %) |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021) | (8,07 %) | (6,62 %) |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021) | (7,93 %) | (6,58 %) |
| Bloomberg U.S. Aggregate Index | (10,35 %) | (7,99 %) |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Nov. 2021) | (8,01 %) | (7,76 %) |
| Class R AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021) | (8,11 %) | (6,38 %) |
| Bloomberg U.S. Aggregate (AUD Hedged) Index | (10,77 %) | (8,44 %)[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021) | (8,28 %) | (6,88 %) |
| Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021) | (8,69 %) | (7,70 %) |
| Bloomberg U.S. Aggregate (CHF Hedged) Index | (11,25 %) | (9,34 %) |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021) | (8,27 %) | (6,79 %) |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Mai 2021) | (8,26 %) | (7,23 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Jun. 2021) | (8,65 %) | (9,08 %) |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021) | (8,67 %) | (7,62 %) |
| Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index | (11,23 %) | (9,20 %)[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021) | (7,73 %) | (6,15 %) |
| Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index | (10,67 %) | (8,36 %) |
| **Auf SEK lautende Klassen** | | |
| Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Okt. 2021) | (8,13 %) | (8,14 %) |
| Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Mai 2022) | — | (2,41 %) |
| Bloomberg U.S. Aggregate (SEK Hedged) Index | (11,01 %) | (11,12 %)[2] |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021) | (7,60 %) | (5,73 %) |
| Bloomberg U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index | (10,39 %) | (7,95 %) |

[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.*

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO ESG Income Fund strebt hohe laufende Erträge an, die mit einer umsichtigen Anlageverwaltung und nachhaltigen Anlagen vereinbar sind (durch die ausdrückliche Aufnahme von ökologischen, sozialen und Unternehmensführungsfaktoren [„ESG“] in das Anlageverfahren, wie in der Ergänzung näher beschrieben). Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel.

## Kommentare zum Fonds

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

» Das Short-Engagement in der britischen Duration trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da die Zinsen im Vereinigten Königreich stiegen.

» Das Short-Engagement in der japanischen Duration trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da die Zinsen in Japan stiegen.

» Das Long-Engagement in einem Korb von Schwellenmarktwährungen trug zur Wertentwicklung bei, da diese Währungen gegenüber dem US-Dollar aufwerteten.

» Das Long-Engagement in der US-Duration war der absoluten Wertentwicklung abträglich, da die US-Zinsen stiegen.

» Positionen in hochverzinslichen Unternehmensanleihen schmälerten die absolute Wertentwicklung, da sich die Spreads dieser Wertpapiere weiteten.

» Positionen in Investment-Grade-Unternehmensanleihen schmälerten die absolute Wertentwicklung, da sich die Spreads dieser Wertpapiere weiteten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Dez. 1998) | (12,40 %) | 3,59 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 07. Jan. 2003) | (12,41 %) | 3,27 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2002) | (12,58 %) | 3,22 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 07. Jun. 2001) | (12,64 %) | 3,11 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | (12,80 %) | 1,95 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 10. Okt. 2005) | (12,83 %) | 1,72 % |
| FTSE Euro Broad Investment-Grade Index | (12,09 %) | 3,39 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2006) | (12,45 %) | 2,12 % |
| FTSE Euro Broad Investment-Grade (CHF Hedged) Index | (12,08 %) | 2,16 % |

[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 Euro Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus auf Euro lautenden Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt. Der Fonds bewirbt ökologische Merkmale, hat jedoch keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel. Weitere Informationen finden Sie in der Ergänzung im Prospekt mit dem Titel „Bewerben ökologischer Merkmale“.

## Kommentare zum Fonds

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

» Das untergewichtete Engagement in nicht aus dem Finanzsektor stammenden Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads der Unternehmensanleihen auf breiter Front weiteten.

» Das untergewichtete Engagement in der US-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen in den USA stiegen.

» Das untergewichtete Engagement in der Duration in Europa insgesamt, einschließlich der Eurozone und Dänemarks, trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinssätze an den europäischen Märkten auf breiter Front stiegen.

» Das Long-Engagement in ausgewählten hochverzinslichen Unternehmensanleihen schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads der Unternehmensanleihen auf breiter Front weiteten.

» Das übergewichtete Engagement in verbrieften Schuldtiteln, vornehmlich durch RMBS, schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads weiteten.

» Das übergewichtete Engagement in den europäischen Randländern, vornehmlich in Spanien, schmälerte die Wertentwicklung, da sich der Spread gegenüber deutschen Bundesanleihen weitete.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2008) | (13,88 %) | 2,71 % |
| Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 01. Okt. 2013) | (13,93 %) | 1,14 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2010) | (14,25 %) | 1,24 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 07. Jun. 2019) | (13,90 %) | (3,88 %) |
| H Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 07. Jun. 2019) | (13,82 %) | (3,86 %) |
| Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index | (12,83 %) | 2,59 %[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 Fonds legt mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein breit gefächertes Portfolio von auf Euro lautenden Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten an. Diese enthalten direkte oder indirekte Beteiligungen an kreditnahen Rentenwerten oder derivativen Instrumenten, wie Optionen, Futures Swaps oder Credit Default Swaps. Der Fonds bewirbt ökologische Merkmale, hat jedoch keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel. Weitere Informationen finden Sie in der Ergänzung im Prospekt mit dem Titel „Bewerben ökologischer Merkmale“.

## Kommentare zum Fonds

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

» Die Untergewichtung des regierungsnahen Sektors und insbesondere der staatlichen Emittenten aus Osteuropa, die eine Underperformance verzeichneten, trug zur Wertentwicklung bei.

» Die Titelauswahl im Bankensektor, insbesondere das Engagement in ausgewählten erstrangigen Finanztiteln, die vor dem Hintergrund steigender Zinsen eine Outperformance verzeichneten, trug zur Wertentwicklung bei.

» Die Makro-Strategien, insbesondere eine Long-Position in Swap-Spreads, schmälerten die Wertentwicklung aufgrund des volatilen Marktumfelds.

» Die Titelauswahl bei Auslandsschulden von Schwellenländern schmälerte die Wertentwicklung, da das Engagement in einem quasi-staatlichen russischen Emittenten aufgrund der Invasion der Ukraine und der anschließenden Ankündigung von Sanktionen eine Underperformance verzeichnete.

» Die Übergewichtung von Immobilienfonds schmälerte die Wertentwicklung, da der Sektor aufgrund von Sorgen über die Auswirkungen steigender Zinsen hinter dem breiteren Markt zurückblieb.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2011) | (12,98 %) | 2,84 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2011) | (12,86 %) | 2,86 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 13. Dez. 2019) | (13,07 %) | (4,68 %) |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 29. Mai 2012) | (13,07 %) | 2,42 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2011) | (13,34 %) | 1,92 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2011) | (13,33 %) | 1,92 % |
| Class E, ausschüttend Q (Auflegung: 30. Sep. 2019) | (13,33 %) | (4,71 %) |
| Class T, thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014) | (13,55 %) | (0,57 %) |
| Class T, ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014) | (13,49 %) | (0,56 %) |
| Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index | (8,17 %) | 1,91 %[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 Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von auf Euro lautenden Anleihen und anderen Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten. Der 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. Der Fonds bewirbt ökologische Merkmale, hat jedoch keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel. Weitere Informationen finden Sie in der Ergänzung im Prospekt mit dem Titel „Bewerben ökologischer Merkmale“.

## Kommentare zum Fonds

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

» Das Long-Engagement in ausgewählten Schwellenmarktwährungen trug zur Wertentwicklung bei, da diese Währungen gegenüber dem US-Dollar aufwerteten.

» Das Short-Engagement in der britischen Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen im Vereinigten Königreich stiegen.

» Das Short-Engagement in der japanischen Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen in Japan stiegen.

» Positionen in hochverzinslichen Unternehmensanleihen schmälerten die Wertentwicklung, da sich die Spreads dieser Wertpapiere weiteten.

» Positionen in Investment-Grade-Unternehmensanleihen schmälerten die Wertentwicklung, da sich die Spreads dieser Wertpapiere weiteten.

» Positionen in Schwellenmarktanleihen schmälerten die Wertentwicklung, da sich die Spreads dieser Wertpapiere weiteten, und aufgrund der Titelauswahl.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 21. Apr. 2006) | (26,55 %) | 4,91 % |
| Bloomberg Euro Government (Deutschland, Frankreich, Niederlande) + 15 Jahre Index[2] | (26,18 %) | 3,89 % |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Das untergewichtete Engagement in der Duration des Euro-Blocks trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen stiegen.

» Das Engagement in der US-Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen stiegen.

» Das Engagement in inflationsgebundenen US-Anleihen und das Short-Engagement in der britischen Breakeven-Inflation schmälerten die relative Wertentwicklung, da die Realzinsen in den USA stiegen und die britische Breakeven-Inflation zunahm.

» Das Engagement in verbrieften Schuldtiteln, vornehmlich durch europäische RMBS und US-amerikanische Agency-Hypotheken, schmälerte die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads weiteten.

» Das Engagement in Unternehmensanleihen schmälerte die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads weiteten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2006) | (1,84 %) | 0,98 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | (2,16 %) | 0,22 % |
| Euro Short-Term Rate (ESTER) Index[3] | (0,29 %) | 0,70 %[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 Short-Term Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 30. Juni 2021: 1 Month Euribor Index; ab 01. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index.*

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Das Short-Engagement in der Duration der Eurozone trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.

» Es gab keine sonstigen Faktoren, die einen wesentlichen Beitrag zu diesem Fonds leisteten.

» Das Long-Engagement in Unternehmensanleihen, sowohl im Investment-Grade- als auch im Hochzinsbereich, schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads der Unternehmensanleihen weiteten.

» Das Long-Engagement in der dänischen Duration war der Wertentwicklung abträglich, da die Zinsen in Dänemark stiegen.

» Ein moderates Engagement in quasi-staatlichen russischen Hartwährungsanleihen belastete die Wertentwicklung, da an den russischen Kreditmärkten ein Abverkauf stattfand.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2020) | (14,46 %) | (3,27 %) |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2020) | (14,22 %) | (2,75 %) |
| ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index | (14,73 %) | (4,47 %) |

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Die Titelauswahl im Energiesektor trug zur Wertentwicklung bei, da ein ausgewählter übergewichteter Emittent eine Outperformance verzeichnete.

» Die Titelauswahl im Chemiesektor trug zur Wertentwicklung bei, da ausgewählte übergewichtete Emittenten eine Outperformance verzeichneten.

» Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Gesundheitssektor trugen zur Wertentwicklung bei, da der Sektor eine Outperformance verzeichnete.

» Die Titelauswahl im Transportsektor schmälerte die Wertentwicklung, da ausgewählte übergewichtete Emittenten eine Underperformance verzeichneten.

» Die Titelauswahl im Finanz- und Versicherungssektor schmälerte die Wertentwicklung, da ausgewählte übergewichtete Emittenten eine Underperformance verzeichneten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 05. Jul. 2011) | (3,35 %) | 0,85 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Mrz. 2013) | (3,58 %) | (0,64 %) |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jan. 2020) | (3,45 %) | (1,93 %) |
| Euro Short-Term Rate (ESTER) Index[3] | (0,29 %) | 1,00 %[2] |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*
[3] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO European Short-Term Opportunities Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 29. September 2012: PIMCO European Advantage Government 1-3 Year Bond Index; vom 30. September 2012 bis zum 16. Januar 2020: Bloomberg Euro Aggregate ex Treasury 1-3 Year Index; seit dem 17. Januar 2020: Euro Short-Term Rate (ESTER). Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem 30. Juni 2011 berechnet.*

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Das Short-Engagement in der US-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die US-Zinsstrukturkurve anstieg.

» Das Long-Engagement in europäischen Breakevens, vornehmlich in Italien, trug zur Wertentwicklung bei, da die Inflationserwartungen stiegen.

» Das Short-Engagement in der britischen Duration im ersten Quartal 2022 trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen im Vereinigten Königreich stiegen.

» Das Long-Engagement in der Duration in Europa insgesamt, einschließlich der Eurozone und Dänemarks, schmälerte die Wertentwicklung, da die Zinssätze an den europäischen Märkten auf breiter Front stiegen.

» Das Long-Engagement in ausgewählten Unternehmensanleihen, sowohl im Investment-Grade- als auch im Hochzinsbereich, schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads der Unternehmensanleihen auf breiter Front weiteten.

» Das Long-Engagement in den Staatsanleihen-Spreads der europäischen Randländer, insbesondere eine Long-Position in Italien, schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads gegenüber deutschen Bundesanleihen weiteten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 09. Jun. 2009) | (12,86 %) | 2,24 % |
| PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close) | (12,83 %) | 1,78 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Aug. 2011) | (8,77 %) | 1,45 % |
| PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (CHF, Partially Hedged) (London Close) | (8,79 %) | 0,98 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Mai 2010) | (7,85 %) | 2,28 % |
| Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Mai 2010) | (8,41 %) | 1,27 % |
| PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (EUR, Partially Hedged) (London Close) | (7,92 %) | 1,90 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Jul. 2012) | (6,93 %) | 2,26 % |
| PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (GBP, Partially Hedged) (London Close) | (6,88 %) | 1,87 % |
| **Auf NOK lautende Klassen** | | |
| Institutional NOK (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Mrz. 2012) | (6,76 %) | 3,49 % |
| PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (NOK, Partially Hedged) (London Close) | (6,67 %) | 3,11 % |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Das untergewichtete Engagement in der US-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen in den USA stiegen.

» Das untergewichtete Engagement in der britischen Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen im Vereinigten Königreich stiegen.

» Das untergewichtete Engagement in der russischen Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen in Russland stiegen.

» Ein leicht übergewichtetes Engagement in der Duration in Europa insgesamt, einschließlich der Eurozone, Dänemarks und der Schweiz, schmälerte die Wertentwicklung, da die Zinssätze an den europäischen Märkten auf breiter Front stiegen.

» Das übergewichtete Engagement in verbrieften Schuldtiteln, insbesondere durch Non-Agency-RMBS aus den USA, schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads weiteten.

» Das übergewichtete Engagement in Finanzwerten schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads der Finanzwerte weiteten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Mrz. 1998) | (9,65 %) | 4,94 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2001) | (9,62 %) | 4,60 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 1999) | (9,81 %) | 4,42 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 23. Jan. 2001) | (9,81 %) | 4,25 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 14. Jun. 2004) | (9,86 %) | 3,92 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | (10,05 %) | 3,40 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005) | (10,04 %) | 3,37 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002) | (9,73 %) | 4,27 % |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2020) | (9,76 %) | (2,70 %) |
| M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 26. Apr. 2017) | (10,03 %) | 0,62 % |
| Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (10,21 %) | 1,12 % |
| Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (10,23 %) | 1,12 % |
| Class W, thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (9,59 %) | (4,67 %) |
| Class W, ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (9,58 %) | (4,69 %) |
| Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index[3] | (9,06 %) | 4,21 %[2] |
| **Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)** | | |
| Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 13. Dez. 2002) | (14,38 %) | 3,86 % |
| Institutional (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 23. Mär. 2006) | (14,43 %) | 3,43 % |
| Class E (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 19. Mai 2010) | (14,79 %) | 1,43 % |
| Class E (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 19. Mai 2010) | (14,83 %) | 1,42 % |
| H Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2021) | (14,56 %) | (12,75 %) |
| Class W (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (14,40 %) | (7,93 %) |
| W Class (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (14,43 %) | (7,94 %) |
| Bloomberg Global Aggregate (USD Unhedged) Index[3] | (13,91 %) | 3,03 %[2] |
| **Auf CAD lautende Klassen** | | |
| Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2018) | (9,71 %) | 0,84 % |
| Bloomberg Global Aggregate (CAD Hedged) Index[3] | (9,10 %) | 0,79 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2003) | (10,29 %) | 2,52 % |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 10. Apr. 2003) | (10,31 %) | 2,56 % |
| Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Jun. 2011) | (10,46 %) | 1,66 % |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Jun. 2018) | (10,66 %) | (1,78 %) |
| Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (10,25 %) | (5,84 %) |
| Class W CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (10,28 %) | (5,84 %) |
| Bloomberg Global Aggregate (CHF Hedged) Index[3] | (9,88 %) | 1,72 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Apr. 2003) | (10,33 %) | 3,48 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Apr. 2005) | (10,32 %) | 3,33 % |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Feb. 2005) | (10,45 %) | 2,97 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | (10,69 %) | 2,53 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2016) | (10,68 %) | (0,61 %) |
| G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2012) | (10,69 %) | 0,29 % |
| Class R EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (10,42 %) | 0,92 % |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014) | (10,80 %) | (0,45 %) |
| Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (10,22 %) | (5,67 %) |
| Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (10,23 %) | (5,66 %) |
| Bloomberg Global Aggregate (EUR Hedged) Index[3] | (9,86 %) | 2,61 %[2] |

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Das untergewichtete Engagement in der US-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen in den USA stiegen.

» Das untergewichtete Engagement in der britischen Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen im Vereinigten Königreich stiegen.

» Das untergewichtete Engagement in nicht aus dem Finanzsektor stammenden Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads von Nichtfinanzwerten mit Investment-Grade-Rating weiteten.

» Das übergewichtete Engagement in der Duration in Europa insgesamt, einschließlich der Eurozone, Dänemarks und der Schweiz, schmälerte die Wertentwicklung, da die Zinssätze an den europäischen Märkten auf breiter Front stiegen.

» Das übergewichtete Engagement in Finanzwerten schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads der Finanzwerte weiteten.

» Das übergewichtete Engagement in verbrieften Schuldtiteln, vornehmlich durch RMBS, schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads weiteten.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1] (Forts.)

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)** | | |
| Institutional EUR (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 20. Feb. 2013) | (6,88 %) | 3,17 % |
| Bloomberg Global Aggregate (EUR Unhedged) Index[3] | (6,36 %) | 2,70 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2003) | (9,79 %) | 4,43 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Jun. 2004) | (9,75 %) | 4,45 % |
| Investor GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Apr. 2005) | (9,97 %) | 3,80 % |
| Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (9,72 %) | (4,89 %) |
| Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (9,81 %) | (4,96 %) |
| Bloomberg Global Aggregate (GBP Hedged) Index[3] | (9,30 %) | 3,64 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen (Währungsrisiko)** | | |
| Institutional GBP (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 09. Mrz. 2018) | (4,51 %) | 1,78 % |
| Bloomberg Global Aggregate (GBP Unhedged) Index[3] | (3,99 %) | 1,67 % |
| **Auf HKD lautende Klassen** | | |
| M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend II (Auflegung: 26. Apr. 2017) | (9,43 %) | 0,76 % |
| Bloomberg Global Aggregate (HKD Unhedged) Index[3] | (8,47 %) | 1,38 % |
| **Auf NOK lautende Klassen** | | |
| Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005) | (9,77 %) | 4,48 % |
| Investor NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Jul. 2006) | (9,93 %) | 4,48 % |
| Class E NOK (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Apr. 2021) | (10,17 %) | (8,70 %) |
| Class W NOK (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Apr. 2021) | (9,72 %) | (7,78 %) |
| Bloomberg Global Aggregate (NOK Hedged) Index[3] | (9,18 %) | 3,61 %[2] |
| **Auf NZD lautende Klassen** | | |
| Institutional NZD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Nov. 2004) | (9,68 %) | 6,41 % |
| Bloomberg Global Aggregate (NZD Hedged) Index[3] | (9,10 %) | 5,52 % |
| **Auf SEK lautende Klassen** | | |
| Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Nov. 2004) | (10,14 %) | 3,64 % |
| Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2021) | (10,37 %) | (11,12 %) |
| M Retail SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2021) | (10,53 %) | (8,85 %) |
| Class W SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (10,09 %) | (5,33 %) |
| Bloomberg Global Aggregate (SEK Hedged) Index[3] | (9,65 %) | 2,71 %[2] |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Aug. 2009) | (9,60 %) | 4,44 % |
| Bloomberg Global Aggregate (SGD Hedged) Index[3] | (9,06 %) | 2,92 % |

[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 Global Aggregate (USD Hedged) Index.*

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017) | (9,92 %) | 1,44 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung 03. Apr. 2020) | (9,85 %) | (1,88 %) |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 07. Nov. 2018) | (10,01 %) | 0,92 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 07. Mrz. 2019) | (10,07 %) | 0,00 % |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 07. Mrz. 2019) | (10,05 %) | 0,01 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 08. Mrz. 2019) | (10,26 %) | (0,43 %) |
| Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index | (9,06 %) | 1,29 %[2] |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017) | (9,97 %) | 1,65 % |
| Bloomberg Global Aggregate (AUD Hedged) Index | (9,41 %) | 1,02 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017) | (10,50 %) | (0,84 %) |
| Bloomberg Global Aggregate (CHF Hedged) Index | (9,88 %) | (1,02 %) |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017) | (10,49 %) | (0,50 %) |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017) | (10,55 %) | (0,51 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 09. Feb. 2017) | (10,94 %) | (1,38 %) |
| Bloomberg Global Aggregate (EUR Hedged) Index | (9,86 %) | (0,65 %)[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)** | | |
| Institutional EUR (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 29. Nov. 2021) | (7,23 %) | (7,60 %) |
| Bloomberg Global Aggregate (EUR Unhedged) Index | (6,36 %) | (7,14 %) |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 03. Jun. 2020) | (9,99 %) | (3,54 %) |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017) | (9,99 %) | 0,43 % |
| Bloomberg Global Aggregate (GBP Hedged) Index | (9,30 %) | 0,31 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen (nicht abgesichert)** | | |
| Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung 11. Dez. 2020) | 0,57 % | (1,89 %) |
| Bloomberg Global Aggregate (GBP Unhedged) Index | 1,43 % | (0,70 %) |
| **Auf NOK lautende Klassen** | | |
| Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017) | (10,04 %) | 0,70 % |
| Bloomberg Global Aggregate (NOK Hedged) Index | (9,18 %) | 0,66 % |
| **Auf NZD lautende Klassen** | | |
| Institutional NZD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 05. Apr. 2017) | (9,82 %) | 1,24 % |
| Bloomberg Global Aggregate (NZD Hedged) Index | (9,10 %) | 1,24 % |
| **Auf SEK lautende Klassen** | | |
| Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Mai 2021) | (10,36 %) | (9,25 %) |
| Bloomberg Global Aggregate (SEK Hedged) Index | (9,65 %) | (8,10 %) |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Bond ESG Fund strebt eine maximale Gesamtrendite an, die mit Kapitalerhalt, einer umsichtigen Anlageverwaltung und nachhaltigen Anlagen vereinbar ist (durch die ausdrückliche Aufnahme von ökologischen, sozialen und Unternehmensführungsfaktoren in das Anlageverfahren, wie in der Ergänzung näher beschrieben). Der Teilfonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die auf führende Weltwährungen lauten.

## Kommentare zum Fonds

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

» Das untergewichtete Engagement in der US-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen in den USA stiegen.

» Das untergewichtete Engagement in der britischen Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsstrukturkurve im Vereinigten Königreich anstieg.

» Die Untergewichtung von nicht aus dem Finanzsektor stammenden Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads der Unternehmensanleihen auf breiter Front weiteten.

» Das übergewichtete Engagement in der Duration in Europa insgesamt, einschließlich der Eurozone, Dänemarks und der Schweiz, schmälerte die Wertentwicklung, da die Zinssätze an den europäischen Märkten auf breiter Front stiegen.

» Das übergewichtete Engagement in erstrangigen Finanzwerten schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads erstrangiger Finanzwerte weiteten.

» Die Übergewichtung verbriefter Schuldtitel, vornehmlich Non-Agency-RMBS, schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads weiteten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2003) | (8,41 %) | 4,36 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 09. Nov. 2005) | (8,45 %) | 4,43 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2006) | (8,60 %) | 4,01 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 14. Sep. 2004) | (8,69 %) | 4,00 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2008) | (8,85 %) | 3,55 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018) | (8,57 %) | 0,67 % |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 30. Okt. 2019) | (8,23 %) | (1,14 %) |
| Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index[3] | (7,90 %) | 3,44 %[2] |
| **Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)** | | |
| Class E (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 04. Okt. 2016) | (17,21 %) | (2,55 %) |
| Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Unhedged) Index[3] | (16,49 %) | (2,17 %) |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Apr. 2006) | (9,05 %) | 3,71 % |
| Bloomberg Global Aggregate ex-USD (EUR Hedged) Index[3] | (8,64 %) | 2,57 % |

[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 Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index.*

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Das untergewichtete Engagement in der US-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen in den USA stiegen.

» Das untergewichtete Engagement in der britischen Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen im Vereinigten Königreich stiegen.

» Das untergewichtete Engagement in nicht aus dem Finanzsektor stammenden Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads von Nichtfinanzwerten mit Investment-Grade-Rating weiteten.

» Das übergewichtete Engagement in der Duration in Europa insgesamt, einschließlich der Eurozone, Dänemarks und der Schweiz, schmälerte die Wertentwicklung, da die Zinssätze an den europäischen Märkten auf breiter Front stiegen.

» Das übergewichtete Engagement in Finanzwerten schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads der Finanzwerte weiteten.

» Das übergewichtete Engagement in verbrieften Schuldtiteln, insbesondere durch Non-Agency-RMBS, schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads weiteten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Apr. 2009) | (17,86 %) | 5,21 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 24. Sep. 2010) | (18,02 %) | 3,21 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung 22. Jun. 2009) | (18,35 %) | 3,70 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Jan. 2011) | (18,37 %) | 2,09 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2022) | — | (6,50 %) |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2022) | — | (6,58 %) |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 06. Jul. 2016) | (17,52 %) | 6,41 % |
| 60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg Global Aggregate USD Hedged | (15,79 %) | 7,50 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Apr. 2009) | (17,27 %) | 4,41 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 22. Jun. 2009) | (17,77 %) | 2,91 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 24. Jun. 2011) | (17,80 %) | 1,16 % |
| 60 % MSCI All Country World Index EUR Hedged/40 % Bloomberg Global Aggregate EUR Hedged | (15,19 %) | 6,51 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Apr. 2010) | (16,75 %) | 3,50 % |
| 60 % MSCI All Country World Index GBP Hedged/40 % Bloomberg Global Aggregate GBP Hedged | (14,65 %) | 5,72 % |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Das übergewichtete Engagement in US-Aktien belastete die relative Wertentwicklung, da diese Wertpapiere über den Berichtszeitraum negative Renditen verzeichneten.

» Die Durationspositionierung in Europa, insbesondere die Übergewichtung im langen Bereich der Zinsstrukturkurve, schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Kurve anstieg.

» Die Positionierung in der US-Duration, insbesondere die Untergewichtung im mittleren Bereich der Zinsstrukturkurve, trug zur Wertentwicklung bei, da diese Bereiche der Kurve anstiegen.

» Das übergewichtete Engagement in verbrieften Schuldtiteln, vornehmlich Non-Agency-MBS, schmälerte die relative Wertentwicklung, da diese Wertpapiere allgemein negative Renditen erzielten.

» Das übergewichtete Engagement bei japanischen Aktien belastete die relative Wertentwicklung, da diese Wertpapiere im Allgemeinen negative Renditen verbuchten.

» Die Untergewichtung der Schwellenmarktaktien trug zur relativen Wertentwicklung bei, da Schwellenmarktaktien im Laufe des Berichtszeitraums fielen.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005) | (14,64 %) | 5,46 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005) | (14,67 %) | 5,45 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 22. Jun. 2016) | (14,81 %) | 2,52 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 27. Jun. 2008) | (14,83 %) | 4,91 % |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 11. Dez. 2015) | (14,81 %) | 3,13 % |
| BM Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022) | — | (7,64 %) |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006) | (15,01 %) | 4,40 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006) | (15,06 %) | 4,47 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Aug. 2008) | (14,67 %) | 5,38 % |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Mrz. 2013) | (14,69 %) | 3,03 % |
| M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010) | (14,96 %) | 3,65 % |
| M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013) | (15,00 %) | 2,11 % |
| Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (14,76 %) | 3,24 % |
| Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (15,22 %) | 1,74 % |
| Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (15,12 %) | 1,74 % |
| ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD[3] | (13,54 %) | 5,87 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Feb. 2010) | (15,25 %) | 3,58 % |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Aug. 2012) | (15,26 %) | 2,00 % |
| ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into CHF[3] | (14,36 %) | 4,04 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2008) | (15,36 %) | 4,09 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005) | (15,39 %) | 4,39 % |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Jan. 2011) | (15,51 %) | 2,76 % |
| Administrative EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 04. Aug. 2010) | (15,52 %) | 3,01 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | (15,73 %) | 3,36 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2016) | (15,76 %) | (0,01 %) |
| ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into EUR[3] | (14,43 %) | 4,62 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2012) | (14,91 %) | 3,46 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005) | (14,89 %) | 5,07 % |
| Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2010) | (15,06 %) | 3,70 % |
| Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Jun. 2009) | (15,30 %) | 4,88 % |
| ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into GBP[3] | (13,94 %) | 5,34 %[2] |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Apr. 2016) | (15,05 %) | 1,73 % |
| ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into SGD[3] | (13,63 %) | 3,29 % |

[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.*

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global High Yield Bond Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines 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 (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

» Das untergewichtete Engagement in CMBS und Immobilieninvestmentgesellschaften trug zur Wertentwicklung bei, da dieser Sektor schlechter abschnitt als der Gesamtmarkt.

» Das untergewichtete Engagement im Automobilsektor trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor schlechter abschnitt als der Gesamtmarkt.

» Die Titelauswahl bei CMBS und Immobilieninvestmentgesellschaften trug zur Wertentwicklung bei, da die Fondspositionen in CMBS und Immobilieninvestmentgesellschaften besser abschnitten als der Sektor insgesamt.

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

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

» Die Titelauswahl im Sektor für unterstützende Dienstleistungen schmälerte die Wertentwicklung, da die Positionen des Fonds im Sektor für unterstützende Dienstleistungen schlechter abschnitten als der Sektor insgesamt.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 18. Apr. 2008) | (14,89 %) | 4,22 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Jul. 2003) | (14,91 %) | 4,43 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2005) | (15,03 %) | 3,80 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009) | (15,03 %) | 4,52 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2009) | (15,10 %) | 4,36 % |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Jan. 2009) | (15,06 %) | 4,36 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 10. Dez. 2008) | (15,26 %) | 4,15 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2008) | (15,24 %) | 3,24 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Aug. 2008) | (14,94 %) | 4,20 % |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018) | (14,88 %) | (0,01 %) |
| M Retail, ausschüttend (Auflegung: 28. Sep. 2012) | (15,32 %) | 1,36 % |
| M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013) | (15,18 %) | 1,51 % |
| Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (14,98 %) | 1,85 % |
| Class R, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (14,98 %) | 1,86 % |
| Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (15,37 %) | 0,52 % |
| Class W, thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (14,83 %) | (7,30 %) |
| Class W, ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (14,81 %) | (7,24 %) |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged) | (12,83 %) | 3,77 %[2] |
| **Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)** | | |
| Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 02. Aug. 2013) | (17,46 %) | 1,06 % |
| Institutional (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 06. Sep. 2016) | (17,50 %) | (0,42 %) |
| H Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2021) | (17,56 %) | (14,40 %) |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Unhedged) | (15,57 %) | 1,15 %[2] |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 07. Apr. 2020) | (15,30 %) | (2,82 %) |
| Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018) | (15,48 %) | (0,86 %) |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (AUD Hedged) | (13,29 %) | 0,58 %[2] |
| **Auf CAD lautende Klassen** | | |
| Institutional CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jul. 2021) | (15,76 %) | (17,33 %) |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (CAD Hedged) | (12,93 %) | (13,90 %) |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Dez. 2009) | (15,51 %) | 2,17 % |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 06. Feb. 2015) | (15,56 %) | (0,63 %) |
| Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Mai 2011) | (15,66 %) | 0,98 % |
| Investor CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009) | (15,68 %) | 3,01 % |
| Administrative CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2013) | (15,71 %) | (0,19 %) |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Mrz. 2012) | (15,89 %) | 0,15 % |
| Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (15,55 %) | (8,44 %) |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (CHF Hedged) | (13,71 %) | 2,67 %[2] |
| **Auf CZK lautende Klassen** | | |
| Institutional CZK (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2015) | (13,27 %) | 0,57 % |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (CZK Hedged) | (11,28 %) | 0,97 % |

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Die Makro-Strategien trugen im Rahmen eines taktischen Engagements in ausgewählten Schwellenmarktwährungen zur Wertentwicklung bei.

» Die Titelauswahl im Chemiesektor trug zur Wertentwicklung bei, da ein ausgewählter übergewichteter Emittent eine Outperformance verzeichnete.

» Die Titelauswahl bei Auslandsschulden von Schwellenländern schmälerte die Wertentwicklung, da das Engagement in russischen Schuldtiteln eine Underperformance verzeichnete.

» Das übergewichtete Engagement im Glücksspielsektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da dieser Sektor schlechter abschnitt als der Gesamtmarkt.

» Das übergewichtete Engagement in und die Titelauswahl bei Immobilieninvestmentgesellschaften schmälerte die Wertentwicklung, da der Sektor unterdurchschnittlich abschnitt.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1] (Forts.)

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2003) | (15,54 %) | 3,56 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Sep. 2008) | (15,55 %) | 3,52 % |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2006) | (15,69 %) | 3,04 % |
| Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009) | (15,74 %) | 3,53 % |
| Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Feb. 2009) | (15,76 %) | 3,25 % |
| Administrative EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2009) | (15,74 %) | 3,25 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | (15,92 %) | 2,42 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Sep. 2010) | (15,97 %) | 1,15 % |
| Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (15,64 %) | 0,42 % |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014) | (16,09 %) | (1,10 %) |
| Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (15,52 %) | (8,33 %) |
| Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (15,54 %) | (8,30 %) |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (EUR Hedged) | (13,72 %) | 2,87 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)** | | |
| Institutional EUR (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2012) | (10,23 %) | 2,75 % |
| Class E EUR (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018) | (10,61 %) | 0,49 % |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (EUR Unhedged) | (8,16 %) | 3,03 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Sep. 2005) | (15,12 %) | 3,88 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Jul. 2008) | (15,14 %) | 4,06 % |
| Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009) | (15,19 %) | 4,10 % |
| Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jan. 2009) | (15,34 %) | 3,91 % |
| Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mrz. 2009) | (15,48 %) | 3,61 % |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (15,18 %) | 1,23 % |
| Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (15,07 %) | (7,59 %) |
| Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020) | (15,06 %) | (7,57 %) |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (GBP Hedged) | (13,18 %) | 3,38 %[2] |
| **Auf HKD lautende Klassen** | | |
| Administrative HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017) | (14,57 %) | (0,22 %) |
| M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017) | (14,76 %) | (0,62 %) |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD hedged) Index denominated in HKD | (12,27 %) | (0,23 %) |
| **Auf NOK lautende Klassen** | | |
| Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Jan. 2012) | (15,01 %) | 2,98 % |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (NOK Hedged) | (13,08 %) | 2,92 % |
| **Auf SEK lautende Klassen** | | |
| Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Dez. 2009) | (15,34 %) | 3,07 % |
| Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Dez. 2012) | (15,55 %) | 0,38 % |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (SEK Hedged) | (13,55 %) | 2,75 %[2] |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015) | (14,79 %) | 1,56 % |
| Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018) | (15,06 %) | (0,48 %) |
| Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Sept. 2017) | (15,12 %) | (0,90 %) |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jul. 2012) | (15,25 %) | 1,40 % |
| Class W SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 13. Okt. 2020) | (14,82 %) | (8,25 %) |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (SGD Hedged) | (12,89 %) | 2,38 %[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, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018) | (13,68 %) | 1,41 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 19. Jul. 2019) | (13,69 %) | (1,35 %) |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 04. Mai 2021) | (13,88 %) | (11,44 %) |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020) | (14,11 %) | (5,19 %) |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020) | (14,12 %) | (5,18 %) |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 20. Jun. 2019) | (13,46 %) | (0,53 %) |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged) | (12,83 %) | 1,16 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018) | (14,39 %) | (0,81 %) |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020) | (14,43 %) | (5,75 %) |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020) | (14,79 %) | (6,58 %) |
| Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020) | (14,83 %) | (6,60 %) |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (CHF Hedged) | (13,71 %) | (1,03 %)[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018) | (14,40 %) | (0,51 %) |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020) | (14,44 %) | (5,55 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020) | (14,83 %) | (6,44 %) |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020) | (14,86 %) | (6,45 %) |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (EUR Hedged) | (13,72 %) | (0,73 %)[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018) | (14,02 %) | 0,32 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 1. Mai 2019) | (13,93 %) | (1,07 %) |
| Class E GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020) | (14,37 %) | (5,79 %) |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (GBP Hedged) | (13,18 %) | 0,19 %[2] |
| **Auf SEK lautende Klassen** | | |
| Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Nov. 2019) | (14,46 %) | (4,24 %) |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (SEK Hedged) | (13,55 %) | (3,73 %) |

[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 strebt eine maximale Gesamtrendite an, die mit Kapitalerhalt, einer umsichtigen Anlageverwaltung und nachhaltigen Anlagen vereinbar ist (durch die ausdrückliche Aufnahme von ökologischen, sozialen und Unternehmensführungsfaktoren in das Anlageverfahren, wie in der Ergänzung näher beschrieben). Der Fonds beabsichtigt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von Unternehmensanleihen mit Investment Grade (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt.

## Kommentare zum Fonds

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

» Das nicht vorhandene Engagement in russischen Schuldtiteln trug zur Wertentwicklung bei, da Wertpapiere russischer Unternehmen im Berichtszeitraum eine Underperformance verzeichneten.

» Die Titelauswahl im Bereich der Versorger trug zur Wertentwicklung bei, da übergewichtete Emittenten eine Outperformance verzeichneten.

» Das übergewichtete Engagement in Immobilieninvestmentgesellschaften schmälerte die Wertentwicklung, da der Sektor schlechter abschnitt als der Gesamtmarkt.

» Das übergewichtete Engagement im Bankensektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da sich der Sektor unterdurchschnittlich entwickelte.

» Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Automobilsektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da der Sektor insgesamt und ausgewählte übergewichtete Emittenten schlechter abschnitten als der Gesamtmarkt.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014) | (0,67 %) | 2,07 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 05. Okt. 2016) | (0,86 %) | 2,48 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014) | (1,17 %) | 1,16 % |
| Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged) | (0,43 %) | 2,12 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014) | (1,37 %) | 0,13 % |
| Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (CHF Hedged) | (1,16 %) | 0,13 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014) | (1,32 %) | 0,54 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Jan. 2017) | (1,31 %) | 0,85 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014) | (1,72 %) | (0,36 %) |
| Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (EUR Hedged) | (1,09 %) | 0,59 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2017) | (0,72 %) | 1,78 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Feb. 2014) | (0,73 %) | 1,39 % |
| Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (GBP Hedged) | (0,48 %) | 1,46 %[2] |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Das untergewichtete Engagement in den Nominalzinsen von deutschen Staatsanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die deutschen Nominalzinsen stiegen.

» Das untergewichtete Engagement in Nominalzinsen von US-Staatsanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Nominalzinsen in den USA stiegen.

» Das untergewichtete Engagement in den Nominalzinsen von italienischen Staatsanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die italienischen Nominalzinsen stiegen.

» Das übergewichtete Engagement in dänischen gedeckten Anleihen schmälerte die relative Wertentwicklung, da diese Wertpapiere eine Underperformance verzeichneten.

» Das übergewichtete Engagement in den Nominalzinsen von spanischen Staatsanleihen schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Nominalzinsen in Spanien stiegen.

» Das übergewichtete Engagement in italienischen Realzinsen für Staatsanleihen schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Realrenditen in Italien stiegen.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003) | (12,38 %) | 4,44 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005) | (12,39 %) | 4,10 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 04. Mrz. 2004) | (12,54 %) | 3,91 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 24. Feb. 2009) | (12,57 %) | 4,50 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2004) | (12,60 %) | 3,66 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | (12,82 %) | 3,33 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005) | (12,82 %) | 3,22 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 21. Mai 2004) | (12,47 %) | 4,25 % |
| Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (12,48 %) | 2,28 % |
| Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged Index | (12,31 %) | 4,27 %[2] |
| **Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)** | | |
| Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 01. Sep. 2017) | (16,94 %) | 0,51 % |
| Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond USD Unhedged Index | (16,98 %) | 0,45 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2008) | (13,02 %) | 2,43 % |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015) | (13,02 %) | 1,08 % |
| Investor CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 24. Feb. 2009) | (13,16 %) | 2,95 % |
| Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond CHF Hedged Index | (13,11 %) | 2,18 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003) | (12,95 %) | 3,55 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005) | (12,93 %) | 3,13 % |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Apr. 2004) | (13,09 %) | 3,08 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | (13,32 %) | 2,40 % |
| Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond EUR Hedged Index | (13,09 %) | 3,33 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2004) | (12,51 %) | 4,49 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Apr. 2005) | (12,47 %) | 4,05 % |
| Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Jun. 2009) | (12,90 %) | 3,22 % |
| Class R GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (12,57 %) | 1,70 % |
| Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond GBP Hedged Index | (12,59 %) | 4,35 %[2] |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Feb. 2008) | (12,33 %) | 3,59 % |
| Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond SGD Hedged Index | (12,33 %) | 3,52 % |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Das untergewichtete Engagement in den Nominalzinsen von deutschen Staatsanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die deutschen Nominalzinsen stiegen.

» Das untergewichtete Engagement in den Realzinsen von britischen Staatsanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Realrenditen im Vereinigten Königreich stiegen.

» Das untergewichtete Engagement in Nominalzinsen von US-Staatsanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Nominalzinsen in den USA stiegen.

» Das übergewichtete Engagement in dänischen gedeckten Anleihen schmälerte die relative Wertentwicklung, da diese Wertpapiere eine Underperformance verzeichneten.

» Das übergewichtete Engagement in Nominalzinsen von britischen Staatsanleihen schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Nominalzinsen im Vereinigten Königreich stiegen.

» Das übergewichtete Engagement in Realzinsen von US-Staatsanleihen schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Realrenditen in den USA stiegen.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (10,07 %) | 4,58 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (10,07 %) | 4,59 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2015) | (10,27 %) | 3,04 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2013) | (10,33 %) | 3,30 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 13. Feb. 2017) | (10,28 %) | 1,94 % |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (10,30 %) | 4,07 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (10,53 %) | 3,65 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (10,50 %) | 3,65 % |
| Class E, ausschüttend Q (Auflegung: 30. Sep. 2019) | (10,55 %) | (0,70 %) |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2018) | (10,18 %) | 1,80 % |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018) | (10,20 %) | 1,80 % |
| Class R, thesaurierend (Auflegung 07. Nov. 2019) | (10,23 %) | (0,30 %) |
| Class R, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2015) | (10,28 %) | 2,90 % |
| Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (10,70 %) | 1,95 % |
| Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (10,73 %) | 1,94 % |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (9,87 %) | 5,14 % |
| Bloomberg U.S. Aggregate Index | (10,35 %) | 1,41 %[2] |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| Institutional AUD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Jan. 2018) | (10,60 %) | 0,82 % |
| Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jul. 2021) | (10,63 %) | (10,56 %) |
| Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018) | (10,71 %) | 0,80 % |
| Administrative AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 08. Jun. 2016) | (10,81 %) | 2,18 % |
| Class E AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Feb. 2017) | (10,96 %) | 0,98 % |
| Class Z AUD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 28. Okt. 2015) | (10,39 %) | 3,62 % |
| Bloomberg U.S. Aggregate (AUD Hedged) Index | (10,77 %) | 1,24 %[2] |
| **Auf BRL lautende Klassen** | | |
| Institutional BRL (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Feb. 2016) | 0,23 % | 4,06 % |
| Bloomberg Global Aggregate (BRL Hedged) Index | (4,27 %) | 7,02 % |
| **Auf CAD lautende Klassen** | | |
| Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Apr. 2016) | (10,23 %) | 2,87 % |
| Institutional CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Sep. 2018) | (10,21 %) | 1,60 % |
| Bloomberg U.S. Aggregate (CAD Hedged) Index | (10,42 %) | 0,62 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Dez. 2014) | (10,80 %) | 1,26 % |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015) | (10,79 %) | 0,95 % |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014) | (11,22 %) | 0,70 % |
| Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Feb. 2014) | (11,13 %) | 0,70 % |
| Bloomberg U.S. Aggregate (CHF Hedged) Index | (11,25 %) | (0,37 %)[2] |
| **Auf CNH lautende Klassen** | | |
| Institutional RMB (Hedged), thesaurierend (Auflegung 30. Jul. 2021) | (9,27 %) | (7,96 %) |
| Investor RMB (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jan. 2018) | (9,41 %) | 2,79 % |
| Class E RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung 22. Mai 2013) | (9,66 %) | 4,76 % |
| Bloomberg U.S. Aggregate (CNH Hedged) Index | (9,45 %) | 3,99 %[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 Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten. Der Fonds strebt hohe Dividendenerträge an, indem er in eine breite Palette von Rentenwertsektoren anlegt, die nach Ansicht der Anlageberatungsgesellschaft typischerweise Erträge auf erhöhtem Niveau einbringen.

## Kommentare zum Fonds

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

» Das Long-Engagement im russischen Rubel trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da dieser gegenüber dem US-Dollar zulegte.

» Das Short-Engagement in der britischen Duration trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da die Zinsen im Vereinigten Königreich stiegen.

» Das Short-Engagement in der japanischen Duration trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da die Zinsen in Japan stiegen.

» Das Long-Engagement in der US-Duration war der absoluten Wertentwicklung abträglich, da die US-Zinsen stiegen.

» Positionen in hochverzinslichen Unternehmensanleihen schmälerten die absolute Wertentwicklung, da sich die Spreads dieser Wertpapiere weiteten.

» Das Long-Engagement in ausgewählten Auslandsschulden von Schwellenländern belastete die absolute Wertentwicklung, da sich die Spreads dieser Wertpapiere weiteten.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1] (Forts.)

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (10,89 %) | 3,12 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (10,86 %) | 3,11 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 29. Jul. 2014) | (10,91 %) | 1,58 % |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Apr. 2015) | (11,08 %) | 0,90 % |
| Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Mai 2015) | (11,08 %) | 0,97 % |
| Investor EUR (Hedged), ausschüttend A (Auflegung: 16. Dez. 2015) | (11,00 %) | 1,11 % |
| Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Aug. 2015) | (11,06 %) | 0,88 % |
| Administrative EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 08. Jun. 2016) | (11,13 %) | 0,55 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (11,31 %) | 2,19 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (11,28 %) | 2,19 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 31. Aug. 2018) | (11,23 %) | (0,82 %) |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend II Q (Auflegung: 30. Sep. 2019) | (11,26 %) | (2,23 %) |
| G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Aug. 2017) | (11,31 %) | (1,24 %) |
| H Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Jun. 2017) | (11,03 %) | (0,32 %) |
| Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2016) | (11,01 %) | 1,23 % |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014) | (11,47 %) | 0,24 % |
| Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014) | (11,45 %) | 0,25 % |
| Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index | (11,23 %) | 0,03 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)** | | |
| G Retail EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Mrz. 2019) | (2,57 %) | 2,54 % |
| Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Unhedged) Index | (2,48 %) | 2,53 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Feb. 2019) | (10,36 %) | 0,35 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Feb. 2013) | (10,37 %) | 3,04 % |
| Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2020) | (10,50 %) | (2,13 %) |
| Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Sept. 2016) | (10,52 %) | 1,08 % |
| Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Mrz. 2017) | (10,76 %) | 0,20 % |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (10,51 %) | 3,60 % |
| Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index | (10,67 %) | 0,88 %[2] |
| **Auf HKD lautende Klassen** | | |
| Institutional HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015) | (9,57 %) | 3,44 % |
| Administrative HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 26. Apr. 2017) | (9,73 %) | 1,83 % |
| Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung 04. Feb. 2013) | (9,93 %) | 2,99 % |
| Bloomberg U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index | (9,77 %) | 1,64 %[2] |
| **Auf JPY lautende Klassen** | | |
| Institutional JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Sep. 2017) | (10,64 %) | (0,02 %) |
| Administrative JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jul. 2021) | (10,81 %) | (10,90 %) |
| Class E JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung 01. Sep. 2017) | (10,98 %) | (0,91 %) |
| Bloomberg U.S. Aggregate (JPY Hedged) Index | (11,21 %) | (1,13 %)[2] |
| **Auf NOK lautende Klassen** | | |
| Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Apr. 2017) | (10,34 %) | 1,15 % |
| Bloomberg U.S. Aggregate (NOK Hedged) Index | (10,54 %) | 0,23 % |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 14. Jul. 2020) | (10,17 %) | (0,56 %) |
| Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Dez. 2015) | (10,15 %) | 3,18 % |
| Investor SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 07. Feb. 2020) | (10,28 %) | (1,69 %) |
| Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018) | (10,34 %) | 1,25 % |
| Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (10,35 %) | 3,93 % |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Feb. 2013) | (10,51 %) | 2,71 % |
| Bloomberg U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index | (10,39 %) | 1,36 %[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.*

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2021) | (9,83 %) | (5,93 %) |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2021) | (9,71 %) | (5,85 %) |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2021) | (10,14 %) | (6,73 %) |
| Bloomberg U.S. Aggregate Index | (10,35 %) | (7,94 %) |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| Class E AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2021) | (10,67 %) | (7,25 %) |
| Bloomberg U.S. Aggregate (AUD Hedged) Index | (10,77 %) | (8,35 %) |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2021) | (10,93 %) | (8,06 %) |
| Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index | (11,23 %) | (8,93 %) |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2021) | (10,37 %) | (7,29 %) |
| Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index | (10,67 %) | (8,08 %) |
| **Auf HKD lautende Klassen** | | |
| Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2021) | (9,67 %) | (6,00 %) |
| Bloomberg U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index | (9,77 %) | (7,16 %) |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2021) | (10,23 %) | (6,74 %) |
| Bloomberg U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index | (10,39 %) | (7,90 %) |

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Income Fund II ist bestrebt, unter Anwendung einer umsichtigen Anlageverwaltung hohe laufende Erträge zu erzielen, wobei das sekundäre Ziel der langfristige Kapitalzuwachs ist. Der Fonds 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 (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

» Das Short-Engagement in der britischen Duration trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da die Zinsen im Vereinigten Königreich stiegen.

» Das Long-Engagement im russischen Rubel trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da dieser gegenüber dem US-Dollar zulegte.

» Das Short-Engagement in der europäischen Duration trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da die Zinsen in Europa stiegen.

» Das Long-Engagement in der US-Duration war der absoluten Wertentwicklung abträglich, da die US-Zinsen stiegen.

» Positionen in hochverzinslichen Unternehmensanleihen schmälerten die absolute Wertentwicklung, da sich die Spreads dieser Wertpapiere weiteten.

» Das Long-Engagement in ausgewählten Auslandsschulden von Schwellenländern belastete die absolute Wertentwicklung, da sich die Spreads dieser Wertpapiere weiteten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2013) | (2,81 %) | 1,41 % |
| Administrative, ausschüttend II (Auflegung: 22. Mrz. 2022) | — | (6,71 %) |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2013) | (3,32 %) | 0,20 % |
| 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (USD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index weighted (USD Hedged)[3] | (2,94 %) | 1,34 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Nov. 2021) | (1,31 %) | (1,70 %) |
| Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2013) | (1,82 %) | (0,32 %) |
| Class E EUR (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Apr. 2013) | (1,90 %) | (0,32 %) |
| 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (EUR Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (EUR Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index (EUR Hedged), 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (EUR Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index weighted (EUR Hedged)[3] | (0,65 %) | 1,16 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Mai 2014) | (0,25 %) | 2,11 % |
| 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (GBP Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (GBP Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index (GBP Hedged), 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (GBP Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index weighted (GPB Hedged)[3] | 0,41 % | 2,05 % |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Administrative SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 22. Feb. 2022) | — | (3,30 %) |
| 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (SGD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (SGD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index (SGD Hedged), 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (SGD Unhedged), 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index (SGD Hedged)[3] | — | (4,48 %) |

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 Inflation Multi-Asset 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; vom 01. April 2017 bis zum 12. April 2022 — 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % Bloomberg 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; seit dem 13. April 2022 — 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (USD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index weighted (USD Hedged).*

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Das untergewichtete Engagement in den Nominalzinsen von deutschen Staatsanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die deutschen Nominalzinsen stiegen.

» Das untergewichtete Engagement in Gold im Rohstoffsektor trug zur relativen Wertentwicklung bei, da der Goldpreis fiel.

» Das übergewichtete Engagement in italienischen Breakevens trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die italienischen Breakevens stiegen.

» Das übergewichtete Engagement in Realzinsen von US-Staatsanleihen schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Realrenditen in den USA stiegen.

» Das übergewichtete Engagement in dänischen gedeckten Anleihen schmälerte die relative Wertentwicklung, da diese Wertpapiere eine Underperformance verzeichneten.

» Das untergewichtete Engagement in brasilianischen Breakevens schmälerte die relative Wertentwicklung, da die brasilianischen Breakevens stiegen.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 05. Dez. 2002) | (4,03 %) | 2,34 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 05. Dez. 2002) | (4,02 %) | 2,34 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 13. Mai 2004) | (4,15 %) | 2,04 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 03. Jul. 2003) | (4,22 %) | 1,91 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 08. Sep. 2004) | (4,26 %) | 1,84 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2007) | (4,46 %) | 1,22 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005) | (4,41 %) | 1,52 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 04. Nov. 2009) | (4,06 %) | 1,34 % |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018) | (4,07 %) | 0,62 % |
| Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (4,17 %) | 0,57 % |
| ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index | (2,84 %) | 1,81 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jan. 2012) | (4,70 %) | (0,07 %) |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005) | (4,66 %) | 1,52 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jul. 2009) | (5,05 %) | (0,18 %) |
| ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index (EUR Hedged) | (3,52 %) | 0,91 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2017) | (4,08 %) | (0,22 %) |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mrz. 2010) | (4,01 %) | 1,03 % |
| ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index (GBP Hedged) | (2,91 %) | 0,54 %[2] |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Positionen in Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating waren abträglich, da sich die Spreads der Unternehmensanleihen weiteten.

» Positionen in hochverzinslichen Unternehmensanleihen waren abträglich, da sich die Spreads weiteten.

» Positionen in Agency-MBS waren abträglich, da die Anlageklasse negative Gesamterträge verzeichnete.

» Das Short-Engagement in der britischen Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die lokalen Zinssätze stiegen.

» Das Short-Engagement in der japanischen Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die lokalen Zinssätze stiegen.

» Ein untergewichtetes Durationsengagement in kurzen Fälligkeiten der US-Zinsstrukturkurve trug zur Wertentwicklung bei, da die US-Zinsen am vorderen Ende der Zinsstrukturkurve stiegen.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014) | (5,87 %) | 1,57 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Jun. 2021) | (5,85 %) | (6,86 %) |
| Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged) | (5,69 %) | 1,71 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014) | (6,51 %) | 0,07 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 03. Jun. 2021) | (6,51 %) | (7,68 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014) | (6,89 %) | (0,84 %) |
| Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (EUR Hedged) | (6,43 %) | 0,18 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014) | (5,93 %) | 0,91 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 03. Jun. 2021) | (5,96 %) | (6,82 %) |
| Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (GBP Hedged) | (5,85 %) | 1,05 %[2] |
| **Auf NOK lautende Klassen** | | |
| Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Jul. 2017) | (5,84 %) | 0,16 % |
| Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (NOK Hedged) | (5,70 %) | 0,66 % |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Die Makro-Strategien, insbesondere die Positionierung entlang der Zinsstrukturkurve in den USA, trugen zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.

» Die Titelauswahl im Versorgungssektor trug zur Wertentwicklung bei, da ausgewählte übergewichtete Emittenten eine Outperformance verzeichneten.

» Die Titelauswahl bei Auslandsschulden von Schwellenländern schmälerte die Wertentwicklung, da das Engagement in russischen Schuldtiteln aufgrund der Invasion der Ukraine und der anschließenden Ankündigung von Sanktionen eine Underperformance verzeichnete.

» Das übergewichtete Engagement im Glücksspielsektor, der vor dem Hintergrund der anhaltenden Lockdowns in China und einer langsamer als erwartet verlaufenden Erholung des Tourismus in Macau eine Underperformance verzeichnete, schmälerte die Wertentwicklung.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018) | (6,80 %) | 1,32 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018) | (6,71 %) | 1,36 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018) | (7,10 %) | 0,49 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 14. Sep. 2018) | (7,18 %) | 0,38 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung 03. Sep. 2020) | (6,84 %) | (1,05 %) |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Jan. 2022) | — | (6,40 %) |
| Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index | (3,13 %) | 1,19 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018) | (7,48 %) | (0,87 %) |
| Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (CHF Hedged) | (3,89 %) | (0,97 %) |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018) | (7,49 %) | (0,59 %) |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Nov. 2021) | (7,02 %) | (6,92 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018) | (7,83 %) | (1,45 %) |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018) | (7,89 %) | (1,46 %) |
| Class Z EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 03. Jun. 2020) | (7,32 %) | 0,00 % |
| Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (EUR Hedged) | (3,83 %) | (0,66 %)[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018) | (7,00 %) | 0,24 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018) | (6,88 %) | 0,26 % |
| Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (GBP Hedged) | (3,23 %) | 0,31 % |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 14. Okt. 2020) | (6,74 %) | (1,06 %) |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018) | (7,19 %) | 0,11 % |
| Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (SGD Hedged) | (3,08 %) | 0,96 %[2] |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Das Short-Engagement in der britischen Duration trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da die Zinsen im Vereinigten Königreich stiegen.

» Das Long-Engagement im russischen Rubel trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da dieser gegenüber dem US-Dollar zulegte.

» Das Short-Engagement in der japanischen Duration trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da die Zinsen in Japan stiegen.

» Positionen in hochverzinslichen Unternehmensanleihen schmälerten die absolute Wertentwicklung, da sich die Spreads dieser Wertpapiere weiteten.

» Das Long-Engagement in der US-Duration war der absoluten Wertentwicklung abträglich, da die US-Zinsen stiegen.

» Das Long-Engagement in ausgewählten Auslandsschulden von Schwellenländern belastete die absolute Wertentwicklung, da sich die Spreads dieser Wertpapiere weiteten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016) | (6,17 %) | 1,64 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 07. Mrz. 2019) | (6,19 %) | 0,21 % |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2021) | (6,04 %) | (6,70 %) |
| 1 Month USD LIBOR Index | 0,23 % | 1,05 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016) | (6,91 %) | (0,25 %) |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 04. Apr. 2018) | (6,89 %) | (1,08 %) |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jan. 2018) | (7,06 %) | (1,51 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Okt. 2017) | (7,22 %) | (1,92 %) |
| Euro Short-Term Rate (ESTER) Index[3] | (0,29 %) | (0,44 %)[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016) | (6,28 %) | 0,69 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2019) | (6,29 %) | (0,36 %) |
| ICE BofA SONIA Overnight Rate Index[4] | 0,32 % | 0,41 %[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 Low Duration Opportunities Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 30. Juni 2021: 1 Month Euribor Index; ab 01. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index.*

[4] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Low Duration Opportunities Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 30. Juni 2021: 1 Month GBP LIBOR Index; ab 01. Juli 2021: SONIA ICE BofA SONIA Overnight Rate Index.*

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Ein Long-Engagement bei ausgewählten Schwellenländerwährungen trug zur Wertentwicklung bei, da sie gegenüber dem US-Dollar an Wert gewannen.

» Ein Short-Engagement bei britischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da britische Zinsen stiegen.

» Ein Short-Engagement beim Euro trug zur Wertentwicklung bei, da der Euro gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

» Ein Long-Engagement bei US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen stiegen.

» Beteiligungen an Unternehmensanleihen mit Investment Grade waren der Performance abträglich, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere erweiterten.

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

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014) | 10,14 % | (1,51 %) |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014) | 10,19 % | (1,50 %) |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014) | 9,62 % | (2,69 %) |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 07. Jun. 2019) | 10,75 % | 3,86 % |
| Alerian MLP Index | 10,04 % | (4,75 %)[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014) | 9,36 % | (3,37 %) |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014) | 9,32 % | (3,34 %) |
| Alerian MLP Index EUR (Hedged) | 8,95 % | (6,31 %) |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014) | 10,04 % | (3,25 %) |
| Alerian MLP Index GBP (Hedged) | 9,49 % | (6,28 %) |

[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 Fonds angestrebte „Gesamtrendite“ Besteht aus Ertrag und Kapitalzuwachs. Der Fonds ist bestrebt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er unter normalen Umständen zwei Drittel seines Nettovermögens entweder direkt oder indirekt in ein Portfolio aus Aktien anlegt, die verbunden sind mit (i) börsengehandelten Partnerships, die auch als Master Limited Partnerships („MLPs“) bezeichnet werden, (ii) den General Partners, die Eigentümer oder Manager von MLPs sind, (iii) Spin-Offs (Unternehmen, die nach Beteiligungsverkäufen oder Umstrukturierungen von den MLPs oder General Partner ausgegliedert werden) von MLPs, (iv) Unternehmen, die aufgrund dessen, dass sie in derselben Industrie tätig sind oder mit MLPs konkurrieren, MLPs ähnlich sind, (v) andere juristische 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 Fonds kann in diese Instrumente entweder auf dem Sekundärmarkt oder während einer Neuemission anlegen.

## Kommentare zum Fonds

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

» Das Engagement in Aktien von Midstream-Energieunternehmen trug zur absoluten Rendite bei, da der Sektor positive Renditen verzeichnete.

» Die Titelauswahl und eine Übergewichtung des Verflüssigungssektors trugen zur relativen Rendite bei, da die Beteiligungen des Fonds den Sektor übertrafen und der Sektor besser abschnitt als der Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl und die Übergewichtung im anderen Sektor, darunter Explorations-, Produktions- und Raffinerieunternehmen, trugen zur relativen Rendite bei, da die Positionen des Fonds den Sektor übertrafen und der Sektor den Vergleichsindex übertraf.

» Das untergewichtete Engagement in Aktien von Midstream-Energieunternehmen belastete die relative Rendite, da der Sektor positive Renditen verzeichnete.

» Die Titelauswahl im Sektor für Erdgasbeförderung in Pipelines schmälerte die relative Wertentwicklung, da sich die Beteiligungen des Fonds schlechter abschnitten als der Sektor insgesamt.

» Die Titelauswahl im Gewinnungs- und Verarbeitungssektor war der relativen Rendite abträglich, da sich die Positionen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Sektor.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017) | (6,73 %) | 1,69 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017) | (6,69 %) | 1,70 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 12. Mai 2017) | (6,90 %) | 0,99 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017) | (6,86 %) | 1,35 % |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017) | (6,93 %) | 1,20 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017) | (7,21 %) | 0,78 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017) | (7,10 %) | 0,80 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Mai 2020) | (6,83 %) | 0,42 % |
| 3 Month USD LIBOR Index | 0,31 % | 1,34 %[2] |
| **Auf CAD lautende Klassen** | | |
| Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Jun. 2021) | (6,71 %) | (5,01 %) |
| 3 Month USD LIBOR (CAD Hedged) Index | 0,02 % | 0,05 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017) | (7,45 %) | (0,58 %) |
| Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2017) | (7,77 %) | (2,02 %) |
| 3 Month USD LIBOR (CHF Hedged) Index | (0,40 %) | (0,94 %)[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017) | (7,32 %) | (0,22 %) |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017) | (7,34 %) | (0,23 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Jan. 2017) | (7,75 %) | (1,11 %) |
| 3 Month USD LIBOR (EUR Hedged) Index | (0,22 %) | (0,56 %) |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017) | (6,74 %) | 0,69 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017) | (6,82 %) | 0,68 % |
| 3 Month USD LIBOR (GBP Hedged) Index | 0,33 % | 0,36 % |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017) | (7,08 %) | 0,43 % |
| 3 Month SGD LIBOR Index | 0,40 % | 1,03 % |

[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 (auf Bruttobasis) Einfluss auf die Wertentwicklung:

» Positionen in strukturierten Agency-MBS, insbesondere in Interest Only („IO“)-Papieren, trugen zur Wertentwicklung bei, da der Sektor positive Renditen erzielte.

» Das Engagement in US-Zinsen schmälerte die Wertentwicklung, da die Zinssätze stiegen.

» Agency-MBS-Relative-Value-Strategien schmälerten die Wertentwicklung, da der Sektor negative Renditen erzielte.

» Das Engagement in erstrangigen Non-Agency-RMBS schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads weiteten.

» Das Engagement in erstrangigen Non-Agency-CMBS (commercial mortgage-backed securities) schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads weiteten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Dez. 1998) | (22,55 %) | 6,76 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Nov. 2001) | (22,56 %) | 7,98 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 07. Jan. 1999) | (22,70 %) | 6,25 % |
| BE Retail, thesaurierend (Auflegung: 28. Apr. 2022) | — | (13,30 %) |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006) | (22,92 %) | 8,09 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jan. 2020) | (22,59 %) | 6,25 % |
| S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden) | (20,15 %) | 6,29 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2012) | (23,67 %) | 10,64 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 02. Aug. 2017) | (24,01 %) | 6,48 % |
| S&P (EUR Hedged) 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden) | (21,37 %) | 10,15 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 17. Jun. 2021) | (23,32 %) | (13,07 %) |
| S&P (GBP Hedged) 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden) | (20,86 %) | (10,17 %) |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 22. Apr. 2022) | — | (12,80 %) |
| S&P 500 (SGD Hedged) Index (Net Total Return) | — | (9,76 %) |

[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 Fonds eine gesellschaftseigene Portfoliomanagementstrategie an, die ein aktiv verwaltetes Portfolio festverzinslicher Wertpapiere (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit einem Engagement im S&P 500 Index verbindet. Der Fonds darf unbeschränkt in Aktien und Wertpapiere anlegen, die sich in Aktien wandeln lassen.

## Kommentare zum Fonds

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

» Das Engagement des Teilfonds in mit dem S&P 500 verbundenen Aktienindexderivaten wirkte sich negativ auf die absolute Rendite aus, da der S&P 500 eine Rendite von -20,15 % verbuchte.

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

» Positionen in abgesicherten israelischen 3-Monats-Schatzwechseln trugen zur Rendite bei, da Zinsen anfielen.

» Das Long-Engagement in US-Zinssätzen schmälerte die Renditen, da die Zinssätze stiegen.

» Positionen in Non-Agency-MBS schmälerten die Renditen, da der Wert dieser Anleihen sank.

» Positionen in Unternehmensanleihen mit Investment Grade waren der Rendite abträglich, da sich die Spreads weiteten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Mrz. 2019) | (22,98 %) | 10,50 % |
| S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden) | (20,15 %) | 10,60 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 05. Mai 2020) | (24,17 %) | 12,80 % |
| S&P (EUR Hedged) 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden) | (21,37 %) | 12,94 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 17. Jun. 2021) | (23,75 %) | (13,84 %) |
| S&P (GBP Hedged) 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden) | (20,86 %) | (10,17 %) |

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Das Engagement des Teilfonds in mit dem S&P 500 verbundenen Aktienindexderivaten wirkte sich negativ auf die absolute Rendite aus, da der S&P 500 eine Rendite von -20,15 % verbuchte.

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

» Das Short-Engagement in britischen Zinssätzen am langen Ende trug zur Wertentwicklung bei, da die britischen Zinsen am langen Ende stiegen.

» Das Long-Engagement in US-Zinssätzen schmälerte die Renditen, da die Zinssätze stiegen.

» Positionen in Non-Agency-MBS schmälerten die Renditen, da der Wert dieser Anleihen sank.

» Positionen in Unternehmensanleihen mit Investment Grade waren der Rendite abträglich, da sich die Spreads weiteten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Mrz. 2018) | (8,99 %) | 2,09 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013) | (9,41 %) | 3,11 % |
| Class E, ausschüttend II (Auflegung: 16. Dez. 2013) | (9,49 %) | 3,10 % |
| 75 % Bloomberg Global Aggregate USD Hedged/25 % MSCI World Value Index3 | (11,96 %) | 3,70 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013) | (9,20 %) | 2,78 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013) | (9,52 %) | 1,85 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 16. Dez. 2013) | (9,60 %) | 1,84 % |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014) | (9,76 %) | 0,57 % |
| Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014) | (9,70 %) | 0,59 % |
| 75 % Bloomberg Global Aggregate EUR Hedged/25 % MSCI World Value Index EUR Hedged[3] | (12,19 %) | 2,52 %[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 % Bloomberg Global Aggregate Index Hedged USD/25 % MSCI All Country World Index; ab dem 27. Juli 2016: 75 % Bloomberg Global Aggregate USD Hedged/25 % MSCI World Index.*

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

Rentenbereich:

» Das Short-Engagement in der britischen Duration trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da die Zinsen im Vereinigten Königreich stiegen.

» Das Short-Engagement in der japanischen Duration trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da die Zinsen in Japan stiegen.

» Das Long-Engagement im brasilianischen Real trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da dieser gegenüber dem US-Dollar zulegte.

» Das Long-Engagement in der US-Duration war der absoluten Wertentwicklung abträglich, da die US-Zinsen stiegen.

» Das Long-Engagement in ausgewählten Auslandsschulden von Schwellenländern belastete die absolute Wertentwicklung, da sich die Spreads dieser Wertpapiere weiteten.

» Positionen in hochverzinslichen Unternehmensanleihen schmälerten die absolute Wertentwicklung, da sich die Spreads dieser Wertpapiere weiteten.

Aktienbereich:

» Das übergewichtete Engagement im Energiesektor trug zur relativen Rendite bei, da der Sektor besser abschnitt als der Vergleichsindex.

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

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

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

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

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

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

» Es gab keine wesentlichen Verlustbringer für diesen Fonds.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 1998) | (12,59 %) | 4,57 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Apr. 2000) | (12,58 %) | 4,57 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 28. Jan. 1999) | (12,77 %) | 4,01 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 23. Okt. 2000) | (12,72 %) | 3,99 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2003) | (12,81 %) | 3,11 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | (12,99 %) | 2,89 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 10. Okt. 2005) | (13,03 %) | 2,79 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002) | (12,67 %) | 3,75 % |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018) | (12,69 %) | 0,73 % |
| Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (13,17 %) | 0,19 % |
| Bloomberg U.S. Aggregate Index | (10,35 %) | 4,14 %[2] |
| **Auf CAD lautende Klassen** | | |
| Institutional CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Mai 2013) | (12,72 %) | 1,09 % |
| Bloomberg U.S. Aggregate Index (CAD Hedged) | (10,42 %) | 1,32 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011) | (13,30 %) | 0,27 % |
| Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011) | (13,53 %) | (0,08 %) |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Sept. 2012) | (13,71 %) | (1,29 %) |
| Bloomberg U.S. Aggregate (CHF Hedged) Index | (11,25 %) | 0,30 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Dez. 2003) | (13,31 %) | 2,82 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005) | (13,37 %) | 2,76 % |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Dez. 2004) | (13,44 %) | 2,34 % |
| Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2009) | (13,53 %) | 1,02 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | (13,70 %) | 1,95 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Mrz. 2012) | (13,68 %) | (0,45 %) |
| Class R EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (13,44 %) | (0,36 %) |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014) | (13,81 %) | (1,36 %) |
| Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index | (11,23 %) | 2,39 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)** | | |
| Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Jun. 2002) | (4,91 %) | 3,40 % |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Mär. 2021) | (5,35 %) | 0,60 % |
| Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Unhedged) Index | (2,48 %) | 3,06 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Mrz. 2010) | (12,89 %) | 1,97 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005) | (12,90 %) | 3,54 % |
| Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index | (10,67 %) | 3,15 %[2] |
| **Auf HKD lautende Klassen** | | |
| Class E HKD (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Feb. 2013) | (12,43 %) | 0,59 % |
| M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Feb. 2013) | (12,45 %) | 0,56 % |
| Bloomberg U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index | (9,77 %) | 1,66 % |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Jan. 2011) | (12,64 %) | 2,02 % |
| Class E SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2007) | (13,01 %) | 2,40 % |
| Bloomberg U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index | (10,39 %) | 2,92 %[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 Total Return Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt.

## Kommentare zum Fonds

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

» Das Short-Engagement in der britischen Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.

» Das Short-Engagement in der japanischen Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.

» Es gab keine sonstigen Faktoren, die einen wesentlichen Beitrag zu diesem Fonds leisteten.

» Die Titelauswahl bei Investment-Grade-Unternehmensanleihen, insbesondere eine Vorliebe für Finanztitel, schmälerte die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads weiteten.

» Das Long-Engagement in der italienischen Duration war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die Zinsen in Dänemark stiegen.

» Positionen in Hochzinsanleihen schmälerten die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads weiteten.

» Eine Übergewichtung der US-Duration in der ersten Hälfte des Berichtszeitraums schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen stiegen.

» Positionen in Non-Agency-MBS und anderen verbrieften Anlagen schmälerte die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads weiteten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 12,82 % | 3,84 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 12,29 % | 2,71 % |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung 15. Dez. 2021) | 13,67 % | 13,10 % |
| 3 Month USD LIBOR Index | 0,31 % | 1,17 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 12,40 % | 2,14 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 30. Jun. 2015) | 11,76 % | 1,03 % |
| 3 Month USD LIBOR (EUR Hedged) Index | (0,22 %) | (0,40 %) |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Short-Positionen in globalen Zinssätzen, insbesondere in Polen, Ungarn, Israel und Tschechien, trugen zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.

» Short-Positionen im japanischen Yen und britischen Pfund trugen zur Wertentwicklung bei, da die Kurse fielen.

» Short-Positionen im kanadischen Dollar, südafrikanischen Rand, kolumbianischen Peso, chilenischen Peso und mexikanischen Dollar waren der Wertentwicklung aufgrund von Kursumschwüngen abträglich.

» Die Positionierung in japanischen, schweizerischen, australischen und europäischen Aktien war der Wertentwicklung aufgrund von Kursumschwüngen abträglich.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2007) | (13,31 %) | 4,62 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 08. Jul. 2016) | (13,36 %) | 0,65 % |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 20. Nov. 2019) | (13,14 %) | (3,71 %) |
| ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index | (12,41 %) | 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 UK Corporate Bond Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Fonds legt mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von auf GBP lautenden festverzinslichen Instrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten an. Dabei handelt es sich um direkte Beteiligungen an festverzinslichen Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) oder derivativen Instrumenten, wie insbesondere Optionen, Futures, Swaps oder Credit Default Swaps.

## Kommentare zum Fonds

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

» Die Titelauswahl im Energiesektor trug zur Wertentwicklung bei, insbesondere das nicht vorhandene Engagement in einem russischen Emittenten, der eine Underperformance verzeichnete.

» Die Titelauswahl im Transportsektor trug zur Wertentwicklung bei, insbesondere das nicht vorhandene Engagement in einem russischen Emittenten, der eine Underperformance verzeichnete.

» Die Titelauswahl bei Immobilieninvestmentgesellschaften und im Immobiliensektor schmälerte die Wertentwicklung, da ausgewählte übergewichtete Emittenten eine Underperformance verzeichneten.

» Die Titelauswahl im diversifizierten Finanzdienstleistungssektor schmälerte die Wertentwicklung, da ausgewählte übergewichtete Emittenten eine Underperformance verzeichneten.

» Die Titelauswahl im Telekommunikationssektor belastete die Wertentwicklung, da ausgewählte untergewichtete Emittenten eine Outperformance verzeichneten.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005) | (21,26 %) | 4,74 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Aug. 2008) | (21,23 %) | 5,95 % |
| ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index[3] | (21,37 %) | 4,30 %[2] |

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

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Die Titelauswahl im Retaurantsektor trug zur Wertentwicklung bei, da ein ausgewählter untergewichteter Emittent eine Underperformance verzeichnete.

» Die Titelauswahl im Bankensektor trug zur Wertentwicklung bei, da ein ausgewählter übergewichteter Emittent eine Outperformance verzeichnete.

» Die Makro-Strategien, insbesondere die Positionierung auf der britischen Zinsstrukturkurve, trugen zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.

» Die Titelauswahl bei Immobilieninvestmentgesellschaften schmälerte die Wertentwicklung, da ausgewählte übergewichtete Emittenten eine Underperformance verzeichneten.

» Das untergewichtete Engagement im Transportsektor schmälerte die Wertentwicklung, da der Sektor besser abschnitt als die Benchmark.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Mai 1998) | (15,27 %) | 5,29 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Jan. 2001) | (15,21 %) | 5,59 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Mrz. 1999) | (15,43 %) | 4,92 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 14. Jan. 1999) | (15,44 %) | 4,90 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | (15,63 %) | 3,92 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006) | (15,64 %) | 3,99 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002) | (15,35 %) | 6,32 % |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2020) | (15,38 %) | (3,45 %) |
| M Retail, ausschüttend (Auflegung: 11. Jan. 2012) | (15,63 %) | 3,44 % |
| Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (15,33 %) | 3,34 % |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 29. Jun. 2016) | (15,04 %) | 3,69 % |
| ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index | (14,03 %) | 5,51 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Apr. 2020) | (15,90 %) | 1,64 % |
| ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (CHF Hedged)[3] | (14,88 %) | 3,46 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Apr. 2003) | (15,98 %) | 4,69 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005) | (16,02 %) | 3,87 % |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Feb. 2003) | (16,16 %) | 4,63 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | (16,36 %) | 2,88 % |
| ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (EUR Hedged)[3] | (14,96 %) | 5,41 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003) | (15,52 %) | 5,25 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jun. 2016) | (15,51 %) | 1,76 % |
| ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (GBP Hedged)[3] | (14,46 %) | 5,78 %[2] |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 22. Jul. 2021) | (15,25 %) | (14,40 %) |
| ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (SGD Hedged) | (14,12 %) | (12,96 %) |

[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 Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Gesamtnettovermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus hoch verzinslichen Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die von Moody's mit Baa oder von S&P niedriger als BBB bewertet werden oder von Fitch ein entsprechendes Rating erhalten haben.

## Kommentare zum Fonds

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

» Das untergewichtete Engagement im Einzelhandelssektor trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor schlechter abschnitt als der Gesamtmarkt.

» Das untergewichtete Engagement im Bankensektor trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor schlechter abschnitt als der Gesamtmarkt.

» Das übergewichtete Engagement im Glücksspiel- und Hotelsektor trug zur Wertentwicklung bei, da dieser Sektor den Gesamtmarkt übertraf.

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

» Die Titelauswahl im Sektor für unterstützende Dienstleistungen schmälerte die Wertentwicklung, da die Positionen des Fonds im Sektor für unterstützende Dienstleistungen schlechter abschnitten als der Gesamtmarkt.

» Die Titelauswahl im Glücksspiel- und Hotelsektor war der Wertentwicklung abträglich, da die Positionen des Fonds im Glücksspiel- und Hotelsektor schlechter abschnitten als der Markt insgesamt.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2016) | (15,54 %) | 1,19 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 15. Sep. 2016) | (15,53 %) | 1,19 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 07. Nov. 2019) | (15,88 %) | (4,31 %) |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 08. Mrz. 2019) | (15,84 %) | (1,00 %) |
| Bloomberg U.S. Credit Index | (13,81 %) | 1,34 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2016) | (16,21 %) | (0,86 %) |
| Bloomberg U.S. Credit Index (EUR Hedged) | (14,77 %) | (0,73 %) |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 15. Sep. 2016) | (15,86 %) | (0,01 %) |
| Bloomberg U.S. Credit Index (GBP Hedged) | (14,22 %) | 0,22 % |

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Das untergewichtete Engagement in der US-Dollar-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.

» Die Titelauswahl im Chemiesektor trug zur Wertentwicklung bei, da ein ausgewählter übergewichteter Emittent eine Outperformance verzeichnete.

» Die Titelauswahl in den Schwellenmärkten schmälerte die Wertentwicklung, insbesondere übergewichtete Engagements in zwei russischen Emittenten, die aufgrund der Invasion der Ukraine und der anschließenden Ankündigung von Sanktionen eine Underperformance verzeichneten.

» Das übergewichtete Engagement im Glücksspielsektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da der Sektor schlechter abschnitt als der Gesamtmarkt.

» Die Übergewichtung und die Titelauswahl bei Immobilieninvestmentgesellschaften schmälerte die Wertentwicklung, insbesondere das übergewichtete Engagement in einem europäischen Emittenten, der eine Underperformance verzeichnete.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014) | (1,32 %) | 1,44 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 11. Mrz. 2020) | (1,28 %) | 0,26 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014) | (1,45 %) | 1,08 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014) | (1,54 %) | 1,05 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018) | (1,44 %) | 0,81 % |
| Class Z, ausschüttend (Auflegung: 07. Aug. 2014) | (1,15 %) | 1,90 % |
| FTSE 3-Month U.S. Treasury Bill Index | 0,17 % | 0,76 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016) | (1,88 %) | (0,14 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 08. Jun. 2016) | (2,15 %) | (0,72 %) |
| ICE BofA Merrill Lynch 3-Month U.S. Treasury Bill Index (EUR Hedged) | (0,49 %) | (0,86 %)[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 Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Gesamtvermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten, die von Organisationen des öffentlichen und privaten Sektors in den USA und außerhalb der USA ausgegeben werden. Die durchschnittliche Duration des Portfolios dieses Fonds richtet sich nach den Zinsprognosen der Anlageberatungsgesellschaften. Es wird nicht davon ausgegangen, dass sie länger als ein Jahr ist. Der Fonds wird seine Wertentwicklung auf einen Vergleichszinssatz des FTSE 3-Month U.S. Treasury Bill Index beziehen. Bei dem FTSE 3-Month U.S. Treasury Bill Index handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der die monatliche Ertrags-Äquivalente der Renditedurchschnitte der Schatzwechselemissionen der vergangenen drei Monate repräsentiert.

## Kommentare zum Fonds

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

» Ein übergewichtetes Durationsengagement in kurzen Fälligkeiten der US-Zinsstrukturkurve schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen am vorderen Ende der Zinsstrukturkurve stiegen.

» Positionen in Agency-MBS waren abträglich, da die Anlageklasse negative Gesamterträge verzeichnete.

» Positionen in verbrieften Krediten waren abträglich, insbesondere, da besicherte Darlehensobligationen und CMBS negative Gesamtrenditen erbrachten.

» Es gab keine erwähnenswerte Beitragsleister für diesen Fonds.

## Beschreibungen der Vergleichsindizes

| Offizieller Name des Vergleichsindex | Beschreibung des Index |
|---|---|
| **1 Month NIBOR Rate Index** | Der 1 Month NIBOR (Norwegian Interbank Offered Rate) Index ist ein durchschnittlicher Zinssatz, der von der Norges Bank bestimmt wird. Er leitet sich vom Zinssatz eines vergleichbaren Darlehens am US-Dollarmarkt zuzüglich des Zinssatzdifferentials zwischen der norwegischen Krone und dem US-Dollar am Devisenterminmarkt ab. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **1 Month SEK LIBOR Index** | Der 1 Month SEK LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **1 Month USD LIBOR Index** | Der 1 Month USD LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **jeweils 1/3 Bloomberg 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 Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets (USD Hedged) bietet ein weites Vergleichsspektrum der globalen erstklassigen Rentenmärkte von Industrieländern. ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) bildet die Wertentwicklung von Anleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade der Emittenten von Industrieschuldverschreibungen nach, die ihren Firmensitz in Industrieländern haben, die über eine erstklassige Bewertung ausländischer langfristiger Währungsverbindlichkeiten verfügen (basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P sowie Fitch). Der Index beinhaltet auf US-Dollar, kanadische Dollar, Pfund Sterling und Euro (oder eine Euro-Vorgänger-Währung) lautende Anleihen, schließt jedoch alle auf mehrere Währungen lautenden Anleihen aus. Die Anleihen müssen über eine Bewertung unter Investment Grade, jedoch mindestens über eine Einstufung von B3 basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P, sowie Fitch verfügen. Qualifizierte Anleihen müssen kapitalisierungsgewichtet sein, wobei die 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 direkt anlegen. |
| **3 Month HIBOR Index** | Der 3 Month HIBOR (Hong Kong Interbank Offered Rate) Index ist ein Referenzzinssatz, der den durchschnittlichen Zinssatz abbildet, zu dem eine Reihe von Banken, die von der Hong Kong Association of Banks bestimmt wurden, bereit sind, sich untereinander unbesicherte Kredite zu verschiedenen Laufzeiten zu gewähren. |
| **3 Month SGD LIBOR Index** | Der 3 Month SGD LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel (3 Monate) auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **3 Month USD LIBOR Index** | Der 3 Month USD LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel (3 Monate) auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (USD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index weighted (USD Hedged)** | Der Vergleichsindex ist eine Mischung bestehend aus 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index (USD Hedged). Der Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs 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 JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus bildet Gesamtrenditen von auf lokale Währungen lautenden Geldmarktinstrumenten aus 24 Schwellenmarktländern nach. Der Bloomberg Commodity Total Return Index spiegelt die Rendite vollständig besicherter Positionen in den zugrundeliegenden Rohstoffterminkontrakten auf eine Reihe physischer Rohstoffe wider. 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 Bloomberg Gold Subindex Total Return Index spiegelt die Rendite vollständig besicherter Positionen in den zugrundeliegenden Rohstoffterminkontrakten wider. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht anlegen. |
| **50 % JPMorgan EMBI Global Index / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD) Unhedged** | Der Vergleichsindex ist eine Mischung bestehend aus 50 % JPMorgan EMBI Global Index/50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD Unhedged). Der JPMorgan EMBI Global Index bildet die absoluten Renditen der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden, darunter verbriefte Forderungen aus Umschuldungen, Darlehen und Eurobonds. Der JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD Unhedged) ist ein umfassender, internationaler lokaler Schwellenmarktindex, der aus regelmäßig gehandelten, liquiden, festverzinslichen, auf Inlandswährungen lautenden Staatsanleihen besteht, an denen sich ausländische Anleger beteiligen können. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |

| Offizieller Name des Vergleichsindex | Beschreibung des Index |
|---|---|
| **60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged)** | Der Vergleichsindex ist eine Mischung bestehend aus 60 % MSCI All Country World Index (ACWI) und 40 % Bloomberg Global Aggregate USD Hedged Index. 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 einer Gruppe von Länderindizes, die Indizes von Industrie- und Schwellenländern umfassen. Der Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Staatsanleihen und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **75 % Bloomberg Global Aggregate USD Hedged/25 % MSCI World Index** | Der Vergleichsindex ist eine Mischung bestehend aus 75 % Bloomberg Global Aggregate USD Hedged/25 % MSCI World Index. Der Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Staatsanleihen und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. Der MSCI World Index ist ein streubesitzbereinigter marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung der Aktienmärkte in Industrieländern messen soll. 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 direkt anlegen. |
| **Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index** | Der Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index repräsentiert die Euro Aggregate 1-10-Jahreskomponente des Bloomberg Pan-European Aggregate Index. Der Bloomberg Euro-Aggregate Index besteht aus Anleihen, die in Euro oder den Euro-Vorgängerwährungen der 17 eigenstaatlichen Länder ausgegeben wurden, die an der Europäischen Währungsunion (EWU) teilnehmen. Bei allen Emissionen muss es sich um festverzinsliche Wertpapiere der Kategorie Investment Grade mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr handeln. Der Euro-Aggregate Index schließt wandelbare Wertpapiere, variabel verzinsliche Wechsel, Annuitätswechsel, Optionsscheine, gebundene Anleihen und strukturierte Produkte aus. Deutsche Schuldscheine (Quasi-Darlehens-Papiere) sind aufgrund ihrer Handelsbeschränkungen und ihres nicht notierten Status, der zu Illiquidität führt, ebenfalls ausgeschlossen. Das Emissionsland zählt nicht zu den Indexkriterien, und Wertpapiere von Emittenten außerhalb der Eurozone sind inbegriffen, wenn sie die Indexkriterien erfüllen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **Bloomberg Euro Government (Deutschland, Frankreich, Niederlande) + 15 Jahre Index** | Der Bloomberg 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 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. |
| **Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index** | Der Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index ist die Anleihekomponente des Bloomberg Euro-Aggregate Index. Der Bloomberg Euro-Aggregate Index besteht aus Anleihen, die in Euro oder den Euro-Vorgängerwährungen der 17 eigenstaatlichen Länder ausgegeben wurden, die an der Europäischen Währungsunion (EWU) teilnehmen. Bei allen Emissionen muss es sich um festverzinsliche Wertpapiere der Kategorie Investment Grade mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr handeln. Der Euro-Aggregate Index schließt wandelbare Wertpapiere, variabel verzinsliche Wechsel, Annuitätswechsel, Optionsscheine, gebundene Anleihen und strukturierte Produkte aus. Deutsche Schuldscheine (Quasi-Darlehens-Papiere) sind aufgrund ihrer Handelsbeschränkungen und ihres nicht notierten Status, der zu Illiquidität führt, ebenfalls ausgeschlossen. Das Emissionsland zählt nicht zu den Indexkriterien, und Wertpapiere von Emittenten außerhalb der Eurozone sind inbegriffen, wenn sie die Indexkriterien erfüllen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index** | Der Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Staatsanleihen und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged)** | Bei dem Bloomberg 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. |

## Beschreibungen der Vergleichsindizes (Forts.)

| Offizieller Name des Vergleichsindex | Beschreibung des Index |
|---|---|
| **Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)** | Bei dem Bloomberg Global Aggregate Credit-Index (USD Hedged) handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der ein weites Vergleichsspektrum für die internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade bietet. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Dieser Index schließt Staatstitel und verbriefte Wertpapiere aus. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Wertpapiere und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index** | Der Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Der Index enthält auch Eurodollar- und Euro-Yen-Unternehmensanleihen, kanadische Staats-, Agency- und Unternehmenswertpapiere sowie auf USD lautende 144A-Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating. |
| **Bloomberg MSCI Green Bond Index (USD Hedged)** | Der Bloomberg MSCI Green Bond Index, USD Hedged bietet Anlegern ein objektives und robustes Maß für den globalen Markt für festverzinsliche Wertpapiere, die zur Finanzierung von Projekten mit direktem Umweltnutzen ausgegeben werden. Es wird eine unabhängige, analysegestützte Methodik verwendet, um indexfähige grüne Anleihen zu bewerten und sicherzustellen, dass sie die etablierten Green-Bond-Prinzipien einhalten, und um die Anleihen nach der umweltfreundlichen Verwendung ihrer Erlöse zu klassifizieren. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **Bloomberg U.S. Aggregate Index** | Der Bloomberg U.S. Aggregate Index bildet Wertpapiere ab, die bei der SEC registriert und steuerpflichtig sind sowie auf Dollar lauten. Der Index deckt den erstklassigen US-Festzinsanleihemarkt ab und beinhaltet Indexkomponenten für Staatstitel sowie Industrieschuldverschreibungen, Hypotheken-Durchlauf-Wertpapiere sowie forderungsbesicherte Wertpapiere. Diese Hauptsektoren unterteilen sich in spezifischere Indizes, die regelmäßig berechnet und veröffentlicht werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index** | Der Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index bildet Wertpapiere ab, die bei der SEC registriert und steuerpflichtig sind, auf US-Dollar lauten und eine Laufzeit zwischen ein und drei Jahren haben. Der Index deckt den erstklassigen US-Festzinsanleihemarkt ab und beinhaltet Indexkomponenten für Staatstitel sowie Industrieschuldverschreibungen, Hypotheken-Durchlauf-Wertpapiere sowie forderungsbesicherte Wertpapiere. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **Bloomberg U.S. Credit Index** | Bei dem Bloomberg U.S. Credit Index handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der aus öffentlich begebenen Schuldverschreibungen von Unternehmen und bestimmten nicht US-amerikanischen Emittenten sowie besicherten Anleihen besteht, die bestimmten Anforderungen in Bezug auf Laufzeit, Liquidität und Qualität entsprechen. Um für den Index in Frage zu kommen, müssen die Anleihen bei der SEC registriert sein. Dieser Index wurde zuvor als Bloomberg Credit Investment Grade Index bezeichnet. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond (USD Hedged) Index** | Der Bloomberg 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, das Vereinigte Königreich und die USA. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)** | Bei dem Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged) handelt es sich um einen Index, der die Wertentwicklung der weltweiten Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen mit einer Laufzeit von mindestens 1 Jahr und weniger als 5 Jahren misst. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **Bloomberg Commodity Index Total Return** | Der Bloomberg Commodity Index Total Return ist ein nicht verwalteter Index aus Terminkontrakten auf eine Reihe physischer Rohstoffe. Der Index wurde als hoch liquider und diversifizierter Vergleichsindex für Rohstoffe als Vermögensklasse geschaffen. Die Futures-Engagements der Benchmark sind durch US-Schatzwechsel besichert. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **Compounded SG Overnight Rate Avg SORA Index** | Der Singapore Overnight Rate Average (SORA) ist der volumengewichtete durchschnittliche Zinssatz für Kreditgeschäfte am unbesicherten SGD-Tagesgeldmarkt in Singapur. |
| **Gleichgewichtete Mischung von drei Indizes mit einer konstanten Duration von 0,25 Jahren, wie von PIMCO berechnet: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) and 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 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 Global Aggregate Credit ex Emerging Markets Index bietet ein breites Vergleichsspektrum der globalen erstklassigen Festzinsmärkte unter Ausschluss der Schwellenmärkte. Der ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD bildet die Wertentwicklung von Unternehmensanleihen aus Industrieländern nach, die ein Rating von BB1 bis B3 aufweisen, basierend auf dem Durchschnitt aus Moody's, S&P und Fitch. Qualifizierte Anleihen müssen kapitalisierungsgewichtet sein, wobei die Gesamtallokation für einen einzelnen Emittenten (vorgegeben durch Bloomberg Tickers) unter 2 % liegen muss. Emittenten mit einem Anteil über dem Schwellenwert werden auf 2 % reduziert, und der Nennwert jeder einzelnen ihrer Anleihen wird proportional angepasst. Ebenso erhöht sich der Nennwert von Anleihen aller sonstigen Emittenten unter der 2 %-Deckelung entsprechend proportional. Der Indexausgleich findet am letzten Kalendertag eines Monats statt. Der JPMorgan EMBI Global bildet die absoluten Renditen der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden, darunter 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. |

| Offizieller Name des Vergleichsindex | Beschreibung des Index |
|---|---|
| **Euro Short-Term Rate (ESTER) Index** | ESTER spiegelt die Kosten für unbesicherte Euro-Übernachtkredite von Banken im Euroraum wider. ESTER wird an jedem Tag veröffentlicht, an dem das Trans-European Automated Real-time Gross Settlement Express Transfer-Zahlungssystem (oder ein Nachfolgesystem) für die Abwicklung von Zahlungen in Euro geöffnet ist. ESTER beruht auf Transaktionen, die am vorangegangenen Geschäftstag (dem Stichtag „T“) mit einer Fälligkeit von T+1 durchgeführt und abgewickelt wurden und von denen angenommen wird, dass sie zu marktüblichen Bedingungen ausgeführt wurden, so dass sie die Marktzinsen unverzerrt widerspiegeln. |
| **FTSE 3-Month U.S. Treasury Bill Index** | Bei dem FTSE 3-Month U.S. Treasury Bill Index handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der die monatliche Ertrags-Äquivalente der Renditedurchschnitte der US-Schatzwechselemissionen der vergangenen drei Monate repräsentiert. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **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. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **ICE BofAML 3 Month USD LIBOR Index Hedged BRL Denominated in USD** | Der ICE BofAML 3 Month USD LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index Hedged BRL Denominated in USD ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel (3 Monate) auf dem Eurodollar-Markt des Vereinigten Königreichs berechnen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index** | Der Index ist so konzipiert, dass er die Wertentwicklung von auf EUR und GBP lautenden Unternehmensanleihen mit einem Rating unterhalb von Investment Grade abbildet, die auf den Eurobond-, GBP- oder EUR-Inlandsmärkten öffentlich begeben wurden. Um für eine Aufnahme in den Index in Frage zu kommen, müssen die Anleihen über eine Bewertung unter Investment Grade, jedoch mindestens über eine Einstufung von B3 basierend auf einem Durchschnitt aus Moody’s, S&P sowie Fitch verfügen. Das Engagement gegenüber einzelnen Emittenten im Index ist auf 3 % beschränkt. Nähere Einzelheiten zum Index, einschließlich einer aktuellen Beschreibung seiner Duration, sind auf Anfrage von der Anlageberatungsgesellschaft erhältlich. |
| **ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. 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. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **ICE BofA Merrill Lynch 3-Month U.S. Treasury Bill Index (EUR Hedged)** | Der ICE BofA Merrill Lynch 3-Month U.S. Treasury Bill Index (EUR Hedged) umfasst eine einzige Emission, die zu Monatsbeginn gekauft und für einen vollen Monat gehalten wird. Am Monatsende wird diese Emission verkauft und in eine neu ausgewählte Emission angelegt. Die bei der Neugewichtung am Monatsende jeweils gewählte Emission ist der ausstehende Schatzwechsel, dessen Fälligkeitstermin am nächsten am Datum der Neugewichtung liegt, wobei er jedoch nicht mehr als drei Monate nach diesem Datum liegen darf. Um für die Wahl berücksichtigt zu werden, muss eine Emission am oder vor dem Neugewichtungsdatum am Monatsende abgewickelt worden sein. Der Index hält zwar oft den im Rahmen der jüngsten 3-Monats-Auktion ausgegebenen Schatzwechsel, es kann jedoch auch ein älterer 6-Monats-Wechsel gewählt werden. |
| **ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD** | Der ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD bildet die Wertentwicklung von Anleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade der Emittenten von Industrieschuldverschreibungen nach, die ihren Firmensitz in Industrieländern haben, die über eine erstklassige Bewertung ausländischer langfristiger 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. |
| **ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index** | Der ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index besteht aus auf Pfund Sterling lautenden Anleihen der Kategorie Investment Grade; ausgenommen sind auf Sterling lautende, von der britischen Regierung begebene Anleihen. Alle im Index vertretenen Anleihen müssen von mindestens einer der großen Ratingagenturen als Anlagen von Investment-Grade eingestuft werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **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 des Vereinigten Königreichs ab. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index** | Der ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index bildet die Wertentwicklung von auf US-Dollar lautenden Unternehmensanleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade ab, die am US-Inlandsmarkt öffentlich emittiert werden. Um für eine Aufnahme in den Index in Frage zu kommen, müssen Wertpapiere über ein Rating unterhalb von Investment Grade (basierend auf dem Durchschnitt von Moody’s, S&P sowie Fitch) und ein Risikoland mit Investment Grade-Rating (basierend auf dem Durchschnitt von Moody’s, S&P sowie Fitch für auf Fremdwährung lautende Staatsanleihen mit langer Laufzeit) verfügen. |
| **ICE BofA SARON Overnight Rate Index** | Der ICE BofA SARON Overnight Rate Index bildet die Wertentwicklung eines synthetischen Vermögenswerts, der den SARON zahlt, zu einer angegebenen Fälligkeit nach. Der Index basiert auf dem angenommenen Kauf zum Nennwert eines synthetischen Instruments, das genau seine angegebene Laufzeit hat und einen Kupon aufweist, der dem Fixing-Kurs dieses Tages entspricht. Es wird davon ausgegangen, dass diese Emission am folgenden Geschäftstag verkauft wird (mit einer Rendite, die dem Fixing-Kurs des aktuellen Tages entspricht) und in ein neues Instrument übertragen wird. |

## Beschreibungen der Vergleichsindizes (Forts.)

| Offizieller Name des Vergleichsindex | Beschreibung des Index |
|---|---|
| **ICE BofA SONIA Overnight Rate Index** | Der ICE BofA SONIA Overnight Rate Index bildet die Wertentwicklung eines synthetischen Vermögenswerts, der den SONIA zahlt, zu einer angegebenen Fälligkeit nach. Der Index basiert auf dem angenommenen Kauf zum Nennwert eines synthetischen Instruments, das genau seine angegebene Laufzeit hat und einen Kupon aufweist, der dem Fixing-Kurs dieses Tages entspricht. Es wird davon ausgegangen, dass diese Emission am folgenden Geschäftstag verkauft wird (mit einer Rendite, die dem Fixing-Kurs des aktuellen Tages entspricht) und in ein neues Instrument übertragen wird. |
| **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 01. Dezember 2009 wurden die Indexrenditen von PIMCO abgesichert |
| **JPMorgan Asia Credit Index** | Der J.P. Morgan Asia Credit Index (JACI) misst die Wertentwicklung des asiatischen Marktes für auf USD lautende Anleihen ohne Japan. Der Index bietet einen Vergleichsindex für Anlagemöglichkeiten in fest und variabel verzinslichen, auf US-Dollar lautenden Festzinsinstrumenten von Staaten, quasi-staatlichen Stellen, Banken und Unternehmen in Asien ohne Japan. |
| **JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)** | Bei dem JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI) handelt es sich um eine besondere, gewichtete Version des CEMBI-Index. Er beschränkt den Anteil der Indexländer mit umfangreicheren Industrieschuldverschreibungen, indem er nur einen bestimmten Anteil des aktuell bankfähigen Nennwerts der Schulden dieser Länder einbezieht. Der CEMBI Diversified führt zu gut verteilten, ausgeglicheneren Gewichtungen für die im Index enthaltenen Länder. Die vom CEMBI Diversified abgedeckten Länder sind mit den vom CEMBI abgedeckten identisch. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)** | Der JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged) bildet die Gesamterträge für auf lokale Währungen lautende Geldmarktinstrumente in 22 Schwellenmarktländern mit mindestens 10 Milliarden USD Außenhandel nach. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **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. |
| **JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified** | Der J.P. Morgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified bildet die absoluten Renditen der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden, wobei Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren in die Indexkonstruktion einbezogen werden. |
| **JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged)** | Der JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged) ist ein umfassender, internationaler lokaler Schwellenmarktindex, der aus regelmäßig gehandelten, liquiden, festverzinslichen, auf Inlandswährungen lautenden Staatsanleihen besteht, an denen sich ausländische Anleger beteiligen können. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **JP Morgan JACI Non-Investment Grade** | Der JACI Non-IG umfasst festverzinsliche, auf US-Dollar lautende hochverzinsliche Anleihen, die von Staaten, quasi-staatlichen Stellen, Banken und Unternehmen in Asien begeben wurden. Der bestehende JACI Non-IG enthält sowohl fest- als auch variabel verzinsliche Anleihen, die von in Asien ansässigen Körperschaften begeben wurden und einen ausstehenden Nennbetrag von mindestens 150 Mio. USD sowie eine Restlaufzeit von mehr als einem Jahr aufweisen. |
| **PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close)** | Der PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close) ist ein diversifizierter globaler Index, der ein breites Spektrum von Gelegenheiten bei internationalen Rentenpapieren und Sektoren, von Industrieländern zu Schwellenmärkten, nominalem zu realem Vermögen, sowie von Barmitteln zu derivativen Instrumenten abdeckt. Abweichend von den herkömmlichen Indizes, die häufig aus Anleihen bestehen, die entsprechend ihrer Marktkapitalisierung gewertet werden, verwendet der GLADI eine BIP-Gewichtung, die sich auf schneller wachsende Gebiete der Welt konzentriert und so dem Index einen auf die Zukunft ausgerichteten Charakter verleiht. PIMCOs GLADI-Methode ist geistiges Eigentum, das durch das US-Patent Nr. 8.306.892 geschützt ist. GLOBAL ADVANTAGE und GLADI sind Markenzeichen von Pacific Investment Management Company LLC. |
| **Secured Overnight Financing Rate (SOFR)** | Der ICE BofA SOFR Overnight Rate Index bildet die Wertentwicklung eines synthetischen Vermögenswerts, der den SOFR zahlt, zu einer angegebenen Fälligkeit nach. Der Index basiert auf dem angenommenen Kauf zum Nennwert eines synthetischen Instruments, das genau seine angegebene Laufzeit hat und einen Kupon aufweist, der dem Fixing-Kurs dieses Tages entspricht. Es wird davon ausgegangen, dass diese Emission am folgenden Geschäftstag verkauft wird (mit einer Rendite, die dem Fixing-Kurs des aktuellen Tages entspricht) und in ein neues Instrument übertragen wird. |
| **S&P 500 Index** | Der S&P 500 ist ein nicht gemanagter Marktindex, der allgemein als repräsentativ für den Aktienmarkt insgesamt gilt. Der Index konzentriert sich auf das Large Cap-Segment des US-Aktienmarkts. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |

(Diese Seite wurde absichtlich freigelassen.)

## Finanzstatus

| (Angaben in Tausend) | PIMCO Asia High Yield Bond Fund | | Asia Strategic Interest Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 |
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | $ 2.550.223 | $ 2.901.911 | $ 273.493 | $ 321.481 |
| Investmentfonds | 170.237 | 330.471 | 30.639 | 33.109 |
| Pensionsgeschäfte | 79.920 | 178.712 | 3.514 | 837 |
| Finanzderivate | 31.079 | 21.279 | 3.041 | 2.359 |
| Zahlungsmittel | 0 | 1.077 | 117 | 406 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 61.152 | 29.134 | 4.648 | 1.928 |
| Forderungen aus Einkünften | 46.609 | 49.574 | 3.574 | 3.671 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 61.834 | 2.394 | 0 | 0 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 213.314 | 3.765 | 9 | 276 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 0 | 0 | 575 | 348 |
| Sonstige Aktiva | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Aktiva** | 3.214.368 | 3.518.317 | 319.610 | 364.415 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | (50.162) | (7.650) | (6.553) | (1.643) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (425) | (35.667) | 0 | (520) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (721) | (1.141) | (231) | (40) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (1.577) | (1.879) | (161) | (177) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (5.510) | (48.848) | (86) | (1.024) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (59) | (111) | 0 | 0 |
| Überziehungskredit | (118.680) | 0 | 0 | 0 |
| Zu zahlende Dividende | (123) | (441) | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | (4.277) | (1.505) | 0 | 0 |
| Einlagen von Kontrahenten | (1.708) | (9.152) | (5) | 0 |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (183.242) | (106.394) | (7.036) | (3.404) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ 3.031.126 | $ 3.411.923 | $ 312.574 | $ 361.011 |

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

| PIMCO Capital Securities Fund | | PIMCO Climate Bond Fund | | Commodity Real Return Fund | | PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 |
| $ 6.292.114 | $ 8.423.010 | $ 274.677 | $ 321.810 | $ 2.134.558 | $ 1.554.523 | $ 105.258 | $ 123.472 |
| 11.600 | 481.206 | 0 | 0 | 18 | 18 | 11.990 | 13.600 |
| 8.494 | 62.523 | 0 | 0 | 576 | 2.098 | 2.482 | 1.827 |
| 196.339 | 74.595 | 5.407 | 5.077 | 52.808 | 69.845 | 2.147 | 1.325 |
| 58.327 | 6.410 | 1.759 | 1.636 | 4.580 | 4.953 | 131 | 399 |
| 161.406 | 132.617 | 12.715 | 2.349 | 147.539 | 10.065 | 4.177 | 1.806 |
| 66.669 | 76.123 | 2.032 | 2.026 | 4.337 | 2.590 | 875 | 964 |
| 7.804 | 0 | 0 | 0 | 357 | 55 | 1.527 | 66 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 61.479 | 30.489 | 1.069 | 205 |
| 704 | 10.758 | 42 | 473 | 3.427 | 3.576 | 29 | 1 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 12.201 | 724 | 55 | 563 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 6.803.457 | 9.267.242 | 296.632 | 333.371 | 2.421.880 | 1.678.936 | 129.740 | 144.228 |
| (162.695) | (60.447) | (10.332) | (516) | (264.630) | (14.384) | (3.818) | (1.331) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | (17.037) | (6.148) | 0 | 0 | (495) | (1.541) | (2.056) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (124.175) | (52.442) | (3.324) | (409) |
| (5.884) | (3.567) | (2.404) | (38) | (17.186) | (812) | (7) | (600) |
| (4.994) | (7.145) | (133) | (159) | (1.952) | (1.257) | (105) | (124) |
| (560.583) | (23.339) | 0 | 0 | (22.374) | (22.915) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (168.337) | (80.800) | 0 | 0 |
| (248) | (798) | (18) | (11) | (26) | (19) | 0 | (4) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (900) | (1.313) | (157) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (28.576) | (18.973) | (3.265) | (1.086) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (88.516) | (24.214) | 0 | (3.480) | (10.975) | (61.630) | 0 | 0 |
| (852.396) | (156.833) | (22.457) | (5.290) | (609.655) | (234.754) | (8.795) | (4.524) |
| $ 5.951.061 | $ 9.110.409 | $ 274.175 | $ 328.081 | $ 1.812.225 | $ 1.444.182 | $ 120.945 | $ 139.704 |

## Finanzstatus (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Diversified Income Fund Zum 30. Juni 2022 | Diversified Income Fund Zum 31. Dez. 2021 | Diversified Income Duration Hedged Fund Zum 30. Juni 2022 | Diversified Income Duration Hedged Fund Zum 31. Dez. 2021 |
|---|---|---|---|---|
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | $ 7.621.324 | $ 14.274.019 | $ 611.183 | $ 1.093.527 |
| Investmentfonds | 1.010.428 | 1.614.943 | 80.990 | 126.929 |
| Pensionsgeschäfte | 945.104 | 157.316 | 80.873 | 58.930 |
| Finanzderivate | 170.449 | 185.600 | 45.483 | 40.225 |
| Zahlungsmittel | 20.949 | 66.783 | 2.904 | 5.706 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 554.422 | 386.400 | 59.103 | 46.115 |
| Forderungen aus Einkünften | 101.337 | 154.187 | 7.491 | 11.642 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 43.449 | 554 | 1.965 | 25 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 3.647 | 15.781 | 1 | 178 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 264.527 | 0 | 0 | 0 |
| Sonstige Aktiva | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Aktiva** | 10.735.636 | 16.855.583 | 889.993 | 1.383.277 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | (541.529) | (69.821) | (49.290) | (10.316) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (14.542) | (126.270) | 0 | (31.701) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (17.328) | (13.229) | (75) | (40) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (9.145) | (14.404) | (604) | (1.000) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (32.983) | (81.869) | (1.460) | (4.845) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (152) | (252) | (2) | (10) |
| Überziehungskredit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zu zahlende Dividende | (7.730) | (5.238) | (2.421) | (1.735) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | 0 | (13.641) | (20.925) | (15.275) |
| Einlagen von Kontrahenten | (42.225) | (83.126) | (5.063) | (12.990) |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (665.634) | (407.850) | (79.840) | (77.912) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ 10.070.002 | $ 16.447.733 | $ 810.153 | $ 1.305.365 |

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

| Dynamic Bond Fund | | Dynamic Multi-Asset Fund | | Emerging Local Bond Fund | | Emerging Markets Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 |
| $ 2.236.497 | $ 2.900.066 | € 5.196.196 | € 6.852.548 | $ 1.654.989 | $ 2.324.309 | $ 2.915.389 | $ 4.300.367 |
| 242.477 | 318.072 | 436.184 | 450.070 | 166.507 | 171.278 | 305.738 | 460.982 |
| 52.809 | 9.965 | 50.157 | 202.276 | 0 | 591 | 64.538 | 50.323 |
| 96.434 | 52.162 | 169.376 | 63.798 | 309.628 | 231.544 | 51.271 | 44.804 |
| 6.404 | 9.403 | 32.004 | 8.172 | 5.225 | 5.660 | 1.627 | 5.545 |
| 121.044 | 51.300 | 375.635 | 134.947 | 29.399 | 42.460 | 69.699 | 22.985 |
| 13.624 | 15.754 | 9.261 | 5.076 | 35.971 | 42.706 | 54.686 | 63.715 |
| 14.229 | 116 | 4.239 | 3.646 | 298.731 | 6.368 | 897 | 0 |
| 233.809 | 526.460 | 0 | 0 | 0 | 0 | 13.636 | 55.110 |
| 1.894 | 13.377 | 3.516 | 6.948 | 26.910 | 243 | 992 | 7.831 |
| 21.500 | 39.998 | 165.110 | 31.883 | 9.681 | 11.602 | 21.092 | 10.646 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 10 | 0 | 0 | 0 |
| 3.040.721 | 3.936.673 | 6.441.678 | 7.759.364 | 2.537.051 | 2.836.761 | 3.499.565 | 5.022.308 |
| (183.591) | (75.424) | (296.473) | (62.775) | (307.701) | (205.022) | (110.061) | (32.650) |
| (181.172) | (262.976) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | (13.658) | (1.866) | (15.149) | (347.930) | (56.769) | (20.813) | 0 |
| (220.688) | (272.055) | 0 | 0 | 0 | 0 | (38.730) | (82.661) |
| (1.359) | (1.936) | (7.574) | (10.657) | (6.221) | (605) | (2.739) | (4.978) |
| (1.962) | (2.657) | (6.323) | (8.203) | (1.441) | (1.725) | (2.500) | (3.579) |
| (521) | (4.539) | 0 | 0 | 0 | (374.743) | (107.634) | (166.230) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (41) | (203) | (34) | (44) | (278 ) | (129) | (15) | (20) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (732) | (1.313) | 0 | 0 | 0 | 0 | (334) | (491) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (14.827) | (23.915) | (47.680) | (26.586) | (20.597) | (46.639) | (2.602) | (16.955) |
| (604.893) | (658.676) | (359.950) | (123.414) | (684.168) | (685.632) | (285.428) | (307.564) |
| $ 2.435.828 | $ 3.277.997 | € 6.081.728 | € 7.635.950 | $ 1.852.883 | $ 2.151.129 | $ 3.214.137 | $ 4.714.744 |

## Finanzstatus (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Emerging Markets Bond ESG Fund | | Emerging Markets Corporate Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 |
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | $ 2.204.146 | $ 2.704.270 | $ 142.485 | $ 197.661 |
| Investmentfonds | 0 | 0 | 8.540 | 10.650 |
| Pensionsgeschäfte | 36.917 | 51.143 | 2.128 | 487 |
| Finanzderivate | 29.055 | 25.463 | 1.611 | 2.001 |
| Zahlungsmittel | 565 | 1.402 | 324 | 143 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 55.069 | 12.338 | 4.164 | 1.115 |
| Forderungen aus Einkünften | 36.262 | 36.117 | 2.068 | 2.304 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 2.732 | 4.033 | 0 | 0 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 2.514 | 6.793 | 0 | 0 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 1.877 | 4.975 | 0 | 64 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 0 | 0 | 293 | 563 |
| Sonstige Aktiva | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Aktiva** | 2.369.137 | 2.846.534 | 161.613 | 214.988 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | (67.628) | (14.555) | (4.889) | (756) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (16.761) | (2.662) | (1.541) | 0 |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (5.642) | (10.194) | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (869) | (1.632) | (34) | (20) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (1.682) | (2.040) | (167) | (228) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (73.892) | (167.203) | 0 | 0 |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (1) | (1) | 0 | 0 |
| Überziehungskredit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zu zahlende Dividende | (1.877) | (1.172) | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | (1.958) | (676) | 0 | 0 |
| Einlagen von Kontrahenten | (1.625) | (10.630) | (10) | (1.090) |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (171.935) | (210.765) | (6.641) | (2.094) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ 2.197.202 | $ 2.635.769 | $ 154.972 | $ 212.894 |

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

| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | | Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | | PIMCO ESG Income Fund | | Euro Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 |
| $ 179.294 | $ 265.258 | $ 21.951 | $ 25.575 | $ 145.034,00 | $ 122.326,00 | € 1.702.997 | € 2.354.423 |
| 26.781 | 15.188 | 2.546 | 2.833 | 0 | 0 | 199.876 | 167.438 |
| 60.041 | 688 | 297 | 193 | 16.600 | 0 | 129.970 | 24.716 |
| 36.414 | 20.931 | 4.759 | 2.859 | 3.805 | 1.702 | 62.385 | 20.616 |
| 1.773 | 1.439 | 189 | 122 | 1.685 | 1.265 | 1.401 | 13.039 |
| 11.907 | 5.253 | 580 | 302 | 6.956 | 2.030 | 50.987 | 28.439 |
| 1.774 | 2.910 | 154 | 280 | 1.013 | 720 | 8.751 | 10.706 |
| 11 | 0 | 25 | 0 | 102 | 0 | 21.454 | 41 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 906 | 37.229 | 3.821 |
| 20 | 80 | 61 | 10 | 59 | 141 | 3.073 | 629 |
| 0 | 1.119 | 0 | 0 | 0 | 0 | 57.440 | 25.994 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 318.015 | 312.866 | 30.562 | 32.174 | 175.254 | 129.090 | 2.275.563 | 2.649.862 |
| (41.447) | (16.321) | (3.757) | (2.339) | (7.654) | (432) | (93.857) | (53.814) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (204) | 0 | 0 |
| (2.110) | 0 | (28) | 0 | 0 | 0 | (16.959) | (9.696) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (14.834) | (1.202) | (89.909) | (5.728) |
| (2) | 0 | (7) | 0 | 0 | (1.453) | (1.411) | (1.665) |
| (119) | (233) | (29) | (36) | (80) | (66) | (830) | (1.121) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (558) | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (2) | (7) | (2) | (1) | (2) | (2) | (6) | (8) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (1) | (1) | 0 | 0 |
| (2.563) | 0 | (550) | (28) | (1.173) | (173) | 0 | 0 |
| (2.730) | (5.830) | (560) | (10) | (370) | (470) | (16.630) | (3.701) |
| (48.973) | (22.391) | (4.933) | (2.414) | (24.114) | (4.003) | (220.160) | (75.733) |
| $ 269.042 | $ 290.475 | $ 25.629 | $ 29.760 | $ 151.140 | $ 125.087 | € 2.055.403 | € 2.574.129 |

## Finanzstatus (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Euro Credit Fund Zum 30. Juni 2022 | Euro Credit Fund Zum 31. Dez. 2021 | Euro Income Bond Fund Zum 30. Juni 2022 | Euro Income Bond Fund Zum 31. Dez. 2021 |
|---|---|---|---|---|
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | € 700.842 | € 902.376 | € 1.296.270 | € 2.206.773 |
| Investmentfonds | 48.807 | 63.657 | 158.265 | 176.868 |
| Pensionsgeschäfte | 12.036 | 5.883 | 69.400 | 7.551 |
| Finanzderivate | 9.535 | 5.333 | 20.560 | 20.260 |
| Zahlungsmittel | 4.731 | 3.625 | 9.315 | 20.033 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 31.531 | 34.520 | 71.802 | 64.074 |
| Forderungen aus Einkünften | 4.661 | 7.125 | 12.110 | 20.309 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 14 | 12 | 20.558 | 63 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 1.634 | 106 | 163 | 1.051 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 19.198 | 3.868 | 4.835 | 0 |
| Sonstige Aktiva | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Aktiva** | 832.989 | 1.026.505 | 1.663.278 | 2.516.982 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | (27.655) | (6.300) | (45.905) | (3.673) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | 0 | 0 | 0 | (4.987) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (327) | (997) | (2.095) | (5.348) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (299) | (385) | (1.426) | (2.119) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | 0 | 0 | 0 | (3.195) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | 0 | 0 | (17) | (28) |
| Überziehungskredit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zu zahlende Dividende | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | 0 | 0 | 0 | (7.677) |
| Einlagen von Kontrahenten | (560) | (1.660) | (3.428) | (7.651) |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (28.841) | (9.342) | (52.871) | (34.678) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | € 804.148 | € 1.017.163 | € 1.610.407 | € 2.482.304 |

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

| Euro Long Average Duration Fund | | Euro Short-Term Fund | | PIMCO European High Yield Bond Fund | | PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 |
| € 108.305 | € 155.866 | € 493.666 | € 595.961 | € 120.861 | € 154.011 | € 229.504 | € 351.206 |
| 3.022 | 407 | 0 | 0 | 7.901 | 9.575 | 26.908 | 26.155 |
| 125 | 1.236 | 10.100 | 26.537 | 13.200 | 4.900 | 21.600 | 11.681 |
| 5.976 | 1.769 | 3.958 | 1.689 | 950 | 463 | 17.205 | 4.478 |
| 1.022 | 453 | 9 | 890 | 0 | 1.054 | 345 | 836 |
| 4.379 | 2.569 | 4.128 | 4.891 | 2.393 | 897 | 7.038 | 7.109 |
| 294 | 971 | 2.395 | 3.177 | 1.639 | 1.789 | 1.244 | 1.510 |
| 208 | 7 | 208 | 0 | 1.711 | 12 | 2.072 | 1.896 |
| 2.937 | 364 | 0 | 4.006 | 0 | 0 | 10.642 | 364 |
| 0 | 0 | 215 | 610 | 0 | 0 | 154 | 45 |
| 6.707 | 3.931 | 0 | 108 | 378 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 132.975 | 167.573 | 514.679 | 637.869 | 149.033 | 172.701 | 316.712 | 405.280 |
| (11.694) | (6.131) | (2.142) | (2.318) | (1.510) | (400) | (10.707) | (7.549) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | (111) | (1.054) | (706) | (2.187) | (1.789) | 0 | 0 |
| (5.907) | (546) | 0 | (4.004) | 0 | 0 | (21.467) | (546) |
| 0 | 0 | (194) | (809) | 0 | (18) | (988) | (186) |
| (43) | (64) | (131) | (170) | (2) | (3) | (82) | (120) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (329) | 0 | 0 | (611) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (1.019) | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (1.879) | 0 | 0 | (1) | (9.318) | (750) |
| (120) | (120) | (2.020) | (3) | (1) | (1) | (472) | (27) |
| (17.764) | (6.972) | (7.420) | (8.010) | (5.048) | (2.212) | (43.034) | (9.789) |
| € 115.211 | € 160.601 | € 507.259 | € 629.859 | € 143.985 | € 170.489 | € 273.678 | € 395.491 |

## Finanzstatus (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Global Advantage Fund Zum 30. Juni 2022 | Global Advantage Fund Zum 31. Dez. 2021 | Global Bond Fund Zum 30. Juni 2022 | Global Bond Fund Zum 31. Dez. 2021 |
|---|---|---|---|---|
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | $ 490.912 | $ 587.365 | $ 11.492.136 | $ 15.289.653 |
| Investmentfonds | 23.623 | 18.823 | 1.132.197 | 1.197.100 |
| Pensionsgeschäfte | 351 | 206 | 755.166 | 3.378 |
| Finanzderivate | 25.399 | 11.543 | 614.242 | 369.066 |
| Zahlungsmittel | 3.427 | 5.555 | 1.722 | 38.469 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 18.892 | 10.252 | 452.242 | 275.050 |
| Forderungen aus Einkünften | 2.680 | 2.915 | 54.418 | 83.537 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 8.658 | 8.317 | 277.036 | 269.817 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 142.197 | 209.240 | 3.159.364 | 4.531.716 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 0 | 19 | 5.737 | 6.862 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 4.908 | 1.216 | 294.458 | 22.127 |
| Sonstige Aktiva | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Aktiva** | 721.047 | 855.451 | 18.238.718 | 22.086.775 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | (31.209) | (10.288) | (873.568) | (368.266) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | (51.744) | (57.191) | (1.638.794) | (1.368.631) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (8.466) | (14.219) | (284.776) | (268.606) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (151.952) | (212.883) | (3.681.868) | (4.789.961) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | 0 | (32) | (11.207) | (17.323) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (259) | (316) | (5.641) | (7.214) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (27.662) | (35.450) | (239.565) | (1.166.988) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (7.356) | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (12) | (25) | (130) | (164) |
| Überziehungskredit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zu zahlende Dividende | 0 | 0 | (1.156) | (866) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Einlagen von Kontrahenten | (6.776) | (3.980) | (176.266) | (59.910) |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (285.436) | (334.384) | (6.912.971) | (8.047.929) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ 435.611 | $ 521.067 | $ 11.325.747 | $ 14.038.846 |

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

| Global Bond ESG Fund | | Global Bond Ex-US Fund | | PIMCO Global Core Asset Allocation Fund | | Global High Yield Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 |
| $ 2.240.146 | $ 2.374.485 | $ 770.957 | $ 1.081.382 | $ 557.043 | $ 575.784 | $ 3.207.768 | $ 4.683.221 |
| 5.707 | 6.595 | 44.341 | 6.361 | 256.489 | 388.149 | 227.289 | 417.716 |
| 188.985 | 38.254 | 494 | 1.246 | 36.319 | 511 | 108.343 | 0 |
| 121.703 | 56.798 | 53.003 | 13.807 | 38.743 | 29.674 | 43.744 | 38.557 |
| 3.288 | 8.538 | 2.911 | 7.191 | 11.449 | 13.516 | 59 | 1.537 |
| 71.745 | 34.338 | 29.818 | 20.245 | 56.234 | 61.007 | 66.293 | 21.314 |
| 8.382 | 10.524 | 5.021 | 6.445 | 3.342 | 1.629 | 50.822 | 60.659 |
| 26.379 | 25.414 | 18.591 | 15.507 | 1.376 | 810 | 54 | 56 |
| 602.776 | 542.093 | 294.514 | 399.574 | 294.697 | 113.928 | 0 | 0 |
| 1.571 | 1.726 | 2.603 | 31 | 91 | 340 | 8.683 | 9.087 |
| 41.404 | 4.857 | 11.437 | 7.205 | 10.349 | 0 | 6.044 | 5.436 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 175 |
| 3.312.086 | 3.103.622 | 1.233.690 | 1.558.994 | 1.266.132 | 1.185.348 | 3.719.099 | 5.237.758 |
| (170.295) | (39.219) | (47.157) | (22.778) | (54.377) | (9.866) | (91.673) | (14.484) |
| (244.739) | (197.580) | (136.470) | (150.627) | (46.169) | (84.769) | 0 | 0 |
| (25.921) | (33.767) | (17.378) | (24.164) | (31.379) | (5.707) | (4.825) | (44) |
| (673.559) | (504.380) | (246.582) | (334.379) | (337.243) | (29.309) | 0 | 0 |
| (502) | (764) | (156) | (4.342) | (409) | (323) | (21.029) | (4.927) |
| (895) | (972) | (321) | (443) | (775) | (1.027) | (2.187) | (3.102) |
| 0 | 0 | (30.799) | (99.506) | 0 | 0 | (56.344) | (15.872) |
| 0 | 0 | 0 | (8.467) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (3) | (5) | (7) | (11) | (2) | (3) | (127) | (139) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (349) | (291) | 0 | 0 | (43) | (58) | (6.296) | (7.729) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (12.600) | 0 | 0 |
| (17.949) | (23.678) | (21.182) | (2.570) | (16.443) | (6.665) | (12.208) | (22.301) |
| (1.134.212) | (800.656) | (500.052) | (647.287) | (486.840) | (150.327) | (194.689) | (68.598) |
| $ 2.177.874 | $ 2.302.966 | $ 733.638 | $ 911.707 | $ 779.292 | $ 1.035.021 | $ 3.524.410 | $ 5.169.160 |

## Finanzstatus (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Global Investment Grade Credit Fund | | Global Investment Grade Credit ESG Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 |
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | $ 10.566.768 | $ 16.283.191 | $ 1.451.233 | $ 1.166.597 |
| Investmentfonds | 765.784 | 1.100.873 | 0 | 0 |
| Pensionsgeschäfte | 476 | 4.429 | 35.785 | 962 |
| Finanzderivate | 237.499 | 191.914 | 27.947 | 14.075 |
| Zahlungsmittel | 42.272 | 50.691 | 3.075 | 2.463 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 400.060 | 279.019 | 46.501 | 9.154 |
| Forderungen aus Einkünften | 101.940 | 142.494 | 11.901 | 6.974 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 9.691 | 4.769 | 7.775 | 120 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 807.572 | 1.041.946 | 0 | 0 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 6.587 | 9.657 | 3.364 | 2.814 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 108.544 | 100.355 | 1.185 | 1.482 |
| Sonstige Aktiva | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Aktiva** | 13.047.193 | 19.209.338 | 1.588.766 | 1.204.641 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | (480.176) | (216.037) | (59.018) | (5.914) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | (178.944) | (224.962) | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | 0 | (9.522) | (8.286) | (1.129) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (1.304.664) | (1.475.711) | (14.355) | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (15.400) | (21.164) | (1.689) | (411) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (5.829) | (9.073) | (634) | (468) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (5.883) | (7.380) | (61.797) | 0 |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0 | 0 | (11.071) | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (298) | (553) | (117) | (80) |
| Überziehungskredit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zu zahlende Dividende | (10.208) | (16.246) | (890) | (806) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Einlagen von Kontrahenten | (28.484) | (73.765) | (4.413) | (6.270) |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (2.029.886) | (2.054.413) | (162.270) | (15.078) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ 11.017.307 | $ 17.154.925 | $ 1.426.496 | $ 1.189.563 |

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

| Global Low Duration Real Return Fund | | Global Real Return Fund | | Income Fund | | Income Fund II | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 |
| $ 1.180.749 | $ 1.420.625 | $ 3.569.598 | $ 4.811.615 | $ 59.973.073 | $ 76.792.728 | $ 30.252 | $ 26.514 |
| 166 | 12.363 | 65.301 | 192 | 2.258.877 | 2.811.875 | 3.103 | 2.701 |
| 577 | 1.138 | 1.506 | 5.680 | 5.903.711 | 6.365.633 | 2.600 | 0 |
| 45.842 | 28.567 | 169.169 | 70.667 | 3.968.555 | 1.770.198 | 555 | 138 |
| 5.595 | 6.245 | 6.285 | 15.002 | 135.326 | 91.434 | 314 | 507 |
| 29.521 | 12.451 | 68.508 | 36.615 | 3.272.599 | 1.796.692 | 730 | 155 |
| 2.092 | 2.483 | 7.731 | 6.926 | 329.542 | 384.924 | 202 | 155 |
| 148 | 68 | 4.531 | 402 | 59.999 | 65.747 | 4 | 1 |
| 18.361 | 13.920 | 57.317 | 60.107 | 11.274.408 | 17.819.516 | 4.609 | 3.539 |
| 3.066 | 7.839 | 4.683 | 12.767 | 28.735 | 223.885 | 126 | 0 |
| 0 | 1.281 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 48 | 49 |
| 1.286.117 | 1.506.980 | 3.954.629 | 5.019.973 | 87.204.825 | 108.122.632 | 42.543 | 33.759 |
| (51.606 ) | (20.118) | (148.217) | (53.145) | (3.888.006) | (725.980) | (593) | (87) |
| 0 | 0 | 0 | (311) | (1.246.878) | (484.196) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (768.303) | (3.521.764) | 0 | (204) |
| (40.540 ) | (27.180) | (137.951) | (116.048) | (23.064.538) | (28.452.770) | (9.551) | (5.616) |
| (1.286 ) | (94) | (2.586) | (3.514) | (50.589) | (98.350) | 0 | 0 |
| (586 ) | (633) | (1.601) | (2.039) | (44.037) | (56.822) | (22) | (15) |
| 0 | 0 | (788.563) | (772.701) | (7.867) | (73.072) | 0 | 0 |
| (196.067 ) | (250.806) | 0 | (335.849) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (2 ) | (2) | (61) | (77) | (3.870) | (4.993) | (50) | (50) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (1.957 ) | (590) | (8.192) | (2.837) | (2.350) | (2.008) | 0 | 0 |
| (3.177 ) | 0 | (16.379) | (4.981) | (1.147.561) | (789.779) | (250) | (17) |
| (8.668 ) | (8.481) | (54.016) | (25.092) | (123.659) | (333.172) | 0 | 0 |
| (303.889 ) | (307.904) | (1.157.566) | (1.316.594) | (30.347.658) | (34.542.906) | (10.466) | (5.989) |
| $ 982.228 | $ 1.199.076 | $ 2.797.063 | $ 3.703.379 | $ 56.857.167 | $ 73.579.726 | $ 32.077 | $ 27.770 |

## Finanzstatus (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Inflation Multi-Asset Fund[1] Zum 30. Juni 2022 | Inflation Multi-Asset Fund[1] Zum 31. Dez. 2021 | Low Average Duration Fund Zum 30. Juni 2022 | Low Average Duration Fund Zum 31. Dez. 2021 |
|---|---|---|---|---|
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | $ 317.884 | $ 142.619 | $ 1.245.701 | $ 1.057.626 |
| Investmentfonds | 84.526 | 20.447 | 149.849 | 113.421 |
| Pensionsgeschäfte | 88.803 | 500 | 203.483 | 24.177 |
| Finanzderivate | 10.808 | 4.126 | 15.850 | 2.332 |
| Zahlungsmittel | 1.897 | 958 | 3.309 | 2.927 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 20.680 | 2.360 | 27.499 | 8.182 |
| Forderungen aus Einkünften | 481 | 236 | 5.083 | 2.367 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 13 | 779 | 732 | 23 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 26.086 | 8.837 | 218.140 | 193.244 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 2.278 | 1.262 | 2.248 | 602 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 2.806 | 1.707 | 9.330 | 4.218 |
| Sonstige Aktiva | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Aktiva** | 556.262 | 183.831 | 1.881.224 | 1.409.119 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | (30.668) | (3.745) | (19.552) | (5.784) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | 0 | 0 | (91.115) | (38.058) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (52.676) | (284) | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | 0 | (13.222) | (185.559) | (183.803) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (975) | (99) | (667) | (477) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (498) | (176) | (718) | (527) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (4) | 0 | (12) | (13) |
| Überziehungskredit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zu zahlende Dividende | 0 | 0 | (18) | (7) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Einlagen von Kontrahenten | (260) | (1.960) | (7.147) | (1.312) |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (85.081) | (19.486) | (304.788) | (229.981) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ 471.181 | $ 164.345 | $ 1.576.436 | $ 1.179.138 |

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

(1) Der Inflation Strategy Fund wurde am 13. April 2022 in Inflation Multi-Asset Fund umbenannt.

(2) Der Global LIBOR Plus Bond Fund wurde am 1. Juli 2022 in Low Duration Opportunities Fund umbenannt.

| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | | Low Duration Income Fund | | Low Duration Opportunities Fund[2] | | PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 |
| $ 667.528 | $ 734.742 | $ 1.217.327 | $ 1.446.972 | $ 2.538.264 | $ 2.786.796 | $ 107.587 | $ 91.234 |
| 25.307 | 78.479 | 74.088 | 132.416 | 299.739 | 312.142 | 12.237 | 9.531 |
| 683 | 892 | 4.712 | 7.961 | 284.260 | 72.663 | 1.991 | 0 |
| 10.557 | 8.643 | 49.084 | 23.761 | 99.625 | 71.141 | 547 | 602 |
| 997 | 1.433 | 4.753 | 5.269 | 3.591 | 6.686 | 338 | 128 |
| 23.741 | 9.961 | 67.401 | 28.872 | 166.420 | 29.781 | 9.140 | 0 |
| 4.026 | 4.266 | 6.911 | 7.379 | 13.712 | 13.094 | 115 | 62 |
| 2 | 3 | 3.951 | 766 | 9.824 | 60 | 0 | 2.074 |
| 35.232 | 71.010 | 275.524 | 252.242 | 216.856 | 507.359 | 0 | 0 |
| 257 | 443 | 284 | 3.175 | 193 | 3.583 | 195 | 400 |
| 5.079 | 2.906 | 0 | 0 | 48.758 | 23.070 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 274 | 274 |
| 773.409 | 912.778 | 1.704.035 | 1.908.813 | 3.681.242 | 3.826.375 | 132.424 | 104.305 |
| (26.508) | (5.547) | (70.722) | (12.736) | (230.132) | (49.450) | (9.174) | (207) |
| (13.837) | (15.770) | (701) | (213) | (171.362) | (253.414) | 0 | 0 |
| (8.596) | 0 | (635) | (14.668) | (1.185) | (3.929) | (1.826) | (2.114) |
| (45.216) | (76.434) | (568.411) | (501.622) | (224.785) | (261.219) | 0 | 0 |
| (237) | (621) | (18.554) | (176) | (236) | (491) | (213) | (23) |
| (295) | (350) | (550) | (661) | (1.242) | (1.274) | (122) | (83) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (859) | (1.088) | 0 | 0 |
| 0 | (2.682) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (25) | (26) | (4) | (4) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (44) | (65) | (291) | (370) | (1.870) | (1.545) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (10.677) | (288) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (140) | (4.440) | (2.949) | (10.578) | (28.246) | (36.701) | 0 | (1.340) |
| (94.873) | (105.909) | (673.515) | (541.338) | (659.921) | (609.115) | (11.335) | (3.767) |
| $ 678.536 | $ 806.869 | $ 1.030.520 | $ 1.367.475 | $ 3.021.321 | $ 3.217.260 | $ 121.089 | $ 100.538 |

## Finanzstatus (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Mortgage Opportunities Fund Zum 30. Juni 2022 | Mortgage Opportunities Fund Zum 31. Dez. 2021 | StocksPLUS™ Fund Zum 30. Juni 2022 | StocksPLUS™ Fund Zum 31. Dez. 2021 |
|---|---|---|---|---|
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | $ 2.941.565 | $ 2.954.598 | $ 1.288.357 | $ 2.342.626 |
| Investmentfonds | 3.316 | 93.049 | 154.918 | 342.388 |
| Pensionsgeschäfte | 1.042 | 2.125 | 116.062 | 1.471.512 |
| Finanzderivate | 81.872 | 52.801 | 54.276 | 110.152 |
| Zahlungsmittel | 1.846 | 2.246 | 721 | 1.676 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 59.402 | 31.320 | 135.145 | 119.116 |
| Forderungen aus Einkünften | 5.963 | 5.923 | 3.298 | 4.915 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 216.286 | 165 | 248 | 49.250 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 2.483.354 | 1.981.607 | 0 | 0 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 88 | 8.485 | 820 | 8.655 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 204 | 0 | 36.914 | 0 |
| Sonstige Aktiva | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Aktiva** | 5.794.938 | 5.132.319 | 1.790.759 | 4.450.290 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | (96.528) | (15.508) | (161.160) | (40.872) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | (778.335) | (640.730) | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (62.449) | (577) | 0 | (500.740) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (2.666.658) | (1.834.460) | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (3.260) | (87) | (886) | (10.062) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (992) | (942) | (947) | (1.891) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (543.461) | (363.919) | 0 | 0 |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (8) | (18) | (5) | (7) |
| Überziehungskredit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zu zahlende Dividende | (32) | (18) | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | 0 | (21.268) | 0 | (23.105) |
| Einlagen von Kontrahenten | (35.945) | (16.368) | (11.595) | (112.457) |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (4.187.668) | (2.893.895) | (174.593) | (689.134) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ 1.607.270 | $ 2.238.424 | $ 1.616.166 | $ 3.761.156 |

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

| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | | Strategic Income Fund | | Total Return Bond Fund | | PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 |
| $ 9.433 | $ 9.467 | $ 590.326 | $ 758.311 | $ 4.524.418 | $ 5.405.196 | $ 79.760 | $ 87.130 |
| 895 | 1.103 | 37.193 | 15.171 | 286.470 | 423.494 | 12.228 | 4.572 |
| 119 | 1.432 | 805 | 476 | 199.939 | 7.152 | 19.775 | 800 |
| 240 | 305 | 33.302 | 12.361 | 122.511 | 54.310 | 35.035 | 12.654 |
| 21 | 35 | 3.192 | 5.076 | 14.752 | 19.769 | 3.584 | 1.523 |
| 865 | 231 | 30.613 | 15.351 | 166.034 | 91.011 | 9.814 | 8.749 |
| 15 | 16 | 3.162 | 3.698 | 22.102 | 23.708 | 418 | 77 |
| 122 | 649 | 319 | 345 | 158 | 7 | 92 | 4 |
| 1.863 | 1.357 | 141.740 | 279.954 | 824.220 | 800.505 | 0 | 0 |
| 33 | 0 | 1.273 | 824 | 5.289 | 859 | 540 | 42 |
| 111 | 39 | 0 | 4.458 | 32.807 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 13.717 | 14.634 | 841.925 | 1.096.025 | 6.198.700 | 6.826.011 | 161.246 | 115.551 |
| (1.281) | (110) | (47.118) | (12.272) | (155.340) | (52.693) | (23.529) | (7.768) |
| (1.154) | (305) | (13.742) | (32.833) | (86.140) | 0 | 0 | 0 |
| (123) | 0 | (345) | (9.686) | (1) | (1) | 0 | (21) |
| (1.381) | (1.802) | (247.729) | (413.907) | (1.838.152) | (1.565.309) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (1.283) | (570) | (3.343) | (12.407) | (55) | 0 |
| (6) | (7) | (620) | (706) | (2.527) | (3.292) | (134) | (121) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (9.877) | (225.851) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | (1.841) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (10) | (12) | (184) | (205) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (266) | (241) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (1.379) | 0 | 0 | (16.432) | (11.474) | (5.102) |
| 0 | (800) | (855) | (4.270) | (38.450) | (4.682) | (2.362) | (750) |
| (3.945) | (3.024) | (313.081) | (476.097) | (2.134.280) | (1.881.113) | (37.554) | (13.762) |
| $ 9.772 | $ 11.610 | $ 528.844 | $ 619.928 | $ 4.064.420 | $ 4.944.898 | $ 123.692 | $ 101.789 |

## Finanzstatus (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | UK Corporate Bond Fund | | UK Long Term Corporate Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 |
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | £ 485.508 | £ 571.865 | £ 284.837 | £ 403.042 |
| Investmentfonds | 5.353 | 208 | 0 | 0 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 526 | 2.656 | 442 |
| Finanzderivate | 3.255 | 1.924 | 5.905 | 4.147 |
| Zahlungsmittel | 1.612 | 4.094 | 1.613 | 4.588 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 8.851 | 9.544 | 7.065 | 12.076 |
| Forderungen aus Einkünften | 4.887 | 5.804 | 3.978 | 4.416 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 35 | 333 | 22 | 43 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 692 | 1.701 | 0 | 0 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 3.994 | 2.540 | 1.428 | 0 |
| Sonstige Aktiva | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Aktiva** | 514.187 | 598.539 | 307.504 | 428.754 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | (6.537) | (2.838) | (6.769) | (1.533) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | 0 | (803) | 0 | (47) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (328) | (116) | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (164) | (198) | (127) | (168) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | 0 | (513) | (1.401) | (513) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | 0 | 0 | 0 | (1) |
| Überziehungskredit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zu zahlende Dividende | (2.100) | (1.718) | (351) | (332) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | 0 | 0 | 0 | (264) |
| Einlagen von Kontrahenten | 0 | (189) | 0 | (148) |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (9.129) | (6.375) | (8.648) | (3.006) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | £ 505.058 | £ 592.164 | £ 298.856 | £ 425.748 |

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

* Die Summe der Gesellschaft zum 31. Dezember 2021 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.

| US High Yield Bond Fund | | US Investment Grade Corporate Bond Fund | | US Short-Term Fund | | Summe der Gesellschaft* | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 |
| $ 2.319.778 | $ 3.607.920 | $ 375.944 | $ 881.526 | $ 2.658.357 | $ 2.807.383 | $ 157.007.286 | $ 208.816.756 |
| 133.840 | 255.818 | 33.805 | 6.571 | 250.778 | 269.578 | 7.949.199 | 10.683.404 |
| 13.578 | 1.473 | 1.034 | 686 | 3.866 | 1.571 | 9.652.506 | 8.915.653 |
| 5.505 | 9.373 | 7.126 | 13.601 | 22.643 | 4.662 | 7.249.359 | 3.900.473 |
| 429 | 291 | 891 | 2.568 | 84 | 2.849 | 417.650 | 477.055 |
| 21.373 | 12.192 | 19.156 | 16.731 | 26.063 | 19.585 | 7.192.593 | 4.042.726 |
| 42.586 | 53.960 | 3.703 | 7.911 | 12.241 | 8.627 | 1.133.320 | 1.382.643 |
| 3.365 | 1.958 | 219 | 5 | 1.077 | 997 | 1.137.140 | 468.689 |
| 0 | 0 | 16.299 | 25.425 | 0 | 0 | 21.260.753 | 29.486.811 |
| 1.738 | 1.806 | 55 | 41 | 113 | 383 | 343.629 | 373.677 |
| 2.023 | 2.079 | 1.772 | 2.575 | 0 | 9.832 | 1.219.839 | 338.656 |
| 0 | 137 | 0 | 0 | 0 | 0 | 332 | 635 |
| 2.544.215 | 3.947.007 | 460.004 | 957.640 | 2.975.222 | 3.125.467 | 214.563.606 | 268.887.178 |
| (23.202) | (1.240) | (17.584) | (5.861) | (12.515) | (16.054) | (9.165.015) | (2.398.130) |
| 0 | 0 | (2.170) | (3.780) | 0 | 0 | (4.883.466) | (3.816.550) |
| (3.248) | (12.576) | (3.698) | (998) | 0 | (531) | (1.719.024) | (4.750.126) |
| 0 | 0 | (28.332) | (34.064) | 0 | 0 | (35.999.033) | (41.265.351) |
| (10.926) | (1.122) | (78) | (58) | (2.288) | (3.131) | (216.481) | (233.829) |
| (1.465) | (2.175) | (182) | (384) | (773) | (770) | (110.414) | (146.545) |
| (30.480) | 0 | 0 | 0 | (157.405) | (215.091) | (2.768.234) | (3.878.191) |
| 0 | 0 | 0 | (26.510) | (304.593) | (237.755) | (687.424) | (944.710) |
| (172) | (204) | 0 | 0 | (5) | (7) | (6.014) | (4.687) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (119.745) | 0 |
| (47) | (84) | (220) | (325) | 0 | 0 | (51.481) | (48.748) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (9.475) | 0 | (1.275.365) | (934.871) |
| (165) | (5.820) | (270) | (7.560) | (8.483) | (1.930) | (872.878) | (1.122.642) |
| (69.705) | (23.221) | (52.534) | (79.540) | (495.537) | (475.269) | (57.874.574) | (59.544.380) |
| $ 2.474.510 | $ 3.923.786 | $ 407.470 | $ 878.100 | $ 2.479.685 | $ 2.650.198 | $ 156.689.032 | $ 209.342.798 |

## Betriebsergebnisrechnung

| (Angaben in Tausend) | PIMCO Asia High Yield Bond Fund | | Asia Strategic Interest Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Erträge** | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | $ 102.800 | $ 45.674 | $ 7.131 | $ 4.587 |
| Sonstige Erträge | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten | (172.495) | 3.529 | (13.972) | (127) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | (35.312) | 7.804 | (5.775) | 1.142 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | (103) | 112 | (144) | (20) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten | (629.811) | (36.785) | (40.925) | (1.969) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | (32.123) | (15.595) | (4.392) | (2.777) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | (118) | 19 | (7) | (48) |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | (767.162) | 4.758 | (58.084) | 788 |
| **Betriebskosten** | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (10.534) | (4.565) | (1.032) | (586) |
| Servicegebühr | (376) | (352) | 0 | 0 |
| Bestandspflegegebühr | (98) | (102) | 0 | 0 |
| Sonstige Aufwendungen | (2) | (8) | 0 | 0 |
| Gesamtaufwendungen | (11.010) | (5.027) | (1.032) | (586) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 8 | 9 | 2 | 2 |
| Betriebskosten, netto | (11.002) | (5.018) | (1.030) | (584) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | (778.164) | (260) | (59.114) | 204 |
| **Finanzierungskosten** | | | | |
| Zinsaufwendungen | (235) | (18) | 0 | 0 |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | (23.232) | (13.228) | (3.822) | (2.084) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | 77 | 1.068 | 31 | 487 |
| Summe Finanzierungskosten | (23.390) | (12.178) | (3.791) | (1.597) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | (801.554) | (12.438) | (62.905) | (1.393) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | 0 | (249) | (3) | (35) |
| Kapitalertragsteuer | 0 | 1 | 0 | 1 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | (801.554) | (12.686) | (62.908) | (1.427) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit** | $ (801.554) | $ (12.686) | $ (62.908) | $ (1.427) |

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Sämtliche Beträge stammen ausschließlich aus dem laufenden Geschäft.

| PIMCO Capital Securities Fund | | PIMCO Climate Bond Fund | | Commodity Real Return Fund | | PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 160.238 | $ 168.147 | $ 3.144 | $ 1.278 | $ 61.718 | $ 12.565 | $ 2.145 | $ 2.675 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 132 |
| (59.121) | 119.227 | (3.827) | (119) | (23.145) | 780 | (1.716) | 2.599 |
| 164.830 | 58.604 | 1.355 | 3.334 | 561.745 | 114.952 | (2.772) | 2.494 |
| (57.669) | (52.013) | 74 | 370 | (7.225) | (643) | (46) | (61) |
| (1.651.927) | (91.010) | (60.258) | (1.409) | (162.956) | (9.132) | (11.044) | (3.423) |
| 24.401 | 27.039 | (9.486) | (5.970) | (266.379) | (1.598) | (1.710) | (4.350) |
| 1.836 | 39.247 | 7 | (17) | (327) | 43 | (2) | 15 |
| (1.417.412) | 269.241 | (68.991) | (2.533) | 163.431 | 116.967 | (15.145) | 81 |
| (35.732) | (40.540) | (878) | (537) | (10.564) | (3.334) | (686) | (749) |
| (965) | (1.003) | (5) | 0 | (146) | (52) | 0 | 0 |
| (669) | (869) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (191) | (195) | (8) | 0 | (1) | 0 | 0 | 0 |
| (37.557) | (42.607) | (891) | (537) | (10.711) | (3.386) | (686) | (749) |
| 302 | 1.069 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1 | 1 |
| (37.255) | (41.538) | (891) | (537) | (10.711) | (3.386) | (685) | (748) |
| (1.454.667) | 227.703 | (69.882) | (3.070) | 152.720 | 113.581 | (15.830) | (667) |
| (1.484) | (1.475) | 0 | (10) | (151) | (40) | (149) | (54) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (42.121) | (37.414) | (1.074) | (287) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (2.130) | 1.118 | 76 | (99) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (45.735) | (37.771) | (998) | (396) | (151) | (40) | (149) | (54) |
| (1.500.402) | 189.932 | (70.880) | (3.466) | 152.569 | 113.541 | (15.979) | (721) |
| (315) | (759) | 3 | 0 | 1 | 0 | 6 | (1) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (1.500.717) | 189.173 | (70.877) | (3.466) | 152.570 | 113.541 | (15.973) | (722) |
| $ (1.500.717) | $ 189.173 | $ (70.877) | $ (3.466) | $ 152.570 | $ 113.541 | $ (15.973) | $ (722) |

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Diversified Income Fund | | Diversified Income Duration Hedged Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Erträge** | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | $ 231.966 | $ 286.530 | $ 18.087 | $ 24.851 |
| Sonstige Erträge | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten | (248.907) | 59.790 | (17.443) | 10.369 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | (538.653) | 246.964 | (9.888) | 71.327 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | (71.471) | (72.892) | (2.883) | (3.250) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten | (2.134.224) | (263.854) | (160.520) | (21.982) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | (487.131) | (373.043) | (33.646) | (44.798) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | (4.272) | 4.434 | (278) | 109 |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | (3.252.692) | (112.071) | (206.571) | 36.626 |
| **Betriebskosten** | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (67.929) | (98.701) | (4.479) | (6.820) |
| Servicegebühr | (291) | (347) | (17) | (24) |
| Bestandspflegegebühr | (540) | (730) | 0 | 0 |
| Sonstige Aufwendungen | (241) | (317) | (1) | 0 |
| Gesamtaufwendungen | (69.001) | (100.095) | (4.497) | (6.844) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 1.070 | 1.665 | 76 | 136 |
| Betriebskosten, netto | (67.931) | (98.430) | (4.421) | (6.708) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | (3.320.623) | (210.501) | (210.992) | 29.918 |
| **Finanzierungskosten** | | | | |
| Zinsaufwendungen | (65) | (73) | (9) | (8) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | (82.528) | (100.440) | (6.214) | (6.792) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | (4.287) | 631 | (228) | (52) |
| Summe Finanzierungskosten | (86.880) | (99.882) | (6.451) | (6.852) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | (3.407.503) | (310.383) | (217.443) | 23.066 |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | 209 | (77) | 16 | (4) |
| Kapitalertragsteuer | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | (3.407.294) | (310.460) | (217.427) | 23.062 |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit** | $ (3.407.294) | $ (310.460) | $ (217.427) | $ 23.062 |

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Sämtliche Beträge stammen ausschließlich aus dem laufenden Geschäft.

| Dynamic Bond Fund | | Dynamic Multi-Asset Fund | | Emerging Local Bond Fund | | Emerging Markets Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 39.672 | $ 47.516 | € 26.755 | € 23.272 | $ 56.141 | $ 80.289 | $ 102.966 | $ 123.773 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 4 |
| 3.920 | 36.309 | 52.910 | 269.469 | (103.116) | (45.520) | (136.347) | 6.964 |
| (106.614) | 90.559 | 87.867 | (71.633) | 38.937 | 54.898 | (113.944) | 14.801 |
| (4.667) | (3.018) | 19.831 | 20.306 | (8.902) | 7.724 | (3.818) | (3.045) |
| (286.244) | (66.453) | (753.300) | 12.437 | (227.906) | (120.316) | (749.330) | (141.930) |
| (60.781) | (82.895) | (125.561) | (83.963) | (23.421) | (84.992) | (70.546) | (97.346) |
| (655) | 173 | 897 | (17) | (1.854) | 18.706 | (69) | (13) |
| (415.369) | 22.191 | (690.601) | 169.871 | (270.121) | (89.211) | (971.088) | (96.792) |
| (13.868) | (16.589) | (42.520) | (43.532) | (9.592) | (13.834) | (17.626) | (23.256) |
| (105) | (112) | (19) | (15) | (59) | (54) | (17) | (21) |
| (97) | (123) | 0 | 0 | 0 | 0 | (79) | (89) |
| (1) | 0 | (209) | (195) | (1) | (2) | (2) | (3) |
| (14.071) | (16.824) | (42.748) | (43.742) | (9.652) | (13.890) | (17.724) | (23.369) |
| 231 | 234 | 621 | 631 | 0 | 36 | 0 | 0 |
| (13.840) | (16.590) | (42.127) | (43.111) | (9.652) | (13.854) | (17.724) | (23.369) |
| (429.209) | 5.601 | (732.728) | 126.760 | (279.773) | (103.065) | (988.812) | (120.161) |
| (28) | (55) | (647) | (2.316) | (3.419) | (4.278) | (482) | (501) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (3.803) | (4.719) | (3.860) | (4.590) | (5.728) | (11.100) | (27.780) | (30.550) |
| (684) | 174 | (107) | (164) | (8) | (105) | 254 | 2.129 |
| (4.515) | (4.600) | (4.614) | (7.070) | (9.155) | (15.483) | (28.008) | (28.922) |
| (433.724) | 1.001 | (737.342) | 119.690 | (288.928) | (118.548) | (1.016.820) | (149.083) |
| 11 | (7) | (6.884) | (2.362) | (523) | (963) | (59) | (615) |
| (11) | 0 | 0 | 0 | (154) | 468 | 0 | (502) |
| (433.724) | 994 | (744.226) | 117.328 | (289.605) | (119.043) | (1.016.879) | (150.200) |
| $ (433.724) | $ 994 | € (744.226) | € 117.328 | $ (289.605) | $ (119.043) | $ (1.016.879) | $ (150.200) |

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Emerging Markets Bond ESG Fund | | Emerging Markets Corporate Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Erträge** | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | $ 60.303 | $ 42.313 | $ 3.937 | $ 5.298 |
| Sonstige Erträge | 0 | 0 | 0 | 5 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten | (74.275) | 4.109 | (5.129) | (30.385) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | (105.036) | 7.710 | (7.168) | 2.477 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | (1.992) | (885) | (102) | (198) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten | (540.974) | (38.583) | (33.691) | 28.742 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | (49.893) | (51.470) | (4.540) | (10.266) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | (222) | (379) | (9) | (9) |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | (712.089) | (37.185) | (46.702) | (4.336) |
| **Betriebskosten** | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (10.984) | (8.449) | (1.131) | (1.541) |
| Servicegebühr | (3) | (4) | 0 | 0 |
| Bestandspflegegebühr | (4) | (3) | 0 | 0 |
| Sonstige Aufwendungen | (1) | (1) | 0 | 0 |
| Gesamtaufwendungen | (10.992) | (8.457) | (1.131) | (1.541) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Betriebskosten, netto | (10.992) | (8.457) | (1.131) | (1.541) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | (723.081) | (45.642) | (47.833) | (5.877) |
| **Finanzierungskosten** | | | | |
| Zinsaufwendungen | (114) | (307) | (2) | (4) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | (13.814) | (8.981) | 0 | 0 |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | 547 | 3.754 | 0 | 0 |
| Summe Finanzierungskosten | (13.381) | (5.534) | (2) | (4) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | (736.462) | (51.176) | (47.835) | (5.881) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | 13 | (175) | 2 | (4) |
| Kapitalertragsteuer | 0 | 0 | 0 | (23) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | (736.449) | (51.351) | (47.833) | (5.908) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit** | $ (736.449) | $ (51.351) | $ (47.833) | $ (5.908) |

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Sämtliche Beträge stammen ausschließlich aus dem laufenden Geschäft.

| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | | Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | | PIMCO ESG Income Fund | | Euro Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Berichtszeitraum vom 29. April 2021 bis 30. Juni 2021 | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 4.790 | $ 5.278 | $ 321 | $ 400 | $ 1.828 | $ 11 | € 15.324 | € 13.192 |
| 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (16.594) | 1.513 | (262) | (310) | (483) | 3 | (51.316) | 10.915 |
| 1.705 | 5.845 | (364) | 193 | 559 | 3 | (69.476) | (29.778) |
| 502 | 282 | (4) | 26 | (115) | 0 | 1.769 | 13.318 |
| (24.936) | (4.923) | (2.196) | (340) | (18.395) | (16) | (174.838) | (33.261) |
| (8.358) | (12.528) | 497 | (346) | (4.995) | (3) | 142 | (27.907) |
| (8) | 293 | (3) | 27 | 43 | (1) | (929) | (15.638) |
| (42.899) | (4.239) | (2.011) | (350) | (21.558) | (3) | (279.324) | (69.159) |
| (1.119) | (1.216) | (201) | (235) | (442) | (6) | (5.840) | (8.274) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (34) | (53) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (6) | (10) |
| 0 | (7) | 0 | 0 | 0 | 0 | (1) | (2) |
| (1.119) | (1.223) | (201) | (235) | (442) | (6) | (5.881) | (8.339) |
| 1 | 1 | 4 | 3 | 0 | 0 | 275 | 490 |
| (1.118) | (1.222) | (197) | (232) | (442) | (6) | (5.606) | (7.849) |
| (44.017) | (5.461) | (2.208) | (582) | (22.000) | (9) | (284.930) | (77.008) |
| (9) | (41) | (1) | (7) | 0 | 0 | (129) | (215) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (7) | 0 | 0 | 0 | (365) | (6) | (473) | (634) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (2) | 0 | (4) | (162) |
| (16) | (41) | (1) | (7) | (367) | (6) | (606) | (1.011) |
| (44.033) | (5.502) | (2.209) | (589) | (22.367) | (15) | (285.536) | (78.019) |
| (44) | (108) | (6) | (16) | (8) | 0 | 2 | 170 |
| 5 | (64) | (1) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (44.072) | (5.674) | (2.216) | (605) | (22.375) | (15) | (285.534) | (77.849) |
| $ (44.072) | $ (5.674) | $ (2.216) | $ (605) | $ (22.375) | $ (15) | € (285.534) | € (77.849) |

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Euro Credit Fund | | Euro Income Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Erträge** | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | € 6.146 | € 7.617 | € 22.950 | € 30.337 |
| Sonstige Erträge | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten | (10.937) | 1.127 | (35.223) | 20.234 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | (45.245) | (14.455) | (14.618) | 11.305 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | 2.065 | 1.333 | 7.059 | 14.210 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten | (76.085) | 1.009 | (207.195) | (1.217) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | (16.858) | (5.163) | (40.275) | (41.439) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | (104) | 1.606 | 175 | (16.922) |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | (141.018) | (6.926) | (267.127) | 16.508 |
| **Betriebskosten** | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (2.174) | (2.550) | (10.341) | (15.512) |
| Servicegebühr | 0 | 0 | (39) | (45) |
| Bestandspflegegebühr | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Sonstige Aufwendungen | (1) | (1) | (80) | (113) |
| Gesamtaufwendungen | (2.175) | (2.551) | (10.460) | (15.670) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 92 | 57 | 142 | 13 |
| Betriebskosten, netto | (2.083) | (2.494) | (10.318) | (15.657) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | (143.101) | (9.420) | (277.445) | 851 |
| **Finanzierungskosten** | | | | |
| Zinsaufwendungen | (74) | (27) | (120) | (56) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | (781) | (879) | (7.858) | (9.423) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | 11 | 55 | (544) | (103) |
| Summe Finanzierungskosten | (844) | (851) | (8.522) | (9.582) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | (143.945) | (10.271) | (285.967) | (8.731) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | 1 | (1) | 2 | 3 |
| Kapitalertragsteuer | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | (143.944) | (10.272) | (285.965) | (8.728) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit** | € (143.944) | € (10.272) | € (285.965) | € (8.728) |

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Sämtliche Beträge stammen ausschließlich aus dem laufenden Geschäft.

| Euro Long Average Duration Fund | | Euro Short-Term Fund | | PIMCO European High Yield Bond Fund | | PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| € 871 | € 736 | € 1.448 | € 1.201 | € 2.919 | € 2.821 | $ 2.451 | $ 1.781 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 3 |
| (3.560) | 815 | (1.234) | (2.145) | (1.032) | 2.223 | (6.872) | (478) |
| (12.896) | (3.968) | 4.763 | (884) | (1.939) | (605) | 9.870 | 2.722 |
| 32 | 565 | 996 | 785 | 179 | 68 | 565 | 882 |
| (24.392) | (10.855) | (17.953) | 6.557 | (23.505) | 554 | (25.579) | (2.607) |
| (1.445) | (1.797) | 2.434 | (4.286) | (513) | (521) | 9.133 | (2.514) |
| (36) | (773) | 62 | 207 | (23) | (1) | (182) | (1.473) |
| (41.426) | (15.277) | (9.484) | 1.435 | (23.914) | 4.539 | (10.614) | (1.684) |
| (312) | (400) | (851) | (1.485) | (25) | (15) | (645) | (715) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (312) | (400) | (851) | (1.485) | (25) | (15) | (645) | (715) |
| 4 | 8 | 0 | 0 | 15 | 18 | 49 | 63 |
| (308) | (392) | (851) | (1.485) | (10) | 3 | (596) | (652) |
| (41.734) | (15.669) | (10.335) | (50) | (23.924) | 4.542 | (11.210) | (2.336) |
| (8) | (6) | (52) | (103) | (26) | (28) | (30) | (28) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (8) | (6) | (52) | (103) | (26) | (28) | (30) | (28) |
| (41.742) | (15.675) | (10.387) | (153) | (23.950) | 4.514 | (11.240) | (2.364) |
| 0 | 0 | 0 | (1) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (41.742) | (15.675) | (10.387) | (154) | (23.950) | 4.514 | (11.240) | (2.364) |
| € (41.742) | € (15.675) | € (10.387) | € (154) | € (23.950) | € 4.514 | $ (11.240) | $ (2.364) |

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Global Advantage Fund | | Global Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Erträge** | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | $ 8.331 | $ 7.020 | $ 135.508 | $ 159.037 |
| Sonstige Erträge | 0 | 0 | 0 | 138 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten | (4.236) | 5.172 | (138.224) | 55.387 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | (8.952) | 6.643 | 70.835 | 48.141 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | (477) | 517 | (45.306) | (33.641) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten | (64.938) | (21.685) | (1.646.386) | (563.019) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | (7.107) | (14.224) | (259.223) | (138.555) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | 1.595 | 1.122 | 17.446 | 22.841 |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | (75.784) | (15.435) | (1.865.350) | (449.671) |
| **Betriebskosten** | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (1.725) | (1.853) | (39.175) | (49.997) |
| Servicegebühr | 0 | 0 | (718) | (1.010) |
| Bestandspflegegebühr | 0 | 0 | (56) | (55) |
| Sonstige Aufwendungen | 0 | 0 | (71) | (118) |
| Gesamtaufwendungen | (1.725) | (1.853) | (40.020) | (51.180) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 0 | 0 | 1.564 | 1.653 |
| Betriebskosten, netto | (1.725) | (1.853) | (38.456) | (49.527) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | (77.509) | (17.288) | (1.903.806) | (499.198) |
| **Finanzierungskosten** | | | | |
| Zinsaufwendungen | (51) | (23) | (640) | (604) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | (1.978) | (1.569) | (14.147) | (16.667) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | 0 | 0 | (326) | (247) |
| Summe Finanzierungskosten | (2.029) | (1.592) | (15.113) | (17.518) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | (79.538) | (18.880) | (1.918.919) | (516.716) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | (13) | (12) | (225) | 719 |
| Kapitalertragsteuer | 9 | 24 | (3) | 0 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | (79.542) | (18.868) | (1.919.147) | (515.997) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit** | $ (79.542) | $ (18.868) | $ (1.919.147) | $ (515.997) |

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Sämtliche Beträge stammen ausschließlich aus dem laufenden Geschäft.

| Global Bond ESG Fund | | Global Bond Ex-US Fund | | PIMCO Global Core Asset Allocation Fund | | Global High Yield Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 17.566 | $ 11.983 | $ 9.449 | $ 10.878 | $ 6.371 | $ 5.772 | $ 102.882 | $ 119.533 |
| 0 | 0 | 0 | 1 | 0 | 83 | 0 | 0 |
| (64.696) | 1.163 | (5.494) | 5.789 | (16.957) | (238) | (8.163) | 30.344 |
| (12.939) | 39.864 | 11.576 | (670) | (117.852) | 65.239 | (87.771) | 122.898 |
| (9.773) | (3.981) | (4.054) | (3.218) | (127) | (31) | (13.879) | (12.250) |
| (277.444) | (50.080) | (110.407) | (42.646) | (59.134) | 3.494 | (831.242) | (65.508) |
| (64.724) | (44.505) | 14.705 | 11.489 | (35.070) | (33.979) | (71.956) | (115.236) |
| (501) | 885 | 2.461 | 5.631 | (281) | 484 | (274) | (348) |
| (412.511) | (44.671) | (81.764) | (12.746) | (223.050) | 40.824 | (910.403) | 79.433 |
| (5.582) | (4.039) | (2.261) | (2.634) | (5.477) | (4.883) | (15.462) | (19.494) |
| (19) | (28) | (16) | (33) | (16) | (16) | (32) | (26) |
| (2) | (5) | (30) | (28) | 0 | 0 | (187) | (211) |
| (1) | (1) | 0 | 0 | 0 | 0 | (21) | (24) |
| (5.604) | (4.073) | (2.307) | (2.695) | (5.493) | (4.899) | (15.702) | (19.755) |
| 0 | 0 | 1 | 1 | 176 | 102 | 0 | 0 |
| (5.604) | (4.073) | (2.306) | (2.694) | (5.317) | (4.797) | (15.702) | (19.755) |
| (418.115) | (48.744) | (84.070) | (15.440) | (228.367) | 36.027 | (926.105) | 59.678 |
| (55) | (18) | (79) | (42) | (41) | (12) | (63) | (27) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (313) | (519) |
| (3.468) | (2.446) | (901) | (1.037) | (1.527) | (1.378) | (33.177) | (34.864) |
| 117 | 91 | (68) | 49 | (363) | 132 | 385 | 216 |
| (3.406) | (2.373) | (1.048) | (1.030) | (1.931) | (1.258) | (33.168) | (35.194) |
| (421.521) | (51.117) | (85.118) | (16.470) | (230.298) | 34.769 | (959.273) | 24.484 |
| (37) | 19 | (12) | 30 | (373) | 191 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 |
| (421.558) | (51.098) | (85.130) | (16.440) | (230.671) | 34.961 | (959.273) | 24.484 |
| $ (421.558) | $ (51.098) | $ (85.130) | $ (16.440) | $ (230.671) | $ 34.961 | $ (959.273) | $ 24.484 |

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Global Investment Grade Credit Fund | | Global Investment Grade Credit ESG Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Erträge** | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | $ 206.572 | $ 341.145 | $ 17.311 | $ 4.461 |
| Sonstige Erträge | 0 | 1.286 | 0 | 0 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten | (364.265) | 313.264 | (19.154) | 252 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | (436.718) | 289.660 | (23.201) | 6.199 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | (38.102) | (83.508) | (8.975) | (760) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten | (2.030.117) | (853.421) | (264.585) | (11.252) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | (223.463) | (470.920) | (39.232) | (10.636) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | (6.696) | 6.327 | (386) | (47) |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | (2.892.789) | (456.167) | (338.222) | (11.783) |
| **Betriebskosten** | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (42.302) | (73.848) | (3.579) | (1.264) |
| Servicegebühr | (1.376) | (2.939) | 0 | 0 |
| Bestandspflegegebühr | (785) | (1.598) | (722) | (141) |
| Sonstige Aufwendungen | (83) | (148) | (1) | (11) |
| Gesamtaufwendungen | (44.546) | (78.533) | (4.302) | (1.416) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 449 | 456 | 0 | 0 |
| Betriebskosten, netto | (44.097) | (78.077) | (4.302) | (1.416) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | (2.936.886) | (534.244) | (342.524) | (13.199) |
| **Finanzierungskosten** | | | | |
| Zinsaufwendungen | (1.584) | (558) | (116) | (10) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | (55.106) | (102.007) | (5.659) | (1.327) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | (3.834) | (9.501) | 826 | 288 |
| Summe Finanzierungskosten | (60.524) | (112.066) | (4.949) | (1.049) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | (2.997.410) | (646.310) | (347.473) | (14.248) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | (227) | (318) | (27) | (26) |
| Kapitalertragsteuer | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | (2.997.637) | (646.628) | (347.500) | (14.274) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit** | $ (2.997.637) | $ (646.628) | $ (347.500) | $ (14.274) |

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Sämtliche Beträge stammen ausschließlich aus dem laufenden Geschäft.

| Global Low Duration Real Return Fund | | Global Real Return Fund | | Income Fund | | Income Fund II | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Berichtszeitraum vom 29. Januar 2021 bis 30. Juni 2021 |
| $ 43.394 | $ 17.764 | $ 130.217 | $ 46.705 | $ 1.081.564 | $ 1.204.329 | $ 494 | $ 216 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1.104 | 0 | 0 |
| (18.461) | 10.394 | (82.178) | 41.584 | (1.327.161) | 149.327 | (332) | (2) |
| 19.213 | 16.616 | 154.697 | 7.256 | 388.804 | 1.548.693 | 126 | 29 |
| (3.491) | (1.702) | (16.457) | (4.620) | (63.921) | (106.384) | (4) | 3 |
| (110.034) | (23.594) | (791.364) | (121.195) | (7.982.341) | (956.195) | (3.661) | 43 |
| (14.347) | (20.105) | 2.983 | (11.581) | (885.815) | (1.267.092) | (38) | 99 |
| 201 | (65) | 95 | (153) | 9.998 | 46.030 | 5 | 0 |
| (83.525) | (692) | (602.007) | (42.004) | (8.778.872) | 619.812 | (3.410) | 388 |
| (3.656) | (2.635) | (10.799) | (9.223) | (296.445) | (327.323) | (130) | (60) |
| (11) | (7) | (248) | (213) | (8.044) | (9.265) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (167) | (150) | (15.404) | (15.721) | 0 | 0 |
| (1) | 0 | (2) | (1) | (1.892) | (2.239) | (1) | 0 |
| (3.668) | (2.642) | (11.216) | (9.587) | (321.785) | (354.548) | (131) | (60) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 504 | 512 | 0 | 0 |
| (3.668) | (2.642) | (11.216) | (9.587) | (321.281) | (354.036) | (131) | (60) |
| (87.193) | (3.334) | (613.223) | (51.591) | (9.100.153) | 265.776 | (3.541) | 328 |
| (481) | (117) | (2.042) | (317) | (1.638) | (5.404) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (4.566) | (1.875) | (21.808) | (7.941) | (690.822) | (675.984) | (187) | (5) |
| (33) | 216 | (33) | (532) | (2.945) | 4.510 | 4 | (1) |
| (5.080) | (1.776) | (23.883) | (8.790) | (695.405) | (676.878) | (183) | (6) |
| (92.273) | (5.110) | (637.106) | (60.381) | (9.795.558) | (411.102) | (3.724) | 322 |
| 0 | 0 | 8 | 15 | (1.468) | 4.713 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (1) | 0 | (122) | 0 | 0 | 0 |
| (92.273) | (5.110) | (637.099) | (60.366) | (9.797.148) | (406.389) | (3.724) | 322 |
| $ (92.273) | $ (5.110) | $ (637.099) | $ (60.366) | $ (9.797.148) | $ (406.389) | $ (3.724) | $ 322 |

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Inflation Multi-Asset Fund(1) | | Low Average Duration Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Erträge** | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | $ 7.876 | $ 1.399 | $ 10.329 | $ 5.792 |
| Sonstige Erträge | 0 | 1 | 0 | 1 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten | 1.543 | 826 | (22.364) | (1.849) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | 14.169 | 5.888 | 9.023 | 3.068 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | (1.098) | (17) | (1.331) | 903 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten | (39.135) | 270 | (62.880) | (7.932) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | (19.924) | (1.018) | 2.631 | (1.147) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | 34 | (7) | (70) | 27 |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | (36.535) | 7.342 | (64.662) | (1.137) |
| **Betriebskosten** | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (2.015) | (433) | (4.068) | (3.255) |
| Servicegebühr | 0 | 0 | (47) | (66) |
| Bestandspflegegebühr | (14) | 0 | (30) | (36) |
| Sonstige Aufwendungen | 0 | 0 | (1) | (1) |
| Gesamtaufwendungen | (2.029) | (433) | (4.146) | (3.358) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 0 | 0 | 84 | 85 |
| Betriebskosten, netto | (2.029) | (433) | (4.062) | (3.273) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | (38.564) | 6.909 | (68.724) | (4.410) |
| **Finanzierungskosten** | | | | |
| Zinsaufwendungen | (2) | (6) | (53) | (1) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | (359) | (22) | (384) | (202) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | 40 | 4 | 4 | (7) |
| Summe Finanzierungskosten | (321) | (24) | (433) | (210) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | (38.885) | 6.885 | (69.157) | (4.620) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | (122) | (74) | (35) | 0 |
| Kapitalertragsteuer | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | (39.007) | 6.811 | (69.192) | (4.620) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit** | $ (39.007) | $ 6.811 | $ (69.192) | $ (4.620) |

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Sämtliche Beträge stammen ausschließlich aus dem laufenden Geschäft.

(1) Der Inflation Strategy Fund wurde am 13. April 2022 in Inflation Multi-Asset Fund umbenannt.

(2) Der Global LIBOR Plus Bond Fund wurde am 1. Juli 2022 in Low Duration Opportunities Fund umbenannt.

| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | | Low Duration Income Fund | | Low Duration Opportunities Fund(2) | | PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 6.056 | $ 6.431 | $ 17.978 | $ 13.521 | $ 26.353 | $ 23.377 | $ 1.872 | $ 769 |
| 0 | 37 | 0 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (9.517) | 5.550 | (32.369) | 42 | (8.053) | (11.483) | 8.257 | 1.325 |
| (31.826) | 10.349 | (29.879) | 25.900 | (155.897) | 162.597 | 9.466 | 17.962 |
| (2.046) | (1.150) | 75 | 2.326 | (5.750) | (2.961) | (32) | (9) |
| (47.040) | (11.783) | (105.544) | (13.302) | (256.550) | (36.082) | (3.270) | 7.205 |
| (19.231) | (22.641) | (31.490) | (34.459) | (149.249) | (93.813) | (9.022) | 2.859 |
| (94) | 65 | (143) | 117 | (277) | 227 | (3) | (5) |
| (103.698) | (13.142) | (181.372) | (5.853) | (549.423) | 41.862 | 7.268 | 30.106 |
| (1.907) | (1.731) | (4.242) | (2.794) | (8.069) | (7.139) | (677) | (412) |
| 0 | 0 | (1) | 0 | (12) | (24) | 0 | (2) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (1) | (1) | (2) | (2) | 0 | 0 |
| (1.907) | (1.731) | (4.244) | (2.795) | (8.083) | (7.165) | (677) | (414) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 107 | 108 | 0 | 0 |
| (1.907) | (1.731) | (4.244) | (2.795) | (7.976) | (7.057) | (677) | (414) |
| (105.605) | (14.873) | (185.616) | (8.648) | (557.399) | 34.805 | 6.591 | 29.692 |
| (46) | (16) | (12) | (13) | (43) | (20) | (2) | (1) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (202) | 0 | (2.762) | (2.240) | (4.267) | (4.297) | (1.019) | (1.214) |
| 21 | 11 | (295) | 65 | (56) | 450 | (162) | (53) |
| (227) | (5) | (3.069) | (2.188) | (4.366) | (3.867) | (1.183) | (1.268) |
| (105.832) | (14.878) | (188.685) | (10.836) | (561.765) | 30.938 | 5.408 | 28.424 |
| 0 | 0 | (4) | (14) | (12) | (2) | (501) | (139) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (2) | 0 | 0 | 0 |
| (105.832) | (14.878) | (188.689) | (10.850) | (561.779) | 30.936 | 4.907 | 28.285 |
| $ (105.832) | $ (14.878) | $ (188.689) | $ (10.850) | $ (561.779) | $ 30.936 | $ 4.907 | $ 28.285 |

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Mortgage Opportunities Fund | | StocksPLUS™ Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Erträge** | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | $ 34.884 | $ 29.779 | $ 15.113 | $ 10.303 |
| Sonstige Erträge | 0 | 0 | 0 | 1 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten | (28.024) | (10.448) | (21.446) | 4.308 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | 1.021 | 26.993 | (405.427) | 514.734 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | (3.948) | (529) | (4.976) | (193) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten | (168.883) | (8.902) | (112.687) | (16.190) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | (53.916) | (15.679) | (176.311) | (71.518) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | 108 | 168 | (31) | 114 |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | (218.758) | 21.382 | (705.765) | 441.559 |
| **Betriebskosten** | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (5.633) | (6.432) | (8.247) | (9.435) |
| Servicegebühr | (70) | (117) | (25) | (33) |
| Bestandspflegegebühr | 0 | (1) | 0 | 0 |
| Sonstige Aufwendungen | (1) | (1) | (3) | (6) |
| Gesamtaufwendungen | (5.704) | (6.551) | (8.275) | (9.474) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Betriebskosten, netto | (5.704) | (6.551) | (8.275) | (9.474) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | (224.462) | 14.831 | (714.040) | 432.085 |
| **Finanzierungskosten** | | | | |
| Zinsaufwendungen | (765) | (22) | (26) | (81) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | (5.834) | (5.818) | (41) | 0 |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | 16 | 94 | (2) | 32 |
| Summe Finanzierungskosten | (6.583) | (5.746) | (69) | (49) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | (231.045) | 9.085 | (714.109) | 432.036 |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | 0 | 0 | 11 | 0 |
| Kapitalertragsteuer | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | (231.045) | 9.085 | (714.098) | 432.036 |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit** | $ (231.045) | $ 9.085 | $ (714.098) | $ 432.036 |

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Sämtliche Beträge stammen ausschließlich aus dem laufenden Geschäft.

| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | | Strategic Income Fund | | Total Return Bond Fund | | PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 60 | $ 46 | $ 12.792 | $ 18.219 | $ 49.726 | $ 61.603 | $ 326 | $ 103 |
| 0 | 0 | 0 | 142 | 0 | 3 | 0 | 2 |
| 48 | 42 | 687 | 41.846 | (191.151) | 8.198 | (3.031) | (11) |
| (1.276) | 712 | (26.297) | 12.063 | 45.966 | (18.769) | 11.123 | 4.457 |
| 0 | 12 | 71 | 57 | (13.223) | (5.284) | (581) | (248) |
| (491) | (98) | (69.048) | (10.028) | (569.169) | (164.099) | (1.506) | (9) |
| (1.236) | 638 | (13.662) | (32.438) | (31.153) | (18.460) | 6.647 | (3.707) |
| (1) | 0 | (54) | 757 | (293) | (294) | 291 | 36 |
| (2.896) | 1.352 | (95.511) | 30.618 | (709.297) | (137.102) | 13.269 | 623 |
| (37) | (32) | (4.005) | (5.382) | (16.840) | (23.351) | (711) | (485) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (682) | (1.128) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (351) | (461) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (55) | (58) | (21) | (35) | 0 | 0 |
| (37) | (32) | (4.060) | (5.440) | (17.894) | (24.975) | (711) | (485) |
| 1 | 1 | 0 | 0 | 512 | 575 | 4 | 4 |
| (36) | (31) | (4.060) | (5.440) | (17.382) | (24.400) | (707) | (481) |
| (2.932) | 1.321 | (99.571) | 25.178 | (726.679) | (161.502) | 12.562 | 142 |
| 0 | (1) | (144) | (90) | (522) | (19) | (31) | (16) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (2.798) | (2.849) | (7.363) | (7.237) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (22) | (38) | 6 | (148) | 0 | 0 |
| 0 | (1) | (2.964) | (2.977) | (7.879) | (7.404) | (31) | (16) |
| (2.932) | 1.320 | (102.535) | 22.201 | (734.558) | (168.906) | 12.531 | 126 |
| 0 | 0 | (557) | (945) | 3 | (44) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (2) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (2.932) | 1.320 | (103.094) | 21.256 | (734.555) | (168.950) | 12.531 | 126 |
| $ (2.932) | $ 1.320 | $ (103.094) | $ 21.256 | $ (734.555) | $ (168.950) | $ 12.531 | $ 126 |

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | UK Corporate Bond Fund | | UK Long Term Corporate Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Erträge** | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | £ 5.780 | £ 7.095 | £ 5.441 | £ 5.119 |
| Sonstige Erträge | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten | (6.552) | 8.302 | (13.229) | 6.666 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | (7.824) | 6.115 | (12.538) | 1.247 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | (76) | (890) | 39 | (521) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten | (65.594) | (34.806) | (69.491) | (24.327) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | (2.182) | (3.725) | (3.480) | (919) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | 33 | 56 | (18) | 156 |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | (76.415) | (17.853) | (93.276) | (12.579) |
| **Betriebskosten** | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (1.069) | (1.332) | (879) | (848) |
| Servicegebühr | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Bestandspflegegebühr | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Sonstige Aufwendungen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Gesamtaufwendungen | (1.069) | (1.332) | (879) | (848) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 2 | 67 | 0 | 3 |
| Betriebskosten, netto | (1.067) | (1.265) | (879) | (845) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | (77.482) | (19.118) | (94.155) | (13.424) |
| **Finanzierungskosten** | | | | |
| Zinsaufwendungen | (115) | (28) | (39) | (21) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | (3.974) | (3.782) | (700) | (682) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | 24 | (270) | (1) | (10) |
| Summe Finanzierungskosten | (4.065) | (4.080) | (740) | (713) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | (81.547) | (23.198) | (94.895) | (14.137) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | 6 | 12 | 0 | (2) |
| Kapitalertragsteuer | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | (81.541) | (23.186) | (94.895) | (14.139) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit** | £ (81.541) | £ (23.186) | £ (94.895) | £ (14.139) |

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Sämtliche Beträge stammen ausschließlich aus dem laufenden Geschäft.

* Die Summe der Gesellschaft für die Berichtszeiträume zum 30. Juni 2022 und zum 30. Juni 2021 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen Rechnung zu tragen. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen 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 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 89.165 | $ 99.900 | $ 11.166 | $ 17.261 | $ 20.765 | $ 16.020 | $ 3.018.223 | $ 3.182.457 |
| 0 | 51 | 0 | 18 | 0 | 1 | 0 | 3.017 |
| (14.111) | (614) | (54.490) | 6.487 | (32.581) | 11.962 | (3.410.275) | 1.220.849 |
| (48.533) | 32.665 | (27.266) | 31.188 | 32.774 | (4.846) | (873.460) | 3.539.566 |
| (1.248) | (1.053) | (521) | (442) | (616) | 24 | (362.866) | (325.592) |
| (580.152) | 31.716 | (69.863) | (36.580) | (98.443) | (18.959) | (24.536.624) | (3.887.387) |
| (25.796) | (41.544) | (18.953) | (38.247) | 21.526 | (683) | (3.331.411) | (3.456.429) |
| (29) | (93) | 74 | 204 | (105) | 664 | 16.998 | 107.803 |
| (580.704) | 121.028 | (159.853) | (20.111) | (56.680) | 4.183 | (29.479.415) | 384.284 |
| (10.592) | (13.405) | (1.722) | (2.806) | (5.191) | (6.289) | (758.453) | (891.959) |
| (722) | (722) | 0 | 0 | (29) | (39) | (14.153) | (17.773) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (19.242) | (20.335) |
| (2) | (3) | 0 | (1) | (1) | (2) | (2.927) | (3.560) |
| (11.316) | (14.130) | (1.722) | (2.807) | (5.221) | (6.330) | (794.775) | (933.627) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 443 | 564 | 6.853 | 8.857 |
| (11.316) | (14.130) | (1.722) | (2.807) | (4.778) | (5.766) | (787.922) | (924.770) |
| (592.020) | 106.898 | (161.575) | (22.918) | (61.458) | (1.583) | (30.267.337) | (540.486) |
| 0 | (28) | (28) | (35) | (747) | (2) | (16.747) | (17.771) |
| (240) | (332) | 0 | 0 | 0 | 0 | (553) | (851) |
| (15.889) | (15.601) | (4.678) | (8.828) | (5.821) | (5.005) | (1.111.604) | (1.124.319) |
| 46 | 695 | (996) | (213) | (13) | (127) | (14.711) | 4.252 |
| (16.083) | (15.266) | (5.702) | (9.076) | (6.581) | (5.134) | (1.143.615) | (1.138.689) |
| (608.103) | 91.632 | (167.277) | (31.994) | (68.039) | (6.717) | (31.410.952) | (1.679.175) |
| (22) | 0 | (29) | (27) | (18) | 14 | (11.872) | (1.539) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (282) | (94) |
| (608.125) | 91.632 | (167.306) | (32.021) | (68.057) | (6.703) | (31.423.106) | (1.680.808) |
| $ (608.125) | $ 91.632 | $ (167.306) | $ (32.021) | $ (68.057) | $ (6.703) | $ (31.423.106) | $ (1.680.808) |

## Ausweis der Nettovermögensänderungen

| (Angaben in Tausend) | PIMCO Asia High Yield Bond Fund | | Asia Strategic Interest Bond Fund | | PIMCO Capital Securities Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | $ 3.411.923 | $ 890.928 | $ 361.011 | $ 167.716 | $ 9.110.409 | $ 7.958.322 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 1.624.590 | 1.451.271 | 63.208 | 155.799 | 1.061.822 | 2.941.670 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 4.497 | 578 | 316 | 23 | 5.034 | 4.337 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | (1.208.330) | (250.866) | (49.053) | (12.469) | (2.725.487) | (1.925.097) |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | (801.554) | (12.686) | (62.908) | (1.427) | (1.500.717) | 189.173 |
| **Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums** | $ 3.031.126 | $ 2.079.225 | $ 312.574 | $ 309.642 | $ 5.951.061 | $ 9.168.405 |

| (Angaben in Tausend) | Diversified Income Duration Hedged Fund | | Dynamic Bond Fund | | Dynamic Multi-Asset Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | $ 1.305.365 | $ 1.486.931 | $ 3.277.997 | $ 3.204.860 | € 7.635.950 | € 5.128.926 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 37.493 | 335.303 | 312.414 | 938.505 | 557.167 | 3.391.097 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 14 | 12 | 747 | 972 | 49 | 40 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | (315.292) | (183.600) | (721.606) | (364.526) | (1.367.212) | (1.204.111) |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | (217.427) | 23.062 | (433.724) | 994 | (744.226) | 117.328 |
| **Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums** | $ 810.153 | $ 1.661.708 | $ 2.435.828 | $ 3.780.805 | € 6.081.728 | € 7.433.280 |

| (Angaben in Tausend) | PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | | Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | | PIMCO ESG Income Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Berichtszeitraum vom 29. April 2021 bis 30. Juni 2021 |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | $ 290.475 | $ 220.309 | $ 29.760 | $ 32.571 | $ 125.087 | $ 0 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 64.474 | 126.441 | 7.100 | 17.779 | 72.168 | 6.403 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 7 | 0 | 0 | 0 | 95 | 5 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | (41.842) | (7.765) | (9.015) | (18.903) | (23.835) | (229) |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | (44.072) | (5.674) | (2.216) | (605) | (22.375) | (15) |
| **Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums** | $ 269.042 | $ 333.311 | $ 25.629 | $ 30.842 | $ 151.140 | $ 6.164 |

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

| PIMCO Climate Bond Fund | | Commodity Real Return Fund | | PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | | Diversified Income Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 328.081 | $ 101.869 | $ 1.444.182 | $ 325.109 | $ 139.704 | $ 144.512 | $ 16.447.733 | $ 18.641.861 |
| 71.635 | 164.292 | 1.074.681 | 859.368 | 5.489 | 14.740 | 1.118.430 | 3.721.772 |
| 136 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 10.732 | 10.036 |
| (54.800) | (2.490) | (859.208) | (154.348) | (8.275) | (12.854) | (4.099.599) | (3.404.391) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (70.877) | (3.466) | 152.570 | 113.541 | (15.973) | (722) | (3.407.294) | (310.460) |
| $ 274.175 | $ 260.205 | $ 1.812.225 | $ 1.143.670 | $ 120.945 | $ 145.676 | $ 10.070.002 | $ 18.658.818 |

| Emerging Local Bond Fund | | Emerging Markets Bond Fund | | Emerging Markets Bond ESG Fund | | Emerging Markets Corporate Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 2.151.129 | $ 2.849.284 | $ 4.714.744 | $ 5.263.015 | $ 2.635.769 | $ 1.441.457 | $ 212.894 | $ 261.236 |
| 490.111 | 859.332 | 982.073 | 1.619.483 | 948.977 | 1.379.091 | 11.490 | 35.909 |
| 999 | 876 | 2.131 | 2.212 | 962 | 18 | 0 | 0 |
| (499.751) | (822.114) | (1.467.932) | (1.568.000) | (652.057) | (389.049) | (21.579) | (48.455) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (289.605) | (119.043) | (1.016.879) | (150.200) | (736.449) | (51.351) | (47.833) | (5.908) |
| $ 1.852.883 | $ 2.768.335 | $ 3.214.137 | $ 5.166.510 | $ 2.197.202 | $ 2.380.166 | $ 154.972 | $ 242.782 |

| Euro Bond Fund | | Euro Credit Fund | | Euro Income Bond Fund | | Euro Long Average Duration Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| € 2.574.129 | € 3.243.455 | € 1.017.163 | € 1.150.058 | € 2.482.304 | € 3.182.867 | € 160.601 | € 182.461 |
| 211.134 | 381.251 | 246.063 | 234.135 | 357.731 | 355.269 | 18.010 | 36.974 |
| 0 | 0 | 235 | 245 | 987 | 924 | 0 | 0 |
| (444.326) | (751.156) | (315.369) | (342.314) | (944.650) | (829.448) | (21.658) | (11.768) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (285.534) | (77.849) | (143.944) | (10.272) | (285.965) | (8.728) | (41.742) | (15.675) |
| € 2.055.403 | € 2.795.701 | € 804.148 | € 1.031.852 | € 1.610.407 | € 2.700.884 | € 115.211 | € 191.992 |

## Ausweis der Nettovermögensänderungen (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Euro Short-Term Fund | | PIMCO European High Yield Bond Fund | | PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | € 629.859 | € 807.538 | € 170.489 | € 162.061 | € 395.491 | € 350.749 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 32.982 | 109.378 | 6.506 | 4.517 | 53.364 | 152.859 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | (145.195) | (217.234) | (9.060) | (4.922) | (163.937) | (90.998) |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | (10.387) | (154) | (23.950) | 4.514 | (11.240) | (2.364) |
| **Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums** | € 507.259 | € 699.528 | € 143.985 | € 166.170 | € 273.678 | € 410.246 |

| (Angaben in Tausend) | PIMCO Global Core Asset Allocation Fund | | Global High Yield Bond Fund | | Global Investment Grade Credit Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | $ 1.035.021 | $ 702.430 | $ 5.169.160 | $ 5.403.543 | $ 17.154.925 | $ 28.178.170 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 121.244 | 142.029 | 751.865 | 1.913.884 | 2.112.051 | 4.508.571 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 3 | 6 | 1.143 | 1.754 | 2.628 | 6.280 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | (146.305) | (81.743) | (1.438.485) | (1.922.018) | (5.254.660) | (10.687.732) |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | (230.671) | 34.961 | (959.273) | 24.484 | (2.997.637) | (646.628) |
| **Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums** | $ 779.292 | $ 797.683 | $ 3.524.410 | $ 5.421.647 | $ 11.017.307 | $ 21.358.661 |

| (Angaben in Tausend) | Income Fund II | | Inflation Multi-Asset Fund(1) | | Low Average Duration Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Berichtszeitraum vom 29. Januar 2021 bis 30. Juni 2021 | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | $ 27.770 | $ 0 | $ 164.345 | $ 70.032 | $ 1.179.138 | $ 1.183.413 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 9.537 | 24.992 | 396.530 | 30.022 | 1.094.731 | 391.155 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 42 | 5 | 102 | 0 | 131 | 44 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | (1.548) | 0 | (50.789) | (7.539) | (628.372) | (456.843) |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | (3.724) | 322 | (39.007) | 6.811 | (69.192) | (4.620) |
| **Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums** | $ 32.077 | $ 25.319 | $ 471.181 | $ 99.326 | $ 1.576.436 | $ 1.113.149 |

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

(1) Der Inflation Strategy Fund wurde am 13. April 2022 in Inflation Multi-Asset Fund umbenannt.

(2) Der Global LIBOR Plus Bond Fund wurde am 01. Juli 2022 in Low Duration Opportunities Fund umbenannt.

| Global Advantage Fund | | Global Bond Fund | | Global Bond ESG Fund | | Global Bond Ex-US Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 521.067 | $ 524.284 | $ 14.038.846 | $ 16.302.309 | $ 2.302.966 | $ 1.509.594 | $ 911.707 | $ 929.980 |
| 14.290 | 42.044 | 1.829.723 | 2.275.964 | 589.111 | 471.804 | 178.248 | 222.021 |
| 0 | 0 | 1.567 | 1.269 | 1.948 | 1.118 | 348 | 457 |
| (20.204) | (31.795) | (2.625.242) | (3.364.312) | (294.593) | (284.327) | (271.535) | (121.956) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (79.542) | (18.868) | (1.919.147) | (515.997) | (421.558) | (51.098) | (85.130) | (16.440) |
| $ 435.611 | $ 515.665 | $ 11.325.747 | $ 14.699.233 | $ 2.177.874 | $ 1.647.091 | $ 733.638 | $ 1.014.062 |

| Global Investment Grade Credit ESG Fund | | Global Low Duration Real Return Fund | | Global Real Return Fund | | Income Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 1.189.563 | $ 332.010 | $ 1.199.076 | $ 787.871 | $ 3.703.379 | $ 2.578.062 | $ 73.579.726 | $ 71.275.311 |
| 866.139 | 386.733 | 346.002 | 432.470 | 511.183 | 1.280.265 | 9.993.226 | 17.722.603 |
| 308 | 247 | 0 | 2 | 2.840 | 1.272 | 53.873 | 45.438 |
| (282.014) | (102.419) | (470.577) | (161.155) | (783.240) | (573.463) | (16.972.510) | (16.754.429) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (347.500) | (14.274) | (92.273) | (5.110) | (637.099) | (60.366) | (9.797.148) | (406.389) |
| $ 1.426.496 | $ 602.297 | $ 982.228 | $ 1.054.078 | $ 2.797.063 | $ 3.225.770 | $ 56.857.167 | $ 71.882.534 |

| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | | Low Duration Income Fund | | Low Duration Opportunities Fund(2) | | PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 806.869 | $ 632.519 | $ 1.367.475 | $ 960.639 | $ 3.217.260 | $ 2.644.601 | $ 100.538 | $ 77.631 |
| 88.461 | 199.858 | 469.983 | 355.275 | 779.899 | 994.421 | 62.957 | 17.848 |
| 101 | 0 | 25 | 13 | 396 | 333 | 3 | 1 |
| (111.063) | (58.194) | (618.274) | (229.563) | (414.455) | (452.675) | (47.316) | (28.069) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (105.832) | (14.878) | (188.689) | (10.850) | (561.779) | 30.936 | 4.907 | 28.285 |
| $ 678.536 | $ 759.305 | $ 1.030.520 | $ 1.075.514 | $ 3.021.321 | $ 3.217.616 | $ 121.089 | $ 95.696 |

## Ausweis der Nettovermögensänderungen

| (Amounts in thousands) | Mortgage Opportunities Fund | | StocksPLUS™ Fund | | PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | $ 2.238.424 | $ 1.977.007 | $ 3.761.156 | $ 3.538.833 | $ 11.610 | $ 8.417 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 880.678 | 821.900 | 538.574 | 1.197.570 | 1.393 | 777 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 2.537 | 2.096 | 41 | 0 | 0 | 0 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | (1.283.324) | (422.351) | (1.969.507) | (2.073.724) | (299) | (29) |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | (231.045) | 9.085 | (714.098) | 432.036 | (2.932) | 1.320 |
| **Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums** | $ 1.607.270 | $ 2.387.737 | $ 1.616.166 | $ 3.094.715 | $ 9.772 | $ 10.485 |

| (Angaben in Tausend) | UK Long Term Corporate Bond Fund | | US High Yield Bond Fund | | US Investment Grade Corporate Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | £ 425.748 | £ 364.631 | $ 3.923.786 | $ 4.054.927 | $ 878.100 | $ 1.180.148 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 34.072 | 100.391 | 548.535 | 1.372.068 | 92.249 | 256.184 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 1 | 507 | 3.080 | 3.609 | 3.268 | 6.738 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | (66.070) | (39.731) | (1.392.766) | (1.273.956) | (398.841) | (341.022) |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | (94.895) | (14.139) | (608.125) | 91.632 | (167.306) | (32.021) |
| **Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums** | £ 298.856 | £ 411.659 | $ 2.474.510 | $ 4.248.280 | $ 407.470 | $ 1.070.027 |

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 2022 und zum 30. Juni 2021 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen Rechnung zu tragen. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 10 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

| Strategic Income Fund | | Total Return Bond Fund | | PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | | UK Corporate Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 619.928 | $ 974.664 | $ 4.944.898 | $ 6.424.053 | $ 101.789 | $ 47.221 | £ 592.164 | £ 764.359 |
| 131.886 | 93.992 | 577.403 | 626.294 | 21.844 | 32.740 | 56.101 | 98.367 |
| 5 | 6 | 4.094 | 3.923 | 0 | 0 | 0 | 14 |
| (119.881) | (314.441) | (727.420) | (1.490.351) | (12.472) | (4.634) | (61.666) | (253.403) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (103.094) | 21.256 | (734.555) | (168.950) | 12.531 | 126 | (81.541) | (23.186) |
| $ 528.844 | $ 775.477 | $ 4.064.420 | $ 5.394.969 | $ 123.692 | $ 75.453 | £ 505.058 | £ 586.151 |

| US Short-Term Fund | | Summe der Gesellschaft* | |
|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 2.650.198 | $ 3.654.185 | $ 209.342.798 | $ 215.950.477 |
| 845.504 | 628.091 | 33.462.234 | 56.904.066 |
| 5.244 | 4.666 | 110.788 | 100.526 |
| (953.204) | (1.075.527) | (53.479.245) | (55.984.002) |
| 0 | 0 | (1.324.437) | (535.640) |
| (68.057) | (6.703) | (31.423.106) | (1.680.808) |
| $ 2.479.685 | $ 3.204.712 | $ 156.689.032 | $ 214.754.619 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Asia High Yield Bond Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Emeco Pty. Ltd.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 10.07.2026 | AUD | 11.810 | $ 7.732 | 0,25 |
| **Macquarie Bank Ltd.** | | | | |
| 6,082 % fällig am 07.06.2032 (e) | | 8.000 | 5.526 | 0,18 |
| **Mineral Resources Ltd.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.11.2027 | $ | 16.040 | 15.665 | 0,52 |
| 8,125 % fällig am 01.05.2027 | | 9.496 | 9.269 | 0,31 |
| **Santos Finance Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 13.03.2029 | | 5.800 | 5.599 | 0,18 |
| Summe Australien | | | 43.791 | 1,44 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **ERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BRF S.A.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 21.09.2050 | | 1.703 | 1.137 | 0,04 |
| **CSN Resources S.A.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 10.06.2031 | | 5.000 | 3.558 | 0,11 |
| Summe Brasilien | | | 4.695 | 0,15 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **WANDELANLEIHEN & WECHSEL** | | | | |
| **Cathay Pacific Finance Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 05.02.2026 | HKD | 138.000 | 19.068 | 0,63 |
| **Hansoh Pharmaceutical Group Co. Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 22.01.2026 (a) | $ | 12.100 | 10.957 | 0,36 |
| **Meituan** | | | | |
| 0,000 % fällig am 27.04.2027 (a) | | 1.900 | 1.675 | 0,06 |
| 0,000 % fällig am 27.04.2028 (a) | | 6.800 | 5.722 | 0,19 |
| **Vnet Group, Inc.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.02.2026 (a) | | 10.100 | 8.320 | 0,27 |
| | | | 45.742 | 1,51 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AAC Technologies Holdings, Inc.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 27.11.2024 | | 14.730 | 13.781 | 0,45 |
| **Agile Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 21.04.2025 | | 14.195 | 4.684 | 0,15 |
| 5,500 % fällig am 17.05.2026 | | 12.500 | 4.088 | 0,13 |
| 7,875 % fällig am 31.07.2024 (c) | | 16.487 | 3.588 | 0,12 |
| 8,375 % fällig am 04.12.2023 (c) | | 11.300 | 2.627 | 0,09 |
| **Anton Oilfield Services Group** | | | | |
| 7,500 % fällig am 02.12.2022 | | 2.100 | 1.858 | 0,06 |
| **Central China Real Estate Ltd.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 13.08.2024 | | 533 | 170 | 0,01 |
| 7,650 % fällig am 27.08.2023 | | 3.800 | 1.695 | 0,06 |
| 7,900 % fällig am 07.11.2023 | | 2.000 | 809 | 0,03 |
| **China Evergrande Group** | | | | |
| 7,500 % fällig am 28.06.2023 ^ | | 36.400 | 3.003 | 0,10 |
| 8,750 % fällig am 28.06.2025 ^ | | 38.400 | 3.186 | 0,10 |
| 10,000 % fällig am 11.04.2023 ^ | | 9.300 | 779 | 0,03 |
| **China Hongqiao Group Ltd.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 08.06.2024 | | 20.900 | 19.463 | 0,64 |
| **China Modern Dairy Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 14.07.2026 | | 24.100 | 21.003 | 0,69 |
| **China SCE Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 29.09.2024 | | 11.400 | 3.505 | 0,12 |
| 6,000 % fällig am 04.02.2026 | | 10.150 | 2.817 | 0,09 |
| 7,000 % fällig am 02.05.2025 | | 19.400 | 5.771 | 0,19 |
| 7,375 % fällig am 09.04.2024 | | 12.400 | 4.309 | 0,14 |
| **CIFI Holdings Group Co. Ltd.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 12.04.2027 | | 8.000 | 4.342 | 0,14 |
| 4,450 % fällig am 17.08.2026 | | 10.000 | 5.692 | 0,19 |
| 5,250 % fällig am 13.05.2026 | | 13.452 | 7.643 | 0,25 |
| 5,375 % fällig am 24.08.2022 (c) | | 1.700 | 1.250 | 0,04 |
| 5,500 % fällig am 23.01.2023 | | 3.000 | 2.490 | 0,08 |
| 5,950 % fällig am 20.10.2025 | | 8.567 | 5.063 | 0,17 |
| 6,000 % fällig am 16.07.2025 | | 9.400 | 5.668 | 0,19 |
| 6,450 % fällig am 07.11.2024 | | 21.695 | 13.961 | 0,46 |
| 6,550 % fällig am 28.03.2024 | | 23.550 | 15.813 | 0,52 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 22.10.2025 | | 1.000 | 492 | 0,02 |
| 3,875 % fällig am 22.10.2030 | | 2.000 | 845 | 0,03 |
| 4,800 % fällig am 06.08.2030 | $ | 2.600 | $ 1.109 | 0,04 |
| 5,125 % fällig am 17.01.2025 | | 3.500 | 1.918 | 0,06 |
| 5,125 % fällig am 14.01.2027 | | 11.500 | 5.113 | 0,17 |
| 5,400 % fällig am 27.05.2025 | | 6.090 | 3.304 | 0,11 |
| 5,625 % fällig am 15.12.2026 (g) | | 2.000 | 957 | 0,03 |
| 6,150 % fällig am 17.09.2025 | | 7.800 | 4.216 | 0,14 |
| 7,250 % fällig am 08.04.2026 | | 17.000 | 9.316 | 0,31 |
| **eHi Car Services Ltd.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 21.09.2026 | | 8.800 | 5.291 | 0,17 |
| 7,750 % fällig am 14.11.2024 | | 14.700 | 9.628 | 0,32 |
| **FWD Group Ltd.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 09.07.2024 | | 200 | 199 | 0,01 |
| 8,045 % fällig am 15.12.2022 (c) | | 200 | 199 | 0,01 |
| **FWD Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 24.09.2024 | | 200 | 201 | 0,01 |
| **Greentown China Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,700 % fällig am 29.04.2025 | | 4.600 | 3.680 | 0,12 |
| 5,650 % fällig am 13.07.2025 | | 700 | 560 | 0,02 |
| **Health & Happiness H&H International Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 24.10.2024 | | 28.235 | 24.706 | 0,81 |
| **Kaisa Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 30.06.2049 ^ | | 17.900 | 2.518 | 0,08 |
| 9,375 % fällig am 30.06.2024 ^ | | 15.750 | 2.199 | 0,07 |
| 9,750 % fällig am 28.09.2023 ^ | | 13.200 | 1.831 | 0,06 |
| 10,500 % fällig am 15.01.2025 ^ | | 20.200 | 2.778 | 0,09 |
| 10,875 % fällig am 23.07.2023 ^ | | 9.800 | 1.359 | 0,04 |
| 11,250 % fällig am 09.04.2022 ^ | | 6.700 | 936 | 0,03 |
| 11,700 % fällig am 11.11.2025 ^ | | 1.450 | 202 | 0,01 |
| 11,950 % fällig am 22.10.2022 ^ | | 800 | 111 | 0,00 |
| 11,950 % fällig am 12.11.2023 ^ | | 12.100 | 1.689 | 0,06 |
| **KWG Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 10.11.2024 | | 14.000 | 2.808 | 0,09 |
| 5,950 % fällig am 10.08.2025 | | 18.323 | 3.712 | 0,12 |
| 6,300 % fällig am 13.02.2026 | | 18.400 | 3.685 | 0,12 |
| 7,400 % fällig am 05.03.2024 | | 5.100 | 994 | 0,03 |
| 7,400 % fällig am 13.01.2027 | | 7.000 | 1.370 | 0,05 |
| 7,875 % fällig am 01.09.2023 | | 7.300 | 1.870 | 0,06 |
| **Melco Resorts Finance Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 06.06.2025 | | 38.770 | 29.030 | 0,96 |
| 5,250 % fällig am 26.04.2026 | | 11.324 | 8.004 | 0,26 |
| 5,625 % fällig am 17.07.2027 | | 5.450 | 3.661 | 0,12 |
| 5,750 % fällig am 21.07.2028 | | 24.200 | 15.609 | 0,51 |
| **MGM China Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.02.2027 | | 20.455 | 14.484 | 0,48 |
| 5,250 % fällig am 18.06.2025 | | 6.800 | 5.227 | 0,17 |
| 5,375 % fällig am 15.05.2024 | | 1.300 | 1.110 | 0,04 |
| 5,875 % fällig am 15.05.2026 | | 1.500 | 1.136 | 0,04 |
| **New Metro Global Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 02.05.2026 | | 7.000 | 3.239 | 0,11 |
| 6,800 % fällig am 05.08.2023 | | 6.800 | 4.658 | 0,15 |
| **Powerlong Real Estate Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 30.04.2025 | | 27.045 | 4.327 | 0,14 |
| 6,250 % fällig am 10.08.2024 (g) | | 12.530 | 2.193 | 0,07 |
| 6,950 % fällig am 23.07.2023 | | 1.988 | 378 | 0,01 |
| **Redsun Properties Group Ltd.** | | | | |
| 7,300 % fällig am 13.01.2025 | | 8.100 | 1.134 | 0,04 |
| 9,500 % fällig am 20.09.2023 | | 3.800 | 532 | 0,02 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 2,550 % fällig am 08.03.2027 | | 5.900 | 4.307 | 0,14 |
| 3,800 % fällig am 08.01.2026 | | 39.260 | 31.518 | 1,04 |
| 4,875 % fällig am 18.06.2030 | | 2.000 | 1.465 | 0,05 |
| 5,125 % fällig am 08.08.2025 | | 6.000 | 5.043 | 0,17 |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028 | | 5.000 | 3.863 | 0,13 |
| **Seazen Group Ltd.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 13.07.2025 | | 14.100 | 8.280 | 0,27 |
| 6,000 % fällig am 12.08.2024 | | 14.100 | 8.460 | 0,28 |
| 6,150 % fällig am 15.04.2023 | | 1.700 | 1.267 | 0,04 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 26.04.2024 ^(g) | | 41.300 | 6.298 | 0,21 |
| 6,500 % fällig am 09.07.2023 ^(g) | | 13.500 | 2.059 | 0,07 |
| 6,500 % fällig am 26.01.2026 ^ | | 16.600 | 2.462 | 0,08 |
| 6,650 % fällig am 03.08.2024 ^ | | 19.400 | 2.863 | 0,09 |
| 6,800 % fällig am 20.10.2024 ^ | | 12.700 | 1.874 | 0,06 |
| 7,000 % fällig am 09.07.2025 ^ | | 9.200 | 1.380 | 0,05 |
| 7,500 % fällig am 01.02.2024 ^ | | 2.000 | 305 | 0,01 |
| 7,950 % fällig am 11.10.2023 ^ | | 10.000 | 1.525 | 0,05 |
| 8,350 % fällig am 19.04.2023 ^ | | 19.200 | 2.928 | 0,10 |
| **Times China Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,550 % fällig am 04.06.2024 | | 18.900 | 3.185 | 0,11 |
| 6,200 % fällig am 22.03.2026 | | 8.000 | 1.120 | 0,04 |
| 6,600 % fällig am 02.03.2023 | $ | 7.236 | $ 1.375 | 0,05 |
| 6,750 % fällig am 16.07.2023 | | 19.880 | 3.380 | 0,11 |
| **VLL International, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 28.11.2024 | | 24.185 | 23.495 | 0,77 |
| 7,250 % fällig am 20.07.2027 | | 10.700 | 10.673 | 0,35 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.10.2024 | | 9.902 | 7.377 | 0,24 |
| 5,125 % fällig am 15.12.2029 | | 2.800 | 1.742 | 0,06 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2026 | | 26.744 | 18.563 | 0,61 |
| 5,500 % fällig am 01.10.2027 | | 13.813 | 8.960 | 0,30 |
| 5,625 % fällig am 26.08.2028 | | 18.130 | 11.218 | 0,37 |
| **Zhongsheng Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 13.01.2026 | | 2.850 | 2.657 | 0,09 |
| | | | 533.218 | 17,59 |
| Summe Cayman Inseln | | | 578.960 | 19,10 |
| **CHINA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **CFLD Cayman Investment Ltd.** | | | | |
| 6,920 % fällig am 16.06.2022 ^ | | 5.800 | 568 | 0,02 |
| **Dalian Wanda Commercial Management Group Co. Ltd.** | | | | |
| 4,700 % fällig am 03.06.2023 | CNY | 30.000 | 3.630 | 0,12 |
| 4,890 % fällig am 17.04.2023 | | 10.000 | 1.287 | 0,04 |
| **Flourish Century** | | | | |
| 6,600 % fällig am 04.02.2049 ^(f) | $ | 10.900 | 1.200 | 0,04 |
| **Greenland Global Investment Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 03.07.2024 | | 10.550 | 3.059 | 0,10 |
| 7,250 % fällig am 22.01.2025 | | 24.449 | 6.723 | 0,22 |
| **Huarong Universe Investment Holding Ltd.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 05.12.2022 | € | 14.750 | 14.881 | 0,49 |
| **Jinke Properties Group Co. Ltd.** | | | | |
| 6,850 % fällig am 28.05.2024 | $ | 2.700 | 662 | 0,02 |
| **New Metro Global Ltd.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.10.2025 | | 4.500 | 2.156 | 0,07 |
| 4,800 % fällig am 15.12.2024 | | 18.300 | 10.065 | 0,33 |
| **Overseas Chinese Town Asia Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.07.2023 (c) | | 3.600 | 3.576 | 0,12 |
| **Wanda Group Overseas Ltd.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 24.07.2022 | | 27.923 | 27.448 | 0,91 |
| **Yango Group Co. Ltd.** | | | | |
| 6,900 % fällig am 31.10.2022 ^ | CNY | 40.000 | 1.638 | 0,05 |
| **Yango Justice International Ltd.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.04.2024 ^ | $ | 17.800 | 1.433 | 0,05 |
| 7,500 % fällig am 17.02.2025 ^ | | 3.000 | 263 | 0,01 |
| 7,875 % fällig am 04.09.2024 ^ | | 5.800 | 508 | 0,02 |
| 8,250 % fällig am 25.11.2023 ^ | | 4.400 | 310 | 0,01 |
| 9,250 % fällig am 15.04.2023 ^ | | 10.900 | 870 | 0,03 |
| **ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 16.07.2025 | | 17.180 | 15.726 | 0,52 |
| Summe China | | | 96.003 | 3,17 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 12.01.2027 (c)(e) | | 2.700 | 2.242 | 0,07 |
| 4,625 % fällig am 25.02.2031 (c)(e) | | 5.700 | 4.221 | 0,14 |
| Summe Frankreich | | | 6.463 | 0,21 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 4,500 % fällig am 30.11.2026 (c)(e) | € | 11.800 | 9.640 | 0,32 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **WANDELANLEIHEN & WECHSEL** | | | | |
| **Universe Trek Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.06.2026 (a) | $ | 800 | 732 | 0,02 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bank of East Asia Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 22.04.2032 (e) | | 22.100 | 21.618 | 0,71 |
| **Cathay Pacific MTN Financing HK Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 17.08.2026 | | 2.860 | 2.619 | 0,09 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Fortune Star BVI Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 02.10.2026 | € | 22.824 | $ 14.228 | 0,47 |
| 4,350 % fällig am 06.05.2023 | | 16.414 | 13.604 | 0,45 |
| 5,000 % fällig am 18.05.2026 | $ | 17.000 | 10.370 | 0,34 |
| 5,950 % fällig am 29.01.2023 | | 1.000 | 888 | 0,03 |
| 5,950 % fällig am 19.10.2025 | | 19.900 | 12.761 | 0,42 |
| 6,750 % fällig am 02.07.2023 | | 800 | 638 | 0,02 |
| **Gemdale Ever Prosperity Investment Ltd.** | | | | |
| 4,950 % fällig am 12.08.2024 | | 3.000 | 2.137 | 0,07 |
| **Huarong Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 30.09.2030 | | 10.400 | 8.008 | 0,26 |
| 3,875 % fällig am 13.11.2029 | | 18.100 | 14.457 | 0,48 |
| 4,500 % fällig am 29.05.2029 | | 8.700 | 7.254 | 0,24 |
| 4,625 % fällig am 03.06.2026 | | 3.300 | 3.032 | 0,10 |
| 4,875 % fällig am 22.11.2026 | | 7.880 | 7.240 | 0,24 |
| 4,950 % fällig am 07.11.2047 | | 4.260 | 3.003 | 0,10 |
| **King Talent Management Ltd.** | | | | |
| 5,600 % fällig am 04.12.2022 (c) | | 6.800 | 6.508 | 0,21 |
| **Lenovo Group Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.04.2025 | | 3.000 | 3.089 | 0,10 |
| **Wealth Driven Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 17.08.2023 | | 3.000 | 2.955 | 0,10 |
| **Yanlord Land HK Co. Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 20.05.2026 | | 27.775 | 21.152 | 0,70 |
| 6,750 % fällig am 23.04.2023 | | 1.800 | 1.714 | 0,06 |
| 6,800 % fällig am 27.02.2024 | | 10.724 | 9.357 | 0,31 |
| | | | 166.632 | 5,50 |
| Summe Hongkong | | | 167.364 | 5,52 |
| **INDIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Adani Green Energy Ltd.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 08.09.2024 | | 2.800 | 2.529 | 0,08 |
| **Adani Green Energy UP Ltd.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 10.12.2024 | | 8.000 | 7.680 | 0,25 |
| **GMR Hyderabad International Airport Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 27.10.2027 | | 10.760 | 9.092 | 0,30 |
| 4,750 % fällig am 02.02.2026 | | 25.175 | 22.941 | 0,76 |
| **JSW Hydro Energy Ltd.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 18.05.2031 | | 5.658 | 4.513 | 0,15 |
| **JSW Steel Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 05.04.2027 | | 11.800 | 9.525 | 0,31 |
| 5,050 % fällig am 05.04.2032 | | 10.600 | 7.888 | 0,26 |
| **Muthoot Finance Ltd.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 02.09.2023 | | 20.400 | 19.859 | 0,65 |
| 6,125 % fällig am 31.10.2022 | | 14.286 | 14.277 | 0,47 |
| **Periama Holdings LLC** | | | | |
| 5,950 % fällig am 19.04.2026 | | 36.326 | 32.645 | 1,08 |
| **Reliance Industries Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 12.01.2032 | | 8.600 | 7.143 | 0,24 |
| **ReNew Power Pvt Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 05.03.2027 | | 10.866 | 9.956 | 0,33 |
| 6,450 % fällig am 27.09.2022 | | 33.451 | 33.326 | 1,10 |
| **ReNew Wind Energy AP2** | | | | |
| 4,500 % fällig am 14.07.2028 | | 6.838 | 5.361 | 0,18 |
| **Shriram Transport Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 4,150 % fällig am 18.07.2025 | | 14.900 | 13.039 | 0,43 |
| 4,400 % fällig am 13.03.2024 | | 13.870 | 12.814 | 0,42 |
| 5,100 % fällig am 16.07.2023 | | 6.900 | 6.616 | 0,22 |
| 5,950 % fällig am 24.10.2022 | | 26.725 | 26.434 | 0,87 |
| Summe Indien | | | 245.638 | 8,10 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ABM Investama Tbk PT** | | | | |
| 9,500 % fällig am 05.08.2026 | | 2.200 | 1.948 | 0,06 |
| **Adaro Indonesia PT** | | | | |
| 4,250 % fällig am 31.10.2024 | | 4.204 | 3.961 | 0,13 |
| **Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT** | | | | |
| 3,750 % fällig am 30.03.2026 (e) | | 18.480 | 16.815 | 0,55 |
| **Bukit Makmur Mandiri Utama PT** | | | | |
| 7,750 % fällig am 10.02.2026 | | 12.956 | 11.080 | 0,37 |
| **Cikarang Listrindo Tbk PT** | | | | |
| 4,950 % fällig am 14.09.2026 | | 8.743 | 8.115 | 0,27 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Freeport Indonesia PT** | | | | |
| 4,763 % fällig am 14.04.2027 | | 9.200 | 8.850 | 0,29 |
| 5,315 % fällig am 14.04.2032 | | 21.800 | 19.871 | 0,66 |
| **Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT** | | | | |
| 3,541 % fällig am 27.04.2032 | $ | 6.900 | $ 5.382 | 0,18 |
| **Medco Oak Tree Pte. Ltd.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 14.05.2026 | | 32.100 | 29.291 | 0,97 |
| **Pakuwon Jati Tbk PT** | | | | |
| 4,875 % fällig am 29.04.2028 | | 6.100 | 5.242 | 0,17 |
| Summe Indonesien | | | 110.555 | 3,65 |
| **ISRAEL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Energean Israel Finance Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.03.2026 | | 2.800 | 2.482 | 0,08 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.09.2031 (c)(e) | € | 6.350 | 5.188 | 0,17 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 7,500 % fällig am 03.06.2026 (c)(e) | | 3.100 | 3.000 | 0,10 |
| Summe Italien | | | 8.188 | 0,27 |
| **JAPAN** | | | | |
| **WANDELANLEIHEN & WECHSEL** | | | | |
| **ANA Holdings, Inc.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 10.12.2031 (a) | ¥ | 860.000 | 6.267 | 0,21 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **West China Cement Ltd.** | | | | |
| 4,950 % fällig am 08.07.2026 | $ | 19.175 | 15.513 | 0,51 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Guara Norte SARL** | | | | |
| 5,198 % fällig am 15.06.2034 | | 4.681 | 3.806 | 0,13 |
| **MALAYSIA** | | | | |
| **WANDELANLEIHEN & WECHSEL** | | | | |
| **Cerah Capital Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 08.08.2024 (a) | | 26.600 | 26.581 | 0,88 |
| **MAURITIUS** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Azure Power Solar Energy Pvt Ltd.** | | | | |
| 5,650 % fällig am 24.12.2024 | | 900 | 853 | 0,03 |
| **CA Magnum Holdings** | | | | |
| 5,375 % fällig am 31.10.2026 | | 31.760 | 27.602 | 0,91 |
| **Greenko Dutch BV** | | | | |
| 3,850 % fällig am 29.03.2026 | | 4.753 | 4.043 | 0,13 |
| **Greenko Investment Co.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 16.08.2023 | | 15.882 | 15.387 | 0,51 |
| **Greenko Mauritius Ltd.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 21.02.2023 | | 1.820 | 1.807 | 0,06 |
| **Greenko Power Ltd.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 13.12.2028 | | 2.737 | 2.193 | 0,07 |
| **Greenko Solar Mauritius Ltd.** | | | | |
| 5,550 % fällig am 29.01.2025 | | 4.900 | 4.606 | 0,15 |
| 5,950 % fällig am 29.07.2026 | | 26.000 | 23.237 | 0,77 |
| **Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 06.04.2025 | | 45.700 | 42.067 | 1,39 |
| **India Clean Energy Holdings** | | | | |
| 4,500 % fällig am 18.04.2027 | | 10.650 | 7.788 | 0,26 |
| **India Green Energy Holdings** | | | | |
| 5,375 % fällig am 29.04.2024 | | 27.878 | 26.085 | 0,86 |
| **India Green Power Holdings** | | | | |
| 4,000 % fällig am 22.02.2027 | | 15.792 | 12.377 | 0,41 |
| **India Toll Roads** | | | | |
| 5,500 % fällig am 19.08.2024 | | 19.543 | 18.632 | 0,61 |
| Summe Mauritius | | | 186.677 | 6,16 |
| **MEXIKO** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Mercantil del Norte S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.01.2027 (c)(e) | | 8.050 | 6.682 | 0,22 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 6,625 % fällig am 24.01.2032 (c)(e) | $ | 4.650 | $ 3.806 | 0,13 |
| Summe Mexiko | | | 10.488 | 0,35 |
| **MONGOLEI** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Mongolia Government International Bond** | | | | |
| 5,125 % fällig am 07.04.2026 | | 24.495 | 22.105 | 0,73 |
| 5,625 % fällig am 01.05.2023 | | 12.030 | 11.864 | 0,39 |
| 8,750 % fällig am 09.03.2024 | | 2.525 | 2.558 | 0,09 |
| Summe Mongolei | | | 36.527 | 1,21 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Dufry One BV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 15.02.2027 | € | 5.700 | 4.488 | 0,15 |
| **Mong Duong Finance Holdings BV** | | | | |
| 5,125 % fällig am 07.05.2029 | $ | 29.419 | 23.793 | 0,78 |
| **Prosus NV** | | | | |
| 3,832 % fällig am 08.02.2051 | | 3.900 | 2.356 | 0,08 |
| 4,193 % fällig am 19.01.2032 | | 15.600 | 12.471 | 0,41 |
| 4,987 % fällig am 19.01.2052 | | 4.200 | 3.022 | 0,10 |
| Summe Niederlande | | | 46.130 | 1,52 |
| **OMAN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Oman Government International Bond** | | | | |
| 7,000 % fällig am 25.01.2051 | | 5.000 | 4.422 | 0,15 |
| **PAKISTAN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Pakistan Government International Bond** | | | | |
| 6,000 % fällig am 08.04.2026 | | 63.421 | 43.118 | 1,42 |
| 6,875 % fällig am 05.12.2027 | | 30.657 | 20.919 | 0,69 |
| 7,375 % fällig am 08.04.2031 | | 18.400 | 11.698 | 0,38 |
| 8,250 % fällig am 15.04.2024 | | 6.500 | 5.083 | 0,17 |
| 8,250 % fällig am 30.09.2025 | | 6.635 | 4.792 | 0,16 |
| 8,875 % fällig am 08.04.2051 | | 17.600 | 10.576 | 0,35 |
| Summe Pakistan | | | 96.186 | 3,17 |
| **PHILIPPINEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ACEN Finance Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 08.03.2025 (c) | | 15.900 | 13.436 | 0,44 |
| **Development Bank of the Philippines** | | | | |
| 2,375 % fällig am 11.03.2031 | | 9.652 | 7.600 | 0,25 |
| **Globe Telecom, Inc.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 23.07.2035 | | 15.850 | 11.608 | 0,38 |
| 4,200 % fällig am 02.08.2026 (c) | | 22.900 | 21.590 | 0,71 |
| **JGSH Philippines Ltd.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 09.07.2030 | | 6.230 | 5.747 | 0,19 |
| **Jollibee Worldwide Pte. Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 24.06.2030 | | 3.300 | 3.135 | 0,10 |
| **Royal Capital BV** | | | | |
| 4,875 % fällig am 05.05.2024 (c) | | 3.571 | 3.531 | 0,12 |
| 5,000 % fällig am 05.02.2026 (c) | | 900 | 885 | 0,03 |
| **SMC Global Power Holdings Corp.** | | | | |
| 5,450 % fällig am 09.12.2026 (c) | | 9.875 | 9.147 | 0,30 |
| 5,950 % fällig am 05.05.2025 (c) | | 9.000 | 8.595 | 0,29 |
| 7,000 % fällig am 21.10.2025 (c) | | 19.034 | 18.796 | 0,62 |
| Summe Philippinen | | | 104.070 | 3,43 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ABJA Investment Co. Pte. Ltd.** | | | | |
| 5,450 % fällig am 24.01.2028 | | 10.800 | 10.246 | 0,34 |
| **Indika Energy Capital Pte. Ltd.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 22.10.2025 | | 29.300 | 28.399 | 0,94 |
| **LMIRT Capital Pte. Ltd.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 19.06.2024 | | 11.300 | 10.113 | 0,33 |
| 7,500 % fällig am 09.02.2026 | | 8.500 | 7.267 | 0,24 |
| **Medco Bell Pte. Ltd.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 30.01.2027 | | 26.600 | 22.790 | 0,75 |
| **Medco Platinum Road Pte. Ltd.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 30.01.2025 | | 6.000 | 5.580 | 0,19 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.** | | | |
| 4,602 % fällig am 15.06.2032 (e) $ | 1.300 | $ 1.291 | 0,04 |
| **Singapore Airlines Ltd.** | | | |
| 3,375 % fällig am 19.01.2029 | 33.300 | 30.332 | 1,00 |
| **TML Holdings Pte. Ltd.** | | | |
| 4,350 % fällig am 09.06.2026 | 9.600 | 8.472 | 0,28 |
| 5,500 % fällig am 03.06.2024 | 9.100 | 8.816 | 0,29 |
| Summe Singapur | | 133.306 | 4,40 |
| **SÜDAFRIKA** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Sasol Financing USA LLC** | | | |
| 6,500 % fällig am 27.09.2028 | 2.000 | 1. | 0,06 |
| **SÜDKOREA** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Kyobo Life Insurance Co. Ltd.** | | | |
| 5,900 % fällig am 15.06.2027 (c) | 7.000 | 6.995 | 0,23 |
| **Tongyang Life Insurance Co. Ltd.** | | | |
| 5,250 % fällig am 22.09.2025 (c) | 4.200 | 4.011 | 0,13 |
| Summe Südkorea | | 11.006 | 0,36 |
| **SRI LANKA** | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Sri Lanka Government International Bond** | | | |
| 5,750 % fällig am 18.04.2023 ^ | 13.312 | 4.320 | 0,14 |
| 6,200 % fällig am 11.05.2027 ^ | 22.500 | 7.320 | 0,24 |
| 6,750 % fällig am 18.04.2028 ^ | 7.000 | 2.259 | 0,08 |
| 6,825 % fällig am 18.07.2026 ^ | 4.500 | 1.562 | 0,05 |
| 6,850 % fällig am 14.03.2024 ^ | 61.971 | 20.158 | 0,67 |
| 6,850 % fällig am 03.11.2025 ^ | 38.800 | 12.796 | 0,42 |
| 7,550 % fällig am 28.03.2030 ^ | 8.350 | 2.704 | 0,09 |
| 7,850 % fällig am 14.03.2029 ^ | 3.600 | 1.182 | 0,04 |
| Summe Sri Lanka | | 52.301 | 1,73 |
| **THAILAND** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Bangkok Bank PCL** | | | |
| 5,000 % fällig am 23.09.2025 (c)(e) | 3.000 | 2.762 | 0,09 |
| **Kasikornbank PCL** | | | |
| 3,343 % fällig am 02.10.2031 (e) | 15.844 | 14.275 | 0,47 |
| 4,000 % fällig am 10.02.2027 (c)(e) | 11.500 | 9.659 | 0,32 |
| 5,275 % fällig am 14.10.2025 (c)(e) | 28.300 | 26.284 | 0,87 |
| **Krung Thai Bank PCL** | | | |
| 4,400 % fällig am 25.03.2026 (c)(e) | 18.800 | 16.450 | 0,54 |
| **Muang Thai Life Assurance PCL** | | | |
| 3,552 % fällig am 27.01.2037 (e) | 23.300 | 20.940 | 0,69 |
| Summe Thailand | | 90.370 | 2,98 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **GROSSBRITANNIEN** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **HSBC Holdings PLC** | | | |
| 6,000 % fällig am 22.05.2027 (c)(e) | 12.700 | 11.414 | 0,37 |
| **Jaguar Land Rover Automotive PLC** | | | |
| 2,200 % fällig am 15.01.2024 € | 2.800 | $ 2.656 | 0,09 |
| 4,500 % fällig am 01.10.2027 $ | 1.900 | 1.427 | 0,05 |
| 5,875 % fällig am 15.11.2024 € | 5.000 | 4.821 | 0,16 |
| **NatWest Group PLC** | | | |
| 4,600 % fällig am 28.06.2031 (c)(e) $ | 3.000 | 2.216 | 0,07 |
| 8,000 % fällig am 10.08.2025 (c)(e) | 5.800 | 5.753 | 0,19 |
| **Standard Chartered PLC** | | | |
| 6,000 % fällig am 26.07.2025 (c)(e) | 7.900 | 7.501 | 0,25 |
| **Vedanta Resources Finance PLC** | | | |
| 8,950 % fällig am 11.03.2025 | 70.292 | 55.739 | 1,84 |
| 13,875 % fällig am 21.01.2024 | 3.500 | 3.125 | 0,10 |
| Summe Großbritannien | | 94.652 | 3,12 |
| **USA** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Stillwater Mining Co.** | | | |
| 4,000 % fällig am 16.11.2026 | 2.500 | 2.089 | 0,07 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | |
| 1,875 % fällig am 15.11.2051 | 2.700 | 2.027 | 0,07 |
| Summe USA | | 4.116 | 0,14 |
| **VIETNAM** | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Vietnam Debt & Asset Trading Corp.** | | | |
| 1,000 % fällig am 10.10.2025 | 6.290 | 5.558 | 0,18 |
| **JUNGFERNINSELN (BRITISCH)** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **1MDB Global Investments Ltd.** | | | |
| 4,400 % fällig am 09.03.2023 | 84.300 | 81.759 | 2,70 |
| **Celestial Miles Ltd.** | | | |
| 5,750 % fällig am 31.01.2024 (c) | 19.554 | 19.622 | 0,65 |
| **Champion Path Holdings Ltd.** | | | |
| 4,500 % fällig am 27.01.2026 | 14.289 | 9.074 | 0,30 |
| 4,850 % fällig am 27.01.2028 | 15.100 | 8.874 | 0,29 |
| **NWD Finance BVI Ltd.** | | | |
| 4,125 % fällig am 10.03.2028 (c) | 11.200 | 9.520 | 0,31 |
| 4,800 % fällig am 09.09.2023 (c) | 17.000 | 12.929 | 0,43 |
| 5,250 % fällig am 22.03.2026 (c) | 38.700 | 36.765 | 1,21 |
| 6,150 % fällig am 16.03.2025 (c) | 58.900 | 58.458 | 1,93 |
| **Peak RE BVI Holding Ltd.** | | | |
| 5,350 % fällig am 28.10.2025 (c) | 7.670 | 6.059 | 0,20 |
| **RKPF Overseas Ltd.** | | | |
| 5,125 % fällig am 26.07.2026 | 13.150 | 6.224 | 0,21 |
| 5,200 % fällig am 12.01.2026 | 23.100 | 11.044 | 0,36 |
| 5,900 % fällig am 05.03.2025 | 11.300 | 5.573 | 0,18 |
| 6,000 % fällig am 04.09.2025 | 11.006 | 5.474 | 0,18 |
| 6,700 % fällig am 30.09.2024 | 3.096 | 1.722 | 0,06 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Scenery Journey Ltd.** | | | |
| 11,500 % fällig am 24.10.2022 ^ | 400 | 26 | 0,00 |
| **Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.** | | | |
| 6,750 % fällig am 24.04.2033 | 4.961 | 4.678 | 0,15 |
| **Studio City Co. Ltd.** | | | |
| 7,000 % fällig am 15.02.2027 $ | 7.500 | $ 6.512 | 0,21 |
| **Studio City Finance Ltd.** | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2029 | 19.200 | 9.943 | 0,33 |
| 6,000 % fällig am 15.07.2025 | 19.282 | 12.239 | 0,40 |
| 6,500 % fällig am 15.01.2028 | 15.069 | 8.472 | 0,28 |
| **Wanda Properties International Co. Ltd.** | | | |
| 7,250 % fällig am 29.01.2024 | 3.100 | 2.315 | 0,08 |
| **Wanda Properties Overseas Ltd.** | | | |
| 6,875 % fällig am 23.07.2023 | 1.000 | 800 | 0,03 |
| 6,950 % fällig am 05.12.2022 | 4.000 | 3.592 | 0,12 |
| Summe Jungferninseln (Britisch) | | 321.674 | 10,61 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | |
| **Future Diamond Ltd.** | | | |
| 16,937 % fällig am 22.09.2022 | 1.150 | 1.075 | 0,04 |
| **Yango Justice International Ltd.** | | | |
| 326,426 % fällig am 15.09.2022 ^ | 4.500 | 360 | 0,01 |
| | | 1.435 | 0,05 |
| **SINGAPORE TREASURY BILLS** | | | |
| 1,312 % fällig am 22.07.2022 (a)(b) SGD | 32.800 | 23.544 | 0,77 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 24.979 | 0,82 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | **$ 2.550.223** | **84,13** |
| | **AKTIEN** | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)** | 15.611.133 | 155.299 | 5,12 |
| **PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (d)** | 744.048 | 10.119 | 0,34 |
| | | 165.418 | 5,46 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (d)** | 48.700 | 4.819 | 0,16 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$ 170.237** | **5,62** |

**PENSIONSGESCHÄFTE**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SSB | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 79.920 | U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026 | $ (81.519) | $ 79.920 | $ 79.920 | 2,64 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (81.519)** | **$ 79.920** | **$ 79.920** | **2,64** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

### FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09.2022 | 187 | $ 148 | 0,01 |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 20 | 85 | 0,00 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 19 | 140 | 0,01 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 927 | (366) | (0,01) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 1.157 | (1.104) | (0,04) |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2022 | 18 | 22 | 0,00 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 80 | 122 | 0,00 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2022 | 37 | 103 | 0,00 |
| | | | | $ (850) | (0,03) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ (850)** | **(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 | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Boeing Co. | 1,000 % | 20.06.2023 | $ 700 | $ (6) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.12.2023 | 100 | (2) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.06.2026 | 300 | (12) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.12.2026 | 1.900 | (100) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.06.2027 | 100 | (4) | 0,00 |
| Jaguar Land Rover Automotive PLC | 5,000 | 20.06.2026 | € 2.800 | (586) | (0,02) |
| | | | | $ (710) | (0,02) |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Asia Ex-Japan 37 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2027 | $ 206.400 | $ (2.749) | (0,09) |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 % | 15.06.2027 | $ 30.000 | $ (1.841) | (0,06) |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,250 | 15.06.2032 | 33.200 | 3.366 | 0,11 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,300 | 21.12.2022 | 116.000 | 239 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,500 | 15.12.2031 | 10.100 | 1.193 | 0,04 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2024 | 114.000 | (380) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.12.2051 | 18.200 | 2.049 | 0,07 |
| Erhalt | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,500 | 16.03.2027 | CNY 271.400 | 258 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,750 | 16.06.2031 | $ 19.400 | 2.008 | 0,06 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 15.12.2026 | 37.550 | 2.889 | 0,09 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2027 | € 4.200 | 207 | 0,01 |
| | | | | | $ 9.988 | 0,33 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 6.529** | **0,22** |

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

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

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

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

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

### 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) % | 20.06.2027 | $ 50.000 | $ (466) | $ 126 | $ (340) | (0,01) |
| JPM | China Government International Bond | (1,000) | 20.06.2027 | 50.000 | (477) | 137 | (340) | (0,01) |
| | | | | | $ (943) | $ 263 | $ (680) | (0,02) |

### 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 | Longfor Group Holdings Ltd. | 1,000 % | 20.06.2026 | $ 9.500 | $ (155) | $ (780) | $ (935) | (0,03) |
| BRC | Baidu, Inc. | 1,000 | 20.06.2026 | 10.400 | 131 | (151) | (20) | 0,00 |
| | BOC Aviation Ltd. | 1,000 | 20.06.2026 | 24.300 | (70) | (20) | (90) | (0,01) |
| | State Bank of India | 1,000 | 20.06.2026 | 7.000 | 19 | (27) | (8) | 0,00 |
| | Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. | 1,000 | 20.06.2026 | 10.400 | 13 | (654) | (641) | (0,02) |
| GST | Vietnam Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 20.100 | (142) | (386) | (528) | (0,02) |
| | | | | | $ (204) | $ (2.018) | $ (2.222) | (0,08) |

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

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

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

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | HKD | 116.602 | $ | 14.879 | $ 9 | $ 0 | $ 9 | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 7.430 | | 7.857 | 70 | (4) | 66 | 0,00 |
| | 08.2022 | £ | 929 | | 1.144 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 109.400 | | 850 | 42 | 0 | 42 | 0,00 |
| | 08.2022 | SGD | 100 | | 72 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 43.500 | CNH | 289.479 | 0 | (342) | (342) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 6.172 | € | 5.855 | 1 | (34) | (33) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.127 | £ | 903 | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| | 01.2023 | CNH | 714.240 | $ | 110.683 | 4.088 | 0 | 4.088 | 0,14 |
| | 02.2023 | $ | 110.572 | CNH | 714.240 | 0 | (3.936) | (3.936) | (0,13) |
| BPS | 08.2022 | CNH | 714.240 | $ | 107.234 | 749 | 0 | 749 | 0,02 |
| | 08.2022 | € | 451 | | 477 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 1.031.737 | | 70 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 41 | INR | 3.198 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 0 | THB | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 25.942 | MYR | 108.969 | 0 | (1.235) | (1.235) | (0,04) |
| | 01.2023 | | 109.226 | CNH | 714.240 | 0 | (2.631) | (2.631) | (0,09) |
| BRC | 08.2022 | IDR | 1.135.157 | $ | 77 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | NZD | 321 | | 204 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| CBK | 08.2022 | AUD | 20 | | 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 24.082 | AUD | 34.176 | 0 | (573) | (573) | (0,02) |
| DUB | 08.2022 | AUD | 8.000 | $ | 5.784 | 281 | 0 | 281 | 0,01 |
| | 08.2022 | € | 79.508 | | 84.426 | 1.064 | 0 | 1.064 | 0,04 |
| | 08.2022 | ¥ | 767.312 | | 5.899 | 236 | 0 | 236 | 0,01 |
| | 08.2022 | THB | 317 | | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | SGD | 32.701 | | 23.804 | 306 | 0 | 306 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 63.794 | CNH | 424.761 | 0 | (467) | (467) | (0,02) |
| IND | 08.2022 | CNH | 70 | $ | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 08.2022 | | 57.541 | | 8.557 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 756.565 | | 51 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | PHP | 503.635 | | 9.487 | 349 | 0 | 349 | 0,01 |
| | 08.2022 | SGD | 241 | | 175 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 06.2023 | $ | 13.757 | VND | 330.164.544 | 260 | 0 | 260 | 0,01 |
| MBC | 08.2022 | CNH | 130.887 | $ | 19.492 | 0 | (23) | (23) | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 332.813 | | 23 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09.2022 | HKD | 18.264 | | 2.332 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 05.2023 | CNH | 118.013 | | 17.585 | 0 | (49) | (49) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | € | 4.365 | | 4.580 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 2 | | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 133 | £ | 110 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2022 | | 112 | SGD | 156 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08.2022 | CNY | 23.746 | $ | 3.537 | $ 0 | $ (3) | $ (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 1.269 | | 1.342 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 1.277.006 | | 87 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | THB | 774 | | 22 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 2.070 | € | 1.947 | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 69 | INR | 5.372 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 6 | KRW | 8.212 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 1 | SGD | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 232.177 | $ | 34.659 | 44 | 0 | 44 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNY | 38.010 | | 5.679 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 1.427 | | 1.507 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 15.801 | PHP | 865.421 | 0 | (99) | (99) | 0,00 |
| | 09.2022 | MYR | 110.152 | $ | 25.362 | 423 | (36) | 387 | 0,01 |
| UAG | 08.2022 | PHP | 1.125.088 | | 21.446 | 1.032 | 0 | 1.032 | 0,03 |
| | 09.2022 | HKD | 60 | | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02.2023 | CNH | 714.240 | | 111.084 | 4.448 | 0 | 4.448 | 0,15 |
| | | | | | | $ 13.486 | $ (9.514) | $ 3.972 | 0,13 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) ausschüttend und Investor AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | AUD | 43.091 | $ | 29.957 | $ 325 | $ 0 | $ 325 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 5 | AUD | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 29.965 | | 43.091 | 0 | (327) | (327) | (0,01) |
| BOA | 07.2022 | AUD | 50.615 | $ | 35.143 | 338 | 0 | 338 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 53.167 | AUD | 73.846 | 0 | (2.387) | (2.387) | (0,08) |
| | 08.2022 | AUD | 268 | $ | 185 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 35.152 | AUD | 50.615 | 0 | (339) | (339) | (0,01) |
| MBC | 07.2022 | AUD | 12.330 | $ | 8.722 | 244 | 0 | 244 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 52.730 | AUD | 73.377 | 0 | (2.272) | (2.272) | (0,08) |
| SCX | 07.2022 | AUD | 44.706 | $ | 30.743 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 30.751 | AUD | 44.706 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | | 49.466 | | 69.252 | 0 | (1.845) | (1.845) | (0,06) |
| | | | | | | $ 909 | $ (7.173) | $ (6.264) | (0,21) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | CHF | 37 | $ | 39 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 3.369 | CHF | 3.221 | 1 | (6) | (5) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CHF | 53 | $ | 54 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 8 | CHF | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | | 3.335 | | 3.192 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | CHF | 9 | $ | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 3 | CHF | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | CHF | 487 | $ | 509 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 3.339 | CHF | 3.195 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | CHF | 175 | $ | 183 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 2 | $ (11) | $ (9) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | € | 10.987 | $ | 11.623 | $ 136 | $ 0 | $ 136 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | | 201.882 | | 212.335 | 1.277 | 0 | 1.277 | 0,04 |
| | 07.2022 | $ | 2.417 | € | 2.296 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 204.580 | | 194.150 | 0 | (1.230) | (1.230) | (0,04) |
| CBK | 07.2022 | € | 37.652 | $ | 40.317 | 955 | 0 | 955 | 0,03 |
| MBC | 07.2022 | | 201.420 | | 211.944 | 1.370 | 0 | 1.370 | 0,05 |
| | 07.2022 | $ | 229.593 | € | 212.909 | 1 | (7.009) | (7.008) | (0,23) |
| | 08.2022 | | 204.618 | | 194.150 | 0 | (1.268) | (1.268) | (0,04) |
| SCX | 07.2022 | | 216.630 | | 202.230 | 0 | (5.209) | (5.209) | (0,17) |
| UAG | 07.2022 | | 230.593 | | 214.585 | 0 | (6.255) | (6.255) | (0,21) |
| | | | | | | $ 3.739 | $ (20.987) | $ (17.248) | (0,57) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | £ 1.853 | $ 2.299 | $ 49 | $ 0 | $ 49 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 17.296 | £ 13.679 | 0 | (683) | (683) | (0,02) |
| BRC | 07.2022 | £ 755 | $ 925 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 17.383 | £ 13.782 | 0 | (645) | (645) | (0,02) |
| CBK | 07.2022 | 17 | 13 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | £ 2.616 | $ 3.190 | 19 | (7) | 12 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 316 | £ 260 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | £ 113 | $ 138 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 17.252 | £ 13.698 | 0 | (616) | (616) | (0,02) |
| | | | | $ 77 | $ (1.953) | $ (1.876) | (0,06) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional RMB (Hedged) ausschüttend und Investor 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | CNH 200 | $ 30 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | $ 948 | CNH 6.334 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CNH 171 | $ 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 956 | CNH 6.383 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08.2022 | 858 | 5.752 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | 910 | 6.079 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH 64 | $ 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | 709 | 106 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 0 | $ (11) | $ (11) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend, E Class SGD (Hedged) ausschüttend und M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | SGD 5.069 | $ 3.647 | $ 5 | $ 0 | $ 5 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 9.133 | SGD 12.513 | 0 | (142) | (142) | 0,00 |
| | 08.2022 | 3.647 | 5.069 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | SGD 10.166 | $ 7.317 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 7.317 | SGD 10.166 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | SGD 1.242 | $ 897 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 203 | SGD 278 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | SGD 522 | $ 377 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | 1.190 | 867 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | $ 8.621 | SGD 11.782 | 0 | (155) | (155) | (0,01) |
| UAG | 07.2022 | SGD 559 | $ 402 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 8.938 | SGD 12.238 | 0 | (144) | (144) | 0,00 |
| | | | | $ 37 | $ (461) | $ (424) | (0,01) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (24.762)** | **(0,82)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 2.781.297** | **91,76** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ 249.829** | **8,24** |
| **Nettovermögen** | **$ 3.031.126** | **100,00** |

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

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

**^** **Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a)** **Nullkuponwertpapier.**

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

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

**(d)** **Mit dem Fonds verbunden.**

**(e)** **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(f)** **Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeits-datum | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Flourish Century | 6,600 % | 04.02.2049 | 25.08.2021 - 27.08.2021 | $ 10.747 | $ 1.200 | 0,04 |

**(g)** **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 2.396 und Barmittel in Höhe von USD 2.949 als Sicherheiten verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von USD 33.247 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 25.214 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 2.549.023 | $ 1.200 | $ 2.550.223 |
| Investmentfonds | 165.418 | 4.819 | 0 | 170.237 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 79.920 | 0 | 79.920 |
| Finanzderivate[3] | 373 | (19.456) | 0 | (19.083) |
| **Summen** | **$ 165.791** | **$ 2.614.306** | **$ 1.200** | **$ 2.781.297** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 2.901.911 | $ 0 | $ 2.901.911 |
| Investmentfonds | 330.471 | 0 | 0 | 330.471 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 178.712 | 0 | 178.712 |
| Finanzderivate[3] | 323 | 13.276 | 30 | 13.629 |
| **Summen** | **$ 330.794** | **$ 3.093.899** | **$ 30** | **$ 3.424.723** |

(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 2022:**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | (4,000) % | 28.06.2022 | TBD[1] | $ (237) | $ (237) | (0,01) |
| | (1,000) | 31.05.2022 | TBD[1] | (1.313) | (1.312) | (0,04) |
| BRC | (1,750) | 30.11.2021 | TBD[1] | (4.008) | (3.961) | (0,13) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (5.510)** | **(0,18)** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ (2) | $ 0 | $ (2) |
| BOA | (3.156) | 3.150 | (6) |
| BPS | (4.362) | 4.322 | (40) |
| BRC | (1.394) | 1.442 | 48 |
| CBK | 380 | (310) | 70 |
| DUB | 1.581 | (1.410) | 171 |
| GLM | (160) | 230 | 70 |
| GST | (528) | 260 | (268) |
| JPM | 250 | 100 | 350 |
| MBC | (9.001) | 8.340 | (661) |
| MYI | 22 | 0 | 22 |
| SCX | (5.013) | 4.570 | (443) |
| UAG | (3.379) | 2.800 | (579) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 61,41 | 62,61 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 22,50 | 22,44 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 0,22 | k. A. |
| Investmentfonds | 5,62 | 9,69 |
| Pensionsgeschäfte | 2,64 | 5,24 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,03 ) | 0,02 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,22 | 0,07 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (0,82 ) | 0,31 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (0,18 ) | (1,43 ) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Australien | 1,44 | 0,59 |
| Brasilien | 0,15 | 0,54 |
| Cayman-Inseln | 19,10 | 24,32 |
| China | 3,17 | 6,86 |
| Ägypten | k. A. | 0,32 |
| Frankreich | 0,21 | 0,10 |
| Deutschland | 0,32 | 0,43 |
| Hongkong | 5,52 | 5,27 |
| Indien | 8,10 | 6,84 |
| Indonesien | 3,65 | 4,06 |
| Israel | 0,08 | 0,12 |
| Italien | 0,27 | 0,37 |
| Japan | 0,21 | 0,53 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,51 | 0,21 |
| Luxemburg | 0,13 | 0,42 |
| Malaysia | 0,88 | 0,81 |
| Mauritius | 6,16 | 3,62 |
| Mexiko | 0,35 | 0,41 |
| Mongolei | 1,21 | 1,23 |
| Marokko | k. A. | 0,18 |
| Niederlande | 1,52 | 0,56 |
| Oman | 0,15 | 0,39 |
| Pakistan | 3,17 | 3,35 |
| Philippinen | 3,43 | 2,52 |
| Singapur | 4,40 | 3,59 |
| Südafrika | 0,06 | 0,35 |
| Südkorea | 0,36 | 0,13 |
| Spanien | k. A. | 0,24 |
| Sri Lanka | 1,73 | 2,17 |
| Schweden | k. A. | 0,01 |
| Thailand | 2,98 | 2,07 |
| Großbritannien | 3,12 | 3,78 |
| USA | 0,14 | 0,50 |
| Vietnam | 0,18 | 0,17 |
| Jungferninseln (Britisch) | 10,61 | 7,05 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,82 | 0,94 |
| Investmentfonds | 5,62 | 9,69 |
| Pensionsgeschäfte | 2,64 | 5,24 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,03 ) | 0,02 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,02 ) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,09 ) | 0,03 |
| Zinsswaps | 0,33 | 0,04 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf | (0,02 ) | k. A. |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,08 ) | (0,01 ) |
| Zinsswaps | k. A. | 0,01 |
| Total Return Swaps auf Wertpapiere | k. A. | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | 0,13 | 0,03 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (0,85 ) | 0,28 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 8,24 | (0,38 ) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PAR (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Emeco Pty. Ltd.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 10.07.2026 | AUD | 1.300 | $ 851 | 0,27 |
| **Mineral Resources Ltd.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.11.2027 | $ | 1.000 | 977 | 0,31 |
| 8,125 % fällig am 01.05.2027 | | 1.105 | 1.078 | 0,35 |
| **Pacific National Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 22.03.2028 | | 1.700 | 1.627 | 0,52 |
| **Santos Finance Ltd.** | | | | |
| 3,649 % fällig am 29.04.2031 | | 600 | 510 | 0,16 |
| 5,250 % fällig am 13.03.2029 | | 400 | 386 | 0,13 |
| Summe Australien | | | 5.429 | 1,74 |
| **BAHAMAS** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Competition Team Technologies Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 12.03.2029 | | 700 | 689 | 0,22 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **CSN Resources S.A.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 10.06.2031 | | 400 | 285 | 0,09 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **WANDELANLEIHEN & WECHSEL** | | | | |
| **Cathay Pacific Finance Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 05.02.2026 | HKD | 12.000 | 1.658 | 0,53 |
| **Hansoh Pharmaceutical Group Co. Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 22.01.2026 (a) | $ | 900 | 815 | 0,26 |
| **Meituan** | | | | |
| 0,000 % fällig am 27.04.2027 (a) | | 400 | 353 | 0,11 |
| 0,000 % fällig am 27.04.2028 (a) | | 500 | 421 | 0,14 |
| **Vnet Group, Inc.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.02.2026 (a) | | 1.400 | 1.153 | 0,37 |
| | | | 4.400 | 1,41 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AAC Technologies Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 02.06.2026 | | 400 | 344 | 0,11 |
| 3,000 % fällig am 27.11.2024 | | 1.700 | 1.590 | 0,51 |
| 3,750 % fällig am 02.06.2031 | | 800 | 613 | 0,20 |
| **Agile Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 31.07.2024 (b) | | 1.600 | 348 | 0,11 |
| 8,375 % fällig am 04.12.2023 (b) | | 700 | 163 | 0,05 |
| **Alibaba Group Holding Ltd.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 09.02.2031 | | 1.000 | 828 | 0,26 |
| 2,700 % fällig am 09.02.2041 | | 1.100 | 758 | 0,24 |
| **Baidu, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 29.03.2028 | | 1.000 | 985 | 0,32 |
| **Central China Real Estate Ltd.** | | | | |
| 7,650 % fällig am 27.08.2023 | | 250 | 111 | 0,04 |
| **China Evergrande Group** | | | | |
| 7,500 % fällig am 28.06.2023 ^ | | 1.800 | 148 | 0,05 |
| 8,750 % fällig am 28.06.2025 ^ | | 400 | 33 | 0,01 |
| 10,000 % fällig am 11.04.2023 ^ | | 500 | 42 | 0,01 |
| **China Hongqiao Group Ltd.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 08.06.2024 | | 1.400 | 1.304 | 0,42 |
| **China Modern Dairy Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 14.07.2026 | | 2.400 | 2.092 | 0,67 |
| **China SCE Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 29.09.2024 | | 600 | 184 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 04.02.2026 | | 200 | 55 | 0,02 |
| 7,000 % fällig am 02.05.2025 | | 600 | 178 | 0,06 |
| **CIFI Holdings Group Co. Ltd.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 12.04.2027 | | 300 | 163 | 0,05 |
| 4,450 % fällig am 17.08.2026 | | 2.500 | 1.423 | 0,46 |
| 4,800 % fällig am 17.05.2028 | | 700 | 381 | 0,12 |
| 5,250 % fällig am 13.05.2026 | | 500 | 284 | 0,09 |
| 5,950 % fällig am 20.10.2025 | | 300 | 177 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 16.07.2025 | | 600 | 362 | 0,12 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | | |
| 6,150 % fällig am 17.09.2025 | | 1.700 | 919 | 0,29 |
| 7,250 % fällig am 08.04.2026 | | 1.600 | 877 | 0,28 |
| **eHi Car Services Ltd.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 21.09.2026 | $ | 1.200 | $ 722 | 0,23 |
| 7,750 % fällig am 14.11.2024 | | 800 | 524 | 0,17 |
| **Geely Automobile Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 25.01.2023 | | 3.240 | 3.238 | 1,04 |
| 4,000 % fällig am 09.12.2024 (b) | | 700 | 664 | 0,21 |
| **Goodman HK Finance** | | | | |
| 3,000 % fällig am 22.07.2030 | | 700 | 623 | 0,20 |
| **Greentown China Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,700 % fällig am 29.04.2025 | | 1.200 | 960 | 0,31 |
| **Health & Happiness H&H International Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 24.10.2024 | | 2.100 | 1.837 | 0,59 |
| **Kaisa Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 9,375 % fällig am 30.06.2024 ^ | | 800 | 112 | 0,04 |
| 9,750 % fällig am 28.09.2023 ^ | | 200 | 28 | 0,01 |
| 10,500 % fällig am 15.01.2025 ^ | | 2.100 | 289 | 0,09 |
| 11,250 % fällig am 09.04.2022 ^ | | 500 | 70 | 0,02 |
| 11,950 % fällig am 22.10.2022 ^ | | 300 | 42 | 0,01 |
| 11,950 % fällig am 12.11.2023 ^ | | 1.200 | 167 | 0,05 |
| **KWG Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 10.11.2024 | | 1.300 | 261 | 0,08 |
| 5,950 % fällig am 10.08.2025 | | 600 | 122 | 0,04 |
| 6,300 % fällig am 13.02.2026 | | 1.100 | 220 | 0,07 |
| **Melco Resorts Finance Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 06.06.2025 | | 1.100 | 824 | 0,26 |
| 5,250 % fällig am 26.04.2026 | | 1.700 | 1.201 | 0,38 |
| **MGM China Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.02.2027 | | 1.000 | 708 | 0,23 |
| 5,250 % fällig am 18.06.2025 | | 200 | 154 | 0,05 |
| 5,375 % fällig am 15.05.2024 | | 500 | 427 | 0,14 |
| **New Metro Global Ltd.** | | | | |
| 6,800 % fällig am 05.08.2023 | | 200 | 137 | 0,04 |
| **Powerlong Real Estate Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 30.04.2025 | | 400 | 64 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 10.08.2024 (f) | | 1.000 | 175 | 0,06 |
| **Redsun Properties Group Ltd.** | | | | |
| 7,300 % fällig am 13.01.2025 | | 600 | 84 | 0,03 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 2,550 % fällig am 08.03.2027 | | 1.700 | 1.241 | 0,40 |
| **Seazen Group Ltd.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 13.07.2025 | | 600 | 352 | 0,11 |
| 6,000 % fällig am 12.08.2024 | | 500 | 300 | 0,10 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 26.04.2024 ^ | | 300 | 46 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 10.01.2025 ^ | | 200 | 30 | 0,01 |
| 6,650 % fällig am 03.08.2024 ^ | | 3.000 | 443 | 0,14 |
| 6,800 % fällig am 20.10.2024 ^ | | 800 | 118 | 0,04 |
| 7,950 % fällig am 11.10.2023 ^ | | 500 | 76 | 0,02 |
| 8,350 % fällig am 19.04.2023 ^ | | 800 | 122 | 0,04 |
| **Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 23.01.2023 | | 3.600 | 3.603 | 1,15 |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,240 % fällig am 03.06.2050 | | 1.100 | 761 | 0,24 |
| 3,595 % fällig am 19.01.2028 | | 3.100 | 2.947 | 0,94 |
| 3,975 % fällig am 11.04.2029 | | 500 | 474 | 0,15 |
| **Times China Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,550 % fällig am 04.06.2024 | | 1.900 | 320 | 0,10 |
| **VLL International, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 28.11.2024 | | 200 | 194 | 0,06 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.10.2024 | | 200 | 149 | 0,05 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2026 | | 2.700 | 1.874 | 0,60 |
| 5,500 % fällig am 01.10.2027 | | 400 | 259 | 0,08 |
| 5,625 % fällig am 26.08.2028 | | 300 | 186 | 0,06 |
| **Zhongsheng Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 13.01.2026 | | 3.450 | 3.217 | 1,03 |
| | | | 44.727 | 14,31 |
| Summe Cayman Inseln | | | 49.127 | 15,72 |
| **CHINA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **CFLD Cayman Investment Ltd.** | | | | |
| 6,920 % fällig am 16.06.2022 ^ | | 500 | 49 | 0,02 |
| **Chalco Hong Kong Investment Co. Ltd.** | | | | |
| 1,550 % fällig am 28.07.2024 | | 1.740 | 1.658 | 0,53 |
| **China Construction Bank Corp.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 21.01.2032 (d) | | 1.000 | 936 | 0,30 |
| **China Huaneng Group Hong Kong Treasury Management Holding Ltd.** | | | | |
| 3,080 % fällig am 09.12.2025 (b) | $ | 1.000 | $ 952 | 0,30 |
| **CNAC HK Finbridge Co. Ltd.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 19.06.2029 | | 3.200 | 2.988 | 0,96 |
| **Dianjian Haiyu Ltd.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 20.06.2024 (b) | | 200 | 200 | 0,06 |
| **Flourish Century** | | | | |
| 6,600 % fällig am 04.02.2049 ^(e) | | 1.700 | 187 | 0,06 |
| **Greenland Global Investment Ltd.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 22.01.2025 | | 1.600 | 440 | 0,14 |
| **Huarong Universe Investment Holding Ltd.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 05.12.2022 | € | 1.200 | 1.211 | 0,39 |
| **Industrial & Commercial Bank of China Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 21.09.2025 (d) | $ | 1.800 | 1.850 | 0,59 |
| **Midea Investment Development Co. Ltd.** | | | | |
| 2,880 % fällig am 24.02.2027 | | 1.500 | 1.414 | 0,45 |
| **New Metro Global Ltd.** | | | | |
| 4,800 % fällig am 15.12.2024 | | 700 | 385 | 0,12 |
| **Overseas Chinese Town Asia Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.07.2023 (b) | | 600 | 596 | 0,19 |
| **SF Holding Investment Ltd.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 17.11.2026 | | 1.200 | 1.109 | 0,36 |
| **Sinopec Group Overseas Development Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 12.09.2028 | | 2.300 | 2.339 | 0,75 |
| **SPIC MTN Co. Ltd.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 27.07.2025 | | 1.700 | 1.592 | 0,51 |
| **Wanda Group Overseas Ltd.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 24.07.2022 | | 900 | 885 | 0,28 |
| **Yango Group Co. Ltd.** | | | | |
| 6,900 % fällig am 31.10.2022 ^ | CNY | 20.000 | 819 | 0,26 |
| **Yango Justice International Ltd.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 04.09.2024 ^ | $ | 700 | 61 | 0,02 |
| **Yunda Holding Investment Ltd.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 19.08.2025 | | 1.500 | 1.364 | 0,44 |
| **ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 16.07.2025 | | 2.900 | 2.655 | 0,85 |
| **Zoomlion HK SPV Co. Ltd.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 20.12.2022 | | 400 | 400 | 0,13 |
| Summe China | | | 24.090 | 7,71 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BMW Finance NV** | | | | |
| 3,440 % fällig am 15.06.2024 | CNY | 7.000 | 1.055 | 0,34 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 4,500 % fällig am 30.11.2026 (b)(d) | € | 1.200 | 981 | 0,31 |
| Summe Deutschland | | | 2.036 | 0,65 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **WANDELANLEIHEN & WECHSEL** | | | | |
| **Universe Trek Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.06.2026 (a) | $ | 200 | 183 | 0,06 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bank of East Asia Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 22.04.2032 (d) | | 1.700 | 1.663 | 0,53 |
| **China Cinda Finance Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 08.02.2028 | | 1.000 | 986 | 0,32 |
| **Fortune Star BVI Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 02.10.2026 | € | 800 | 499 | 0,16 |
| 5,000 % fällig am 18.05.2026 | $ | 700 | 427 | 0,14 |
| 5,050 % fällig am 27.01.2027 | | 1.200 | 720 | 0,23 |
| 5,950 % fällig am 19.10.2025 | | 800 | 513 | 0,16 |
| **GLP China Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 29.03.2026 | | 900 | 814 | 0,26 |
| 4,974 % fällig am 26.02.2024 | | 400 | 399 | 0,13 |
| **Huarong Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 07.11.2027 | | 500 | 436 | 0,14 |
| 4,500 % fällig am 29.05.2029 | | 5.100 | 4.252 | 1,36 |
| **King Talent Management Ltd.** | | | | |
| 5,600 % fällig am 04.12.2022 (b) | | 400 | 383 | 0,12 |
| **Yanlord Land HK Co. Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 20.05.2026 | | 1.100 | 838 | 0,27 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 6,750 % fällig am 23.04.2023 | $ | 200 | $190 | 0,06 |
| 6,800 % fällig am 27.02.2024 | | 900 | 785 | 0,25 |
| | | | 12.905 | 4,13 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Airport Authority Hong Kong** | | | | |
| 2,500 % fällig am 12.01.2032 | | 3.600 | 3.157 | 1,01 |
| **Hong Kong Government International Bond** | | | | |
| 2,375 % fällig am 02.02.2051 | | 200 | 142 | 0,04 |
| | | | 3.299 | 1,05 |
| Summe Hongkong | | | 16.387 | 5,24 |
| **INDIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Adani Electricity Mumbai Ltd.** | | | | |
| 3,949 % fällig am 12.02.2030 | | 1.200 | 981 | 0,31 |
| **Adani Green Energy UP Ltd.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 10.12.2024 | | 2.000 | 1.920 | 0,61 |
| **Adani Transmission Step-One Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 03.08.2026 | | 1.600 | 1.509 | 0,48 |
| **GMR Hyderabad International Airport Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 27.10.2027 | | 500 | 423 | 0,13 |
| 5,375 % fällig am 10.04.2024 | | 600 | 584 | 0,19 |
| **Indian Railway Finance Corp. Ltd.** | | | | |
| 3,570 % fällig am 21.01.2032 | | 2.100 | 1.801 | 0,58 |
| **JSW Hydro Energy Ltd.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 18.05.2031 | | 1.012 | 807 | 0,26 |
| **Muthoot Finance Ltd.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 02.09.2023 | | 1.000 | 974 | 0,31 |
| 6,125 % fällig am 31.10.2022 | | 1.993 | 1.992 | 0,64 |
| **Network i2i Ltd.** | | | | |
| 5,650 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 200 | 186 | 0,06 |
| **NTPC Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 26.02.2026 | | 600 | 597 | 0,19 |
| **ONGC Videsh Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 07.05.2023 | | 4.100 | 4.105 | 1,31 |
| **ONGC Videsh Vankorneft Pte. Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 27.07.2026 | | 1.000 | 969 | 0,31 |
| **Periama Holdings LLC** | | | | |
| 5,950 % fällig am 19.04.2026 | | 2.600 | 2.337 | 0,75 |
| **Reliance Industries Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 12.01.2032 | | 700 | 581 | 0,19 |
| **ReNew Power Pvt Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 05.03.2027 | | 700 | 641 | 0,20 |
| 6,450 % fällig am 27.09.2022 | | 1.500 | 1.494 | 0,48 |
| **ReNew Wind Energy AP2** | | | | |
| 4,500 % fällig am 14.07.2028 | | 400 | 314 | 0,10 |
| **Shriram Transport Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 4,150 % fällig am 18.07.2025 | | 2.050 | 1.794 | 0,57 |
| 5,950 % fällig am 24.10.2022 | | 2.900 | 2.868 | 0,92 |
| **UltraTech Cement Ltd.** | | | | |
| 2,800 % fällig am 16.02.2031 | | 2.000 | 1.587 | 0,51 |
| | | | 28.464 | 9,10 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Export-Import Bank of India** | | | | |
| 2,250 % fällig am 13.01.2031 | | 1.300 | 1.025 | 0,33 |
| Summe Indien | | | 29.489 | 9,43 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Adaro Indonesia PT** | | | | |
| 4,250 % fällig am 31.10.2024 | | 500 | 471 | 0,15 |
| **Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT** | | | | |
| 3,750 % fällig am 30.03.2026 (d) | | 2.420 | 2.202 | 0,70 |
| 4,300 % fällig am 24.03.2027 (b)(d) | | 450 | 395 | 0,13 |
| **Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT** | | | | |
| 4,625 % fällig am 20.07.2023 | | 3.200 | 3.220 | 1,03 |
| **Bukit Makmur Mandiri Utama PT** | | | | |
| 7,750 % fällig am 10.02.2026 | | 1.200 | 1.026 | 0,33 |
| **Cikarang Listrindo Tbk PT** | | | | |
| 4,950 % fällig am 14.09.2026 | | 1.200 | 1.114 | 0,36 |
| **Freeport Indonesia PT** | | | | |
| 4,763 % fällig am 14.04.2027 | | 900 | 866 | 0,28 |
| 5,315 % fällig am 14.04.2032 | | 1.600 | 1.458 | 0,47 |
| **Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT** | | | | |
| 3,541 % fällig am 27.04.2032 | $ | 700 | $546 | 0,17 |
| **Indonesia Asahan Aluminium Persero PT** | | | | |
| 5,800 % fällig am 15.05.2050 | | 1.200 | 968 | 0,31 |
| **LLPL Capital Pte. Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 04.02.2039 | | 1.046 | 975 | 0,31 |
| **Medco Oak Tree Pte. Ltd.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 14.05.2026 | | 1.700 | 1.551 | 0,50 |
| **Pakuwon Jati Tbk PT** | | | | |
| 4,875 % fällig am 29.04.2028 | | 200 | 172 | 0,05 |
| **Pelabuhan Indonesia Persero PT** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.10.2024 | | 700 | 706 | 0,22 |
| 5,375 % fällig am 05.05.2045 | | 700 | 656 | 0,21 |
| **Pertamina Persero PT** | | | | |
| 1,400 % fällig am 09.02.2026 | | 700 | 623 | 0,20 |
| **Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia** | | | | |
| 4,400 % fällig am 06.06.2027 | | 3.200 | 3.182 | 1,02 |
| 4,700 % fällig am 06.06.2032 | | 4.000 | 3.939 | 1,26 |
| **Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara** | | | | |
| 3,375 % fällig am 05.02.2030 | | 2.500 | 2.117 | 0,68 |
| | | | 26.187 | 8,38 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 5,250 % fällig am 17.01.2042 | | 900 | 883 | 0,28 |
| Summe Indonesien | | | 27.070 | 8,66 |
| **ISRAEL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Energean Israel Finance Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.03.2026 | | 500 | 443 | 0,14 |
| **JAPAN** | | | | |
| **WANDELANLEIHEN & WECHSEL** | | | | |
| **ANA Holdings, Inc.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 10.12.2031 (a) | ¥ | 90.000 | 656 | 0,21 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **West China Cement Ltd.** | | | | |
| 4,950 % fällig am 08.07.2026 | $ | 1.400 | 1.132 | 0,36 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Guara Norte SARL** | | | | |
| 5,198 % fällig am 15.06.2034 | | 843 | 685 | 0,22 |
| **MALAYSIA** | | | | |
| **WANDELANLEIHEN & WECHSEL** | | | | |
| **Cerah Capital Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 08.08.2024 (a) | | 2.400 | 2.398 | 0,77 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Genm Capital Labuan Ltd.** | | | | |
| 3,882 % fällig am 19.04.2031 | | 500 | 396 | 0,13 |
| **Misc Capital Two Labuan Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 06.04.2025 | | 3.900 | 3.798 | 1,22 |
| **Petronas Capital Ltd.** | | | | |
| 2,480 % fällig am 28.01.2032 | | 600 | 512 | 0,16 |
| 3,404 % fällig am 28.04.2061 | | 550 | 415 | 0,13 |
| **Petronas Energy Canada Ltd.** | | | | |
| 2,112 % fällig am 23.03.2028 | | 900 | 812 | 0,26 |
| | | | 5.933 | 1,90 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Export-Import Bank of Malaysia Bhd.** | | | | |
| 1,831 % fällig am 26.11.2026 | | 1.000 | 910 | 0,29 |
| Summe Malaysia | | | 9.241 | 2,96 |
| **MAURITIUS** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **CA Magnum Holdings** | | | | |
| 5,375 % fällig am 31.10.2026 | | 1.600 | 1.391 | 0,44 |
| **Greenko Dutch BV** | | | | |
| 3,850 % fällig am 29.03.2026 | $ | 1.164 | $990 | 0,32 |
| **Greenko Solar Mauritius Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 29.07.2026 | | 1.200 | 1.072 | 0,34 |
| **Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 06.04.2025 | | 1.900 | 1.749 | 0,56 |
| **India Clean Energy Holdings** | | | | |
| 4,500 % fällig am 18.04.2027 | | 1.700 | 1.243 | 0,40 |
| **India Green Energy Holdings** | | | | |
| 5,375 % fällig am 29.04.2024 | | 1.700 | 1.591 | 0,51 |
| **India Green Power Holdings** | | | | |
| 4,000 % fällig am 22.02.2027 | | 1.000 | 784 | 0,25 |
| **India Toll Roads** | | | | |
| 5,500 % fällig am 19.08.2024 | | 250 | 238 | 0,08 |
| Summe Mauritius | | | 9.058 | 2,90 |
| **MEXIKO** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Mercantil del Norte S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.01.2027 (b)(d) | | 850 | 705 | 0,22 |
| **MONGOLEI** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Mongolia Government International Bond** | | | | |
| 5,125 % fällig am 07.04.2026 | | 600 | 542 | 0,17 |
| 5,625 % fällig am 01.05.2023 | | 431 | 425 | 0,14 |
| 8,750 % fällig am 09.03.2024 | | 800 | 810 | 0,26 |
| Summe Mongolei | | | 1.777 | 0,57 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Dufry One BV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 15.02.2027 | € | 650 | 512 | 0,16 |
| **Mong Duong Finance Holdings BV** | | | | |
| 5,125 % fällig am 07.05.2029 | $ | 750 | 606 | 0,20 |
| **Prosus NV** | | | | |
| 4,193 % fällig am 19.01.2032 | | 2.200 | 1.759 | 0,56 |
| 4,987 % fällig am 19.01.2052 | | 900 | 648 | 0,21 |
| Summe Niederlande | | | 3.525 | 1,13 |
| **PAKISTAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Third Pakistan International Sukuk Co. Ltd.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 05.12.2022 | | 500 | 470 | 0,15 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Pakistan Government International Bond** | | | | |
| 6,000 % fällig am 08.04.2026 | | 3.700 | 2.516 | 0,80 |
| 6,875 % fällig am 05.12.2027 | | 900 | 614 | 0,20 |
| 7,375 % fällig am 08.04.2031 | | 200 | 127 | 0,04 |
| 8,875 % fällig am 08.04.2051 | | 500 | 300 | 0,10 |
| | | | 3.557 | 1,14 |
| Summe Pakistan | | | 4.027 | 1,29 |
| **PHILIPPINEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ACEN Finance Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 08.03.2025 (b) | | 2.000 | 1.690 | 0,54 |
| **Development Bank of the Philippines** | | | | |
| 2,375 % fällig am 11.03.2031 | | 2.000 | 1.575 | 0,50 |
| **Globe Telecom, Inc.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 23.07.2035 | | 600 | 439 | 0,14 |
| 4,200 % fällig am 02.08.2026 (b) | | 900 | 848 | 0,27 |
| **ICTSI Treasury BV** | | | | |
| 4,625 % fällig am 16.01.2023 | | 1.600 | 1.614 | 0,52 |
| **JGSH Philippines Ltd.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 09.07.2030 | | 200 | 185 | 0,06 |
| **Jollibee Worldwide Pte. Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 24.06.2030 | | 700 | 665 | 0,21 |
| **SM Investments Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 10.06.2024 | | 200 | 203 | 0,07 |
| **SMC Global Power Holdings Corp.** | | | | |
| 5,450 % fällig am 09.12.2026 (b) | | 300 | 278 | 0,09 |
| 7,000 % fällig am 21.10.2025 (b) | | 200 | 198 | 0,06 |
| | | | 7.695 | 2,46 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Philippines Government International Bond** | | | | |
| 1,750 % fällig am 28.04.2041 | € | 1.400 | $ 994 | 0,32 |
| 3,200 % fällig am 06.07.2046 | $ | 900 | 677 | 0,22 |
| 5,000 % fällig am 13.01.2037 | | 200 | 201 | 0,06 |
| | | | 1.872 | 0,60 |
| Summe Philippinen | | | 9.567 | 3,06 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ABJA Investment Co. Pte. Ltd.** | | | | |
| 5,450 % fällig am 24.01.2028 | | 200 | 190 | 0,06 |
| **Indika Energy Capital Pte. Ltd.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 22.10.2025 | | 1.950 | 1.890 | 0,60 |
| **LMIRT Capital Pte. Ltd.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 19.06.2024 | | 200 | 179 | 0,06 |
| 7,500 % fällig am 09.02.2026 | | 800 | 684 | 0,22 |
| **Medco Bell Pte. Ltd.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 30.01.2027 | | 200 | 171 | 0,05 |
| **Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 19.06.2024 (d) | | 2.100 | 2.112 | 0,68 |
| 4,602 % fällig am 15.06.2032 (d) | | 4.800 | 4.768 | 1,53 |
| **TML Holdings Pte. Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 03.06.2024 | | 1.400 | 1.356 | 0,43 |
| **United Overseas Bank Ltd.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 16.03.2031 (d) | | 800 | 725 | 0,23 |
| Summe Singapur | | | 12.075 | 3,86 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Sasol Financing USA LLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 27.09.2028 | | 400 | 363 | 0,12 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Hana Bank** | | | | |
| 3,250 % fällig am 30.03.2027 | | 2.500 | 2.405 | 0,77 |
| 3,500 % fällig am 19.10.2026 (b)(d) | | 800 | 738 | 0,24 |
| **KB Capital Co. Ltd.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 28.10.2025 | | 900 | 824 | 0,26 |
| **KB Kookmin Card Co. Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 09.06.2025 | | 3.200 | 3.172 | 1,01 |
| **Kookmin Bank** | | | | |
| 2,500 % fällig am 04.11.2030 (d) | | 1.400 | 1.183 | 0,38 |
| Kyobo Life Insurance Co. Ltd. | | | | |
| 5,900 % fällig am 15.06.2027 (b) | | 1.000 | 999 | 0,32 |
| **LG Chem Ltd.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 07.07.2031 | | 2.000 | 1.677 | 0,54 |
| **Shinhan Bank Co. Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 23.04.2029 (d) | | 200 | 192 | 0,06 |
| **Shinhan Card Co. Ltd.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 27.01.2027 | | 3.600 | 3.314 | 1,06 |
| **Shinhan Financial Group Co. Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 12.05.2026 (b)(d) | | 1.500 | 1.335 | 0,43 |
| **SK Hynix, Inc.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 19.01.2031 | | 500 | 394 | 0,13 |
| **Tongyang Life Insurance Co. Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 22.09.2025 (b) | | 600 | 573 | 0,18 |
| **Woori Bank** | | | | |
| 4,250 % fällig am 04.10.2024 (b)(d) | | 1.500 | 1.448 | 0,46 |
| | | | 18.254 | 5,84 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Korea National Oil Corp.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 18.04.2027 | $ | 5.300 | $ 4.867 | 1,56 |
| Summe Südkorea | | | 23.121 | 7,40 |
| **SRI LANKA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Sri Lanka Government International Bond** | | | | |
| 6,200 % fällig am 11.05.2027 ^ | | 1.200 | 390 | 0,13 |
| 6,825 % fällig am 18.07.2026 ^ | | 500 | 174 | 0,06 |
| 6,850 % fällig am 14.03.2024 ^ | | 600 | 195 | 0,06 |
| 7,550 % fällig am 28.03.2030 ^ | | 1.100 | 356 | 0,11 |
| Summe Sri Lanka | | | 1.115 | 0,36 |
| **THAILAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bangkok Bank PCL** | | | | |
| 4,300 % fällig am 15.06.2027 | | 3.200 | 3.204 | 1,02 |
| **GC Treasury Center Co. Ltd.** | | | | |
| 2,980 % fällig am 18.03.2031 | | 1.900 | 1.583 | 0,51 |
| 5,200 % fällig am 30.03.2052 | | 400 | 350 | 0,11 |
| **Kasikornbank PCL** | | | | |
| 5,275 % fällig am 14.10.2025 (b)(d) | | 800 | 743 | 0,24 |
| **Minor International PCL** | | | | |
| 2,700 % fällig am 19.04.2026 (b) | | 800 | 738 | 0,23 |
| Muang Thai Life Assurance PCL | | | | |
| 3,552 % fällig am 27.01.2037 (d) | | 2.600 | 2.337 | 0,75 |
| Summe Thailand | | | 8.955 | 2,86 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 22.05.2027 (b)(d) | | 900 | 809 | 0,26 |
| **Jaguar Land Rover Automotive PLC** | | | | |
| 2,200 % fällig am 15.01.2024 | € | 400 | 379 | 0,12 |
| **Prudential PLC** | | | | |
| 2,950 % fällig am 03.11.2033 | $ | 700 | 590 | 0,19 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 1,822 % fällig am 23.11.2025 | | 1.400 | 1.298 | 0,42 |
| 6,000 % fällig am 26.07.2025 (b)(d) | | 700 | 665 | 0,21 |
| **Vedanta Resources Finance PLC** | | | | |
| 8,950 % fällig am 11.03.2025 | | 2.250 | 1.784 | 0,57 |
| Summe Großbritannien | | | 5.525 | 1,77 |
| **USA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BOC Aviation USA Corp.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 29.04.2024 | | 800 | 767 | 0,24 |
| **DAE Funding LLC** | | | | |
| 1,550 % fällig am 01.08.2024 | | 500 | 469 | 0,15 |
| **Hyundai Capital America** | | | | |
| 2,750 % fällig am 27.09.2026 | | 700 | 646 | 0,21 |
| **Stillwater Mining Co.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 16.11.2026 | | 800 | 668 | 0,21 |
| | | | 2.550 | 0,81 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | | |
| 1,875 % fällig am 15.11.2051 | | 600 | 450 | 0,14 |
| 2,250 % fällig am 15.08.2049 | | 20 | 17 | 0,01 |
| | | | 467 | 0,15 |
| Summe USA | | | 3.017 | 0,96 |
| **JUNGFERNINSELN (BRITISCH)** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **1MDB Global Investments Ltd.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 09.03.2023 | $ | 4.300 | $ 4.170 | 1,33 |
| **Celestial Miles Ltd.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 31.01.2024 (b) | | 2.300 | 2.308 | 0,74 |
| **Champion Path Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 27.01.2026 | | 400 | 254 | 0,08 |
| 4,850 % fällig am 27.01.2028 | | 1.300 | 764 | 0,24 |
| **NWD Finance BVI Ltd.** | | | | |
| 4,800 % fällig am 09.09.2023 (b) | | 1.600 | 1.217 | 0,39 |
| 5,250 % fällig am 22.03.2026 (b) | | 2.700 | 2.565 | 0,82 |
| 6,150 % fällig am 16.03.2025 (b) | | 2.400 | 2.382 | 0,76 |
| **Peak RE BVI Holding Ltd.** | | | | |
| 5,350 % fällig am 28.10.2025 (b) | | 1.300 | 1.027 | 0,33 |
| **RKPF Overseas Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 26.07.2026 | | 600 | 284 | 0,09 |
| 5,900 % fällig am 05.03.2025 | | 1.700 | 838 | 0,27 |
| 6,700 % fällig am 30.09.2024 | | 200 | 111 | 0,04 |
| **Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 24.04.2033 | | 2.221 | 2.095 | 0,67 |
| **Studio City Co. Ltd.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.02.2027 | | 600 | 521 | 0,17 |
| **Studio City Finance Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2029 | | 1.300 | 673 | 0,22 |
| 6,000 % fällig am 15.07.2025 | | 300 | 190 | 0,06 |
| **TSMC Global Ltd.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 23.04.2028 | | 3.300 | 2.910 | 0,93 |
| **Wheelock MTN BVI Ltd.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 25.01.2026 | | 1.500 | 1.408 | 0,45 |
| Summe Jungferninseln (Britisch) | | | 23.717 | 7,59 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | | |
| **Future Diamond Ltd.** | | | | |
| 0,363 % fällig am 22.09.2022 | | 200 | 187 | 0,06 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 187 | 0,06 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **$ 273.493** | **87,50** |
| | | **AKTIEN** | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (c)** | | 2.976.897 | 29.614 | 9,47 |
| **PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (c)** | | 1.880 | 26 | 0,01 |
| | | | 29.640 | 9,48 |
| **EXCHANGE-TRADED FUNDS** | | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (c)** | | 10.100 | 999 | 0,32 |
| **Summe Investmentfonds** | | | **$ 30.639** | **9,80** |

**PENSIONSGESCHÄFTE**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SSB | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 914 | U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026 | $ (932) | $ 914 | $ 914 | 0,29 |
| TDM | 1,480 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 2.600 | U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 31.01.2025 | (2.688) | 2.600 | 2.600 | 0,83 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (3.620)** | **$ 3.514** | **$ 3.514** | **1,12** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

### FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09.2022 | 6 | $ 9 | 0,00 |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 3 | 12 | 0,00 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 4 | 29 | 0,01 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 32 | (27) | (0,01) |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 191 | (76) | (0,02) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 132 | 90 | 0,03 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2022 | 32 | 41 | 0,01 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 40 | (61) | (0,02) |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09.2022 | 82 | 77 | 0,03 |
| | | | | $ 94 | 0,03 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 94** | **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 | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Atlantia SpA | 1,000 % | 20.06.2025 | € 100 | $ 3 | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.06.2023 | $ 200 | (1) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.12.2023 | 100 | (2) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.12.2026 | 200 | (11) | 0,00 |
| Jaguar Land Rover Automotive PLC | 5,000 | 20.06.2026 | € 400 | (84) | (0,03) |
| | | | | $ (95) | (0,03) |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Asia Ex-Japan 37 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2027 | $ 6.400 | $ (86) | (0,03) |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung[3] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 0,500 % | 15.06.2024 | $ 10.900 | $ (42) | (0,02) |
| Erhalt[3] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,300 | 21.12.2022 | 8.100 | 17 | 0,01 |
| Erhalt[3] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2029 | 17.600 | (314) | (0,10) |
| Erhalt[3] | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,500 | 16.03.2027 | CNY 24.900 | 23 | 0,01 |
| Erhalt[3] | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 0,500 | 16.12.2025 | AUD 800 | 69 | 0,02 |
| | | | | | $ (247) | (0,08) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (428)** | **(0,14)** |

(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**

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Baidu. Inc, | 1,000 % | 20.06.2026 | $ 600 | $ 4 | $ (7) | $ (3) | 0,00 |
| | Longfor Group Holdings Ltd, | 1,000 | 20.06.2026 | 600 | (10) | (51) | (61) | (0,02) |
| | Vanke Real Estate Hong Kong Co, Ltd, | 1,000 | 20.06.2026 | 600 | (4) | (34) | (38) | (0,01) |
| BRC | Baidu. Inc, | 1,000 | 20.06.2026 | 1.400 | 18 | (24) | (6) | 0,00 |
| | BOC Aviation Ltd, | 1,000 | 20.06.2026 | 2.000 | (7) | (5) | (12) | (0,01) |
| | State Bank of India | 1,000 | 20.06.2026 | 1.300 | (1) | (4) | (5) | 0,00 |
| | Vanke Real Estate Hong Kong Co, Ltd, | 1,000 | 20.06.2026 | 1.400 | 2 | (91) | (89) | (0,03) |
| GST | Philippines Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 3.000 | 10 | (47) | (37) | (0,01) |
| | South Korea Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 3.000 | 103 | (38) | 65 | 0,02 |
| | Vietnam Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 3.000 | (21) | (58) | (79) | (0,02) |
| | | | | | $ 94 | $ (359) | $ (265) | (0,08) |

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

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

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | HKD | 11.594 | $ | 1.479 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 16.000 | | 124 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 745 | AUD | 1.046 | 0 | (25) | (25) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 6.500 | CNH | 43.255 | 0 | (51) | (51) | (0,02) |
| | 01.2023 | CNH | 105.831 | $ | 16.400 | 606 | 0 | 606 | 0,19 |
| | 02.2023 | $ | 16.384 | CNH | 105.831 | 0 | (583) | (583) | (0,19) |
| BPS | 07.2022 | € | 5 | $ | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 7.277 | € | 6.903 | 0 | (61) | (61) | (0,02) |
| | 08.2022 | CNH | 105.831 | $ | 15.889 | 111 | 0 | 111 | 0,04 |
| | 08.2022 | € | 5.289 | | 5.573 | 34 | 0 | 34 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 0 | THB | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 1.990 | MYR | 8.359 | 0 | (95) | (95) | (0,03) |
| | 12.2022 | CNH | 105.831 | $ | 16.214 | 425 | 0 | 425 | 0,14 |
| | 12.2022 | $ | 16.144 | CNH | 105.831 | 0 | (355) | (355) | (0,11) |
| | 01.2023 | | 16.184 | | 105.831 | 0 | (390) | (390) | (0,12) |
| CBK | 07.2022 | | 878 | € | 822 | 0 | (18) | (18) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 1.659 | AUD | 2.354 | 0 | (39) | (39) | (0,01) |
| DUB | 08.2022 | THB | 158 | $ | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 08.2022 | $ | 9.398 | CNH | 62.575 | 0 | (69) | (69) | (0,02) |
| JPM | 08.2022 | CNH | 6.945 | $ | 1.033 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 757.676 | | 52 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 75.967 | | 581 | 21 | 0 | 21 | 0,01 |
| | 08.2022 | PHP | 1.089 | | 21 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | SGD | 25 | | 18 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 06.2023 | $ | 1.586 | VND | 38.064.888 | 30 | 0 | 30 | 0,01 |
| MBC | 08.2022 | CNH | 15.800 | $ | 2.353 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 333.311 | | 23 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 05.2023 | CNH | 15.911 | | 2.371 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | $ | 17 | € | 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNY | 671 | $ | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | KRW | 11.470 | | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | THB | 386 | | 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 25 | IDR | 361.466 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 47 | € | 45 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 28.026 | $ | 4.184 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNY | 1.075 | | 161 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 1.603 | PHP | 87.796 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 09.2022 | MYR | 8.487 | $ | 1.938 | 17 | (4) | 13 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | € | 7.725 | | 8.303 | 227 | 0 | 227 | 0,07 |
| UAG | 08.2022 | PHP | 171.101 | | 3.261 | 157 | 0 | 157 | 0,05 |
| | 02.2023 | CNH | 105.831 | | 16.460 | 659 | 0 | 659 | 0,21 |
| | | | | | | $ 2.302 | $ (1.713) | $ 589 | 0,19 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | € 26 | $ 28 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | 1.396 | 1.498 | 38 | 0 | 38 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ 206 | € 195 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | € 206 | $ 222 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 34 | € 32 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | € 38.967 | $ 40.993 | 255 | 0 | 255 | 0,08 |
| | 07.2022 | $ 43.876 | € 40.686 | 0 | (1.340) | (1.340) | (0,43) |
| | 08.2022 | 41.067 | 38.967 | 0 | (255) | (255) | (0,08) |
| MYI | 07.2022 | € 13 | $ 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 204 | € 193 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | € 5 | $ 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 39.053 | € 36.459 | 0 | (937) | (937) | (0,30) |
| UAG | 07.2022 | € 35 | $ 36 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 44.222 | € 41.154 | 0 | (1.197) | (1.197) | (0,38) |
| | | | | $ 300 | $ (3.733) | $ (3.433) | (1,10) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | $ 66 | £ 52 | $ 0 | $ (3) | $ (3) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | 66 | 52 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 66 | 53 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | | | | $ 0 | $ (7) | $ (7) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend und Class E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | SGD 763 | $ 549 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 1.244 | SGD 1.704 | 0 | (20) | (20) | (0,01) |
| | 08.2022 | 549 | 763 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | SGD 1.531 | $ 1.102 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ 1.102 | SGD 1.531 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | SGD 52 | $ 38 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | $ 1.228 | SGD 1.678 | 0 | (22) | (22) | (0,01) |
| UAG | 07.2022 | 1.273 | 1.743 | 0 | (21) | (21) | (0,01) |
| | | | | $ 4 | $ (66) | $ (62) | (0,02) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (3.178)** | **(1,01)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 304.134** | **97,30** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ 8.440** | **2,70** |
| **Nettovermögen** | **$ 312.574** | **100,00** |

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

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

**^** **Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a)** **Nullkuponwertpapier.**

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

**(c)** **Mit dem Fonds verbunden.**

**(d)** **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(e)** **Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeits-datum | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Flourish Century | 6,600 % | 04.02.2049 | 25.08.2021 - 27.08.2021 | $ 1.676 | $ 187 | 0,06 |

**(f)** **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurde zum 30. Juni 2022 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von USD 70 als Sicherheiten verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von USD 1.948 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 2.700 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 273.306 | $ 187 | $ 273.493 |
| Investmentfonds | 29.640 | 999 | 0 | 30.639 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 3.514 | 0 | 3.514 |
| Finanzderivate[3] | 50 | (3.562) | 0 | (3.512) |
| **Summen** | **$ 29.690** | **$ 274.257** | **$ 187** | **$ 304.134** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 321.481 | $ 0 | $ 321.481 |
| Investmentfonds | 333.109 | 0 | 0 | 333.109 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 837 | 0 | 837 |
| Finanzderivate[3] | 135 | 574 | 7 | 716 |
| **Summen** | **$ 333.244** | **$ 322.892** | **$ 7** | **$ 656.143** |

(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 2022:**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | (4,000) % | 28.06.2022 | TBD[1] | $ (86) | $ (86) | (0,03) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (86)** | **(0,03)** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ 1 | $ 0 | $ 1 |
| BOA | (33) | 0 | (33) |
| BPS | (433) | 530 | 97 |
| BRC | (112) | 0 | (112) |
| CBK | (57) | 0 | (57) |
| GLM | (63) | 0 | (63) |
| GST | (51) | 0 | (51) |
| JPM | 50 | 0 | 50 |
| MBC | (1.349) | 1.010 | (339) |
| MYI | (3) | (9) | (12) |
| SCX | (953) | 870 | (83) |
| SOG | 227 | 0 | 227 |
| UAG | (402) | 290 | (112) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 68,77 | 66,89 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 18,67 | 22,16 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 0,06 | k. A. |
| Investmentfonds | 9,80 | 9,17 |
| Pensionsgeschäfte | 1,12 | 0,23 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,03 | 0,07 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,14) | 0,02 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (1,01) | 0,11 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (0,03) | (0,28) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Australien | 1,74 | 2,16 |
| Bahamas | 0,22 | 0,22 |
| Brasilien | 0,09 | 0,40 |
| Cayman-Inseln | 15,72 | 16,05 |
| China | 7,71 | 11,02 |
| Frankreich | k. A. | 0,14 |
| Deutschland | 0,65 | 0,75 |
| Hongkong | 5,24 | 6,17 |
| Indien | 9,43 | 6,86 |
| Indonesien | 8,66 | 5,98 |
| Israel | 0,14 | 0,14 |
| Japan | 0,21 | 1,89 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,36 | k. A. |
| Luxemburg | 0,22 | 0,60 |
| Malaysia | 2,96 | 2,17 |
| Mauritius | 2,90 | 2,61 |
| Mexiko | 0,22 | 0,47 |
| Mongolei | 0,57 | 0,54 |
| Niederlande | 1,13 | 0,79 |
| Oman | k. A. | 0,32 |
| Pakistan | 1,29 | 1,39 |
| Philippinen | 3,06 | 2,83 |
| Singapur | 3,86 | 3,02 |
| Südafrika | 0,12 | 0,47 |
| Südkorea | 7,40 | 2,67 |
| Sri Lanka | 0,36 | 0,74 |
| Thailand | 2,86 | 2,46 |
| Großbritannien | 1,77 | 3,25 |
| USA | 0,96 | 1,68 |
| Jungferninseln (Britisch) | 7,59 | 6,13 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,06 | 5,13 |
| Investmentfonds | 9,80 | 9,17 |
| Pensionsgeschäfte | 1,12 | 0,23 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,03 | 0,07 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,03) | 0,01 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,03) | 0,01 |
| Zinsswaps | (0,08) | 0,00 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,08) | (0,02) |
| Zinsswaps | k. A. | 0,01 |
| Total Return Swaps auf Wertpapiere | k. A. | 0,01 |
| Devisenterminkontrakte | 0,19 | 0,01 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (1,12) | 0,10 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 2,70 | 1,35 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **ÖSTERREICH** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Erste Group Bank AG** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 07.06.2033 | € | 6.800 | $ | 6.776 | 0,11 |
| 4,250 % fällig am 15.10.2027 (d)(f) | | 102.200 | | 84.514 | 1,42 |
| 5,125 % fällig am 15.10.2025 (d)(f) | | 2.400 | | 2.313 | 0,04 |
| 6,500 % fällig am 15.04.2024 (d)(f) | | 10.200 | | 10.404 | 0,18 |
| Summe Österreich | | | | 104.007 | 1,75 |
| **BELGIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **KBC Group NV** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 24.10.2025 (d)(f) | | 72.800 | | 66.122 | 1,11 |
| 4,750 % fällig am 05.03.2024 (d)(f) | | 2.000 | | 1.983 | 0,03 |
| Summe Belgien | | | | 68.105 | 1,14 |
| **KANADA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Bank of Nova Scotia** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 27.10.2081 (f)(g)(h) | $ | 21.700 | | 16.436 | 0,28 |
| 4,900 % fällig am 04.06.2025 (d)(f)(h) | | 31.900 | | 29.658 | 0,50 |
| **Scotiabank Capital Trust** | | | | | |
| 5,650 % fällig am 31.12.2056 | CAD | 18.216 | | 15.783 | 0,26 |
| Summe Kanada | | | | 61.877 | 1,04 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **CIFI Holdings Group Co. Ltd.** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 13.05.2026 | $ | 700 | | 398 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 16.07.2025 | | 300 | | 181 | 0,00 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | | | |
| 2,700 % fällig am 12.07.2026 | | 800 | | 376 | 0,01 |
| 5,125 % fällig am 17.01.2025 | | 2.200 | | 1.205 | 0,02 |
| 6,150 % fällig am 17.09.2025 | | 1.900 | | 1.027 | 0,02 |
| 8,000 % fällig am 27.01.2024 | | 1.500 | | 997 | 0,01 |
| **New Metro Global Ltd.** | | | | | |
| 6,800 % fällig am 05.08.2023 | | 200 | | 137 | 0,00 |
| **Seazen Group Ltd.** | | | | | |
| 4,450 % fällig am 13.07.2025 | | 700 | | 411 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 12.08.2024 | | 900 | | 540 | 0,01 |
| Summe Cayman Inseln | | | | 5.272 | 0,09 |
| **CHINA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **New Metro Global Ltd.** | | | | | |
| 4,800 % fällig am 15.12.2024 | | 800 | | 440 | 0,01 |
| **DÄNEMARK** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.04.2026 (d)(f) | € | 25.600 | | 24.533 | 0,41 |
| **FINNLAND** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Nordea Bank Abp** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.03.2029 (d)(f)(h) | $ | 50.200 | | 37.098 | 0,62 |
| 3,750 % fällig am 01.03.2029 (d)(f)(h) | | 4.700 | | 3.473 | 0,06 |
| Summe Finnland | | | | 40.571 | 0,68 |
| **FRANKREICH** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Air France-KLM** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 16.01.2025 | € | 10.000 | | 8.831 | 0,15 |
| **Altice France S.A.** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.10.2029 | € | 8.800 | $ | 6.893 | 0,12 |
| 5,500 % fällig am 15.10.2029 | $ | 17.900 | | 13.729 | 0,23 |
| **AXA S.A.** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 10.03.2043 | € | 15.600 | | 15.426 | 0,26 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | | |
| 3,132 % fällig am 20.01.2033 | $ | 1.600 | | 1.341 | 0,02 |
| 4,625 % fällig am 12.01.2027 (d)(f) | | 60.100 | | 49.920 | 0,84 |
| 4,625 % fällig am 25.02.2031 (d)(f) | | 36.300 | | 26.880 | 0,45 |
| 7,000 % fällig am 16.08.2028 (d)(f) | | 63.700 | | 60.596 | 1,02 |
| 7,000 % fällig am 16.08.2028 (d)(f) | | 62.000 | | 58.978 | 0,99 |
| 7,375 % fällig am 19.08.2025 (d)(f) | | 18.800 | | 18.624 | 0,31 |
| **BPCE S.A.** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 13.01.2042 (f) | € | 20.600 | | 18.510 | 0,31 |
| 2,125 % fällig am 13.10.2046 (f) | | 59.200 | | 44.606 | 0,75 |
| **CGG S.A.** | | | | | |
| 8,750 % fällig am 01.04.2027 | $ | 10.000 | | 8.521 | 0,14 |
| **CNP Assurances** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 07.10.2030 (d)(f)(h) | | 24.800 | | 19.437 | 0,33 |
| **Credit Agricole Assurances S.A.** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 06.10.2031 | € | 20.200 | | 15.981 | 0,27 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 23.12.2027 (d)(f)(h) | | 17.200 | | 15.313 | 0,26 |
| 7,500 % fällig am 23.06.2026 (d)(f) | £ | 5.508 | | 6.522 | 0,11 |
| **Electricite de France S.A.** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 01.12.2027 (d) | € | 12.000 | | 8.879 | 0,15 |
| 2,875 % fällig am 15.12.2026 (d) | | 33.800 | | 27.562 | 0,46 |
| 5,250 % fällig am 29.01.2023 (d) | $ | 10.000 | | 9.473 | 0,16 |
| 5,625 % fällig am 22.01.2024 (d) | | 16.700 | | 15.314 | 0,26 |
| **Groupe des Assurances du Credit Mutuel SADIR** | | | | | |
| 1,850 % fällig am 21.04.2042 | € | 2.300 | | 1.851 | 0,03 |
| **RCI Banque S.A.** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 18.02.2030 | | 36.500 | | 33.276 | 0,56 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | | |
| 5,375 % fällig am 18.11.2030 (d)(f) | $ | 8.000 | | 6.220 | 0,10 |
| 6,221 % fällig am 15.06.2033 | | 56.800 | | 54.275 | 0,91 |
| 6,750 % fällig am 06.04.2028 (d)(f) | | 51.800 | | 45.996 | 0,77 |
| 7,375 % fällig am 04.10.2023 (d)(f) | | 7.846 | | 7.562 | 0,13 |
| 7,875 % fällig am 18.12.2023 (d)(f) | | 7.300 | | 7.171 | 0,12 |
| 8,000 % fällig am 29.09.2025 (d)(f) | | 54.650 | | 53.567 | 0,90 |
| Summe Frankreich | | | | 661.254 | 11,11 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Commerzbank AG** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 09.10.2029 (d)(f) | € | 33.800 | | 30.427 | 0,51 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 24.06.2032 | | 25.000 | | 23.954 | 0,40 |
| 4,500 % fällig am 30.11.2026 (d)(f) | | 39.400 | | 32.188 | 0,54 |
| 4,625 % fällig am 30.10.2027 (d)(f) | | 29.800 | | 24.060 | 0,40 |
| 5,625 % fällig am 19.05.2031 | | 50.900 | | 53.225 | 0,90 |
| 6,750 % fällig am 30.10.2028 (d)(f) | | 26.200 | | 24.530 | 0,41 |
| **Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 23.05.2042 | $ | 39.400 | | 39.738 | 0,67 |
| Summe Deutschland | | | | 228.122 | 3,83 |
| **HONGKONG** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Hongkong & Shanghai Banking Corp. Ltd.** | | | | | |
| 1,426 % fällig am 27.07.2022 (d)(h) | | 5.665 | | 4.423 | 0,07 |
| **IRLAND** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **AIB Group PLC** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 09.10.2024 (d)(f) | € | 34.460 | | 32.878 | 0,55 |
| 6,250 % fällig am 23.06.2025 (d)(f) | | 37.350 | | 36.460 | 0,61 |
| **Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC** | | | | | |
| 5,950 % fällig am 15.04.2030 ^(f) | $ | 16.800 | | 1.848 | 0,03 |
| **Bank of Ireland Group PLC** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.09.2025 (d)(f) | € | 21.591 | | 20.854 | 0,35 |
| 7,500 % fällig am 19.05.2025 (d)(f) | | 69.300 | | 71.997 | 1,21 |
| **Permanent TSB Group Holdings PLC** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 26.09.2024 | | 30.600 | | 31.243 | 0,53 |
| **Zurich Finance Ireland Designated Activity Co.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 19.04.2051 (h) | $ | 14.500 | $ | 11.572 | 0,20 |
| 3,500 % fällig am 02.05.2052 (h) | | 13.500 | | 10.967 | 0,18 |
| Summe Irland | | | | 217.819 | 3,66 |
| **ISRAEL** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Bank Hapoalim B.M.** | | | | | |
| 3,255 % fällig am 21.01.2032 (f)(h) | | 17.000 | | 14.620 | 0,25 |
| **ITALIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Atlantia SpA** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 12.02.2028 | € | 15.800 | | 12.901 | 0,22 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | | |
| 5,375 % fällig am 18.01.2028 (h) | | 5.708 | | 3.546 | 0,06 |
| 8,000 % fällig am 22.01.2030 (h) | | 10.300 | | 6.897 | 0,12 |
| 8,500 % fällig am 10.09.2030 (h) | | 29.950 | | 20.731 | 0,35 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 23.09.2029 (h) | $ | 51.068 | | 45.560 | 0,76 |
| 4,198 % fällig am 01.06.2032 | | 24.500 | | 17.968 | 0,30 |
| 4,950 % fällig am 01.06.2042 | | 20.000 | | 13.539 | 0,23 |
| 5,148 % fällig am 10.06.2030 | £ | 12.400 | | 13.065 | 0,22 |
| 5,875 % fällig am 01.09.2031 (d)(f) | € | 38.450 | | 31.418 | 0,53 |
| 6,375 % fällig am 30.03.2028 (d)(f) | | 29.000 | | 25.677 | 0,43 |
| 7,700 % fällig am 17.09.2025 (d)(f) | $ | 1.500 | | 1.355 | 0,02 |
| 7,750 % fällig am 11.01.2027 (d)(f) | € | 108.000 | | 107.447 | 1,80 |
| **UniCredit SpA** | | | | | |
| 2,569 % fällig am 22.09.2026 | $ | 7.850 | | 7.031 | 0,12 |
| 2,731 % fällig am 15.01.2032 | € | 5.000 | | 4.436 | 0,07 |
| 3,127 % fällig am 03.06.2032 (h) | $ | 8.100 | | 6.328 | 0,11 |
| 5,459 % fällig am 30.06.2035 | | 23.429 | | 18.954 | 0,32 |
| 6,625 % fällig am 03.06.2023 (d)(f) | € | 77.085 | | 76.650 | 1,29 |
| 7,500 % fällig am 03.06.2026 (d)(f) | | 62.585 | | 60.560 | 1,02 |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 (h) | $ | 20.200 | | 20.926 | 0,35 |
| Summe Italien | | | | 494.989 | 8,32 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **HSBC Bank Capital Funding Sterling LP** | | | | | |
| 5,844 % fällig am 05.11.2031 (d) | £ | 66.532 | | 92.776 | 1,56 |
| **HSBC Capital Funding Dollar LP** | | | | | |
| 10,176 % fällig am 30.06.2030 (d) | $ | 3.817 | | 5.191 | 0,09 |
| Summe Jersey, Kanalinseln | | | | 97.967 | 1,65 |
| **LUXEMBURG** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Aroundtown S.A.** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 23.09.2024 (d) | € | 29.800 | | 23.349 | 0,39 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 16.07.2025 (d) | | 24.800 | | 15.097 | 0,26 |
| 4,875 % fällig am 18.08.2026 (d) | | 17.200 | | 10.458 | 0,18 |
| **Lincoln Financing SARL** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.04.2024 | | 3.600 | | 3.653 | 0,06 |
| **Summer BC Holdco SARL** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 31.10.2026 | | 12.500 | | 11.438 | 0,19 |
| Summe Luxemburg | | | | 63.995 | 1,08 |
| **MEXIKO** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Banco Mercantil del Norte S.A.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.01.2027 (d)(f) | $ | 10.800 | | 8.964 | 0,15 |
| 6,625 % fällig am 24.01.2032 (d)(f) | | 9.000 | | 7.367 | 0,12 |
| 8,375 % fällig am 14.10.2030 (d)(f) | | 23.900 | | 23.108 | 0,39 |
| Summe Mexiko | | | | 39.439 | 0,66 |
| **NIEDERLANDE** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Abertis Infraestructuras Finance BV** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 26.01.2027 (d) | € | 71.600 | | 54.177 | 0,91 |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 22.09.2027 (d)(f) | | 39.600 | | 35.421 | 0,60 |
| **ASR Nederland NV** | | | | | |
| 4,625 % fällig am 19.10.2027 (d)(f) | | 69.050 | | 60.821 | 1,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Athora Netherlands NV** | | | | | |
| 7,000 % fällig am 19.06.2025 (d)(f) | € | 34.765 | $ | 34.404 | 0,58 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | | |
| 3,100 % fällig am 29.06.2028 (d)(f) | | 37.200 | | 29.318 | 0,49 |
| 4,375 % fällig am 29.06.2027 (d)(f) | | 32.400 | | 29.883 | 0,50 |
| 4,875 % fällig am 29.06.2029 (d)(f) | | 22.800 | | 20.045 | 0,34 |
| **de Volksbank NV** | | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.12.2027 (d)(f) | | 16.000 | | 15.633 | 0,26 |
| **ING Groep NV** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 16.05.2027 (d)(f) | $ | 31.184 | | 22.740 | 0,38 |
| 4,250 % fällig am 16.05.2031 (d)(f) | | 66.500 | | 45.513 | 0,76 |
| 4,875 % fällig am 16.05.2029 (d)(f) | | 40.900 | | 33.514 | 0,56 |
| 5,750 % fällig am 16.11.2026 (d)(f) | | 138.100 | | 126.477 | 2,13 |
| 6,500 % fällig am 16.04.2025 (d)(f) | | 8.975 | | 8.474 | 0,14 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.05.2024 (d)(f) | € | 38.900 | | 39.793 | 0,67 |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 (d) | | 286.789 | | 291.962 | 4,91 |
| **Telefonica Europe BV** | | | | | |
| 2,880 % fällig am 24.02.2028 (d) | | 19.300 | | 15.576 | 0,26 |
| 4,375 % fällig am 14.12.2024 (d) | | 41.600 | | 41.589 | 0,70 |
| Summe Niederlande | | | | 905.340 | 15,21 |
| **NORWEGEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **DNB Bank ASA** | | | | | |
| 0,929 % fällig am 28.08.2022 (d) | $ | 8.980 | | 6.136 | 0,10 |
| 0,954 % fällig am 31.08.2022 (d) | | 2.660 | | 1.821 | 0,03 |
| 1,848 % fällig am 23.08.2022 (d)(h) | | 18.810 | | 12.903 | 0,22 |
| Summe Norwegen | | | | 20.860 | 0,35 |
| **PORTUGAL** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Banco Espirito Santo S.A.** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 08.05.2017 ^ | € | 26.300 | | 4.811 | 0,08 |
| 4,000 % fällig am 21.01.2019 ^ | | 11.100 | | 2.031 | 0,04 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2018 ^ | | 20.000 | | 3.659 | 0,06 |
| Summe Portugal | | | | 10.501 | 0,18 |
| **SLOWENIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Nova Ljubljanska Banka d.d.** | | | | | |
| 3,400 % fällig am 05.02.2030 | | 13.500 | | 12.420 | 0,21 |
| 3,650 % fällig am 19.11.2029 (h) | | 14.900 | | 13.864 | 0,23 |
| Summe Slowenien | | | | 26.284 | 0,44 |
| **SPANIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Abanca Corp. Bancaria S.A.** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 20.01.2026 (d)(f) | | 10.000 | | 8.952 | 0,15 |
| 6,125 % fällig am 18.01.2029 | | 7.500 | | 7.821 | 0,13 |
| 7,500 % fällig am 02.10.2023 (d)(f) | | 13.600 | | 13.889 | 0,23 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 29.03.2024 (d)(f) | | 96.200 | | 94.603 | 1,59 |
| 6,000 % fällig am 15.01.2026 (d)(f) | | 37.000 | | 35.278 | 0,59 |
| **Banco de Credito Social Cooperativo S.A.** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 09.03.2028 (h) | | 11.300 | | 9.534 | 0,16 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 21.03.2029 (d)(f) | | 40.000 | | 29.096 | 0,49 |
| 4,125 % fällig am 12.11.2027 (d)(f)(h) | | 50.800 | | 39.958 | 0,67 |
| 4,375 % fällig am 14.01.2026 (d)(f) | | 54.200 | | 47.837 | 0,80 |
| 5,250 % fällig am 29.09.2023 (d)(f) | | 8.200 | | 8.171 | 0,14 |
| **Bankinter S.A.** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 17.01.2026 (d)(f) | | 19.400 | | 19.435 | 0,33 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 14.09.2028 (d)(f) | | 61.200 | | 44.238 | 0,74 |
| 5,250 % fällig am 23.03.2026 (d)(f) | | 88.400 | | 78.844 | 1,33 |
| 5,875 % fällig am 09.10.2027 (d)(f) | | 20.400 | | 18.808 | 0,32 |
| 6,000 % fällig am 18.07.2022 (d)(f) | | 33.000 | | 34.532 | 0,58 |
| 6,375 % fällig am 19.09.2023 (d)(f) | | 22.400 | | 23.259 | 0,39 |
| 6,750 % fällig am 13.06.2024 (d)(f) | | 79.600 | | 80.352 | 1,35 |
| Summe Spanien | | | | 594.607 | 9,99 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **SCHWEDEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Svenska Handelsbanken AB** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.03.2031 (d)(f) | $ | 22.600 | $ | 18.587 | 0,31 |
| **Swedbank AB** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 17.03.2029 (d)(f) | | 29.000 | | 22.163 | 0,37 |
| Summe Schweden | | | | 40.750 | 0,68 |
| **SCHWEIZ** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | | |
| 3,091 % fällig am 14.05.2032 (h) | | 2.850 | | 2.271 | 0,04 |
| 4,194 % fällig am 01.04.2031 (h) | | 60.200 | | 53.324 | 0,90 |
| 5,250 % fällig am 11.02.2027 (d)(f) | | 18.650 | | 14.453 | 0,24 |
| 6,250 % fällig am 18.12.2024 (d)(f) | | 1.100 | | 1.005 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 18.12.2024 (d)(f) | | 57.590 | | 52.605 | 0,88 |
| 6,375 % fällig am 21.08.2026 (d)(f) | | 46.500 | | 38.537 | 0,65 |
| 7,250 % fällig am 12.09.2025 (d)(f) | | 23.659 | | 20.560 | 0,35 |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (d)(f) | | 32.299 | | 29.877 | 0,50 |
| 7,500 % fällig am 11.12.2023 (d)(f) | | 49.200 | | 46.993 | 0,79 |
| 9,750 % fällig am 23.06.2027 (d)(f) | | 1.500 | | 1.536 | 0,03 |
| 9,750 % fällig am 23.06.2027 (d)(f) | | 77.000 | | 78.829 | 1,32 |
| **UBS AG** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (f)(h) | | 5.000 | | 4.999 | 0,08 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (f)(h) | | 29.968 | | 30.057 | 0,50 |
| **UBS Group AG** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 10.02.2031 (d)(f) | | 70.611 | | 51.835 | 0,87 |
| 4,875 % fällig am 12.02.2027 (d)(f) | | 47.500 | | 39.850 | 0,67 |
| 5,000 % fällig am 31.01.2023 (d)(f) | | 10.892 | | 9.957 | 0,17 |
| 7,000 % fällig am 31.01.2024 (d)(f) | | 24.958 | | 24.374 | 0,41 |
| 7,000 % fällig am 19.02.2025 (d)(f) | | 800 | | 795 | 0,01 |
| Summe Schweiz | | | | 501.857 | 8,43 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Barclays Bank PLC** | | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (f) | | 6.683 | | 6.750 | 0,11 |
| **Barclays PLC** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.03.2028 (d)(f) | | 16.400 | | 12.618 | 0,21 |
| 6,125 % fällig am 15.12.2025 (d)(f) | | 68.783 | | 63.949 | 1,07 |
| 6,375 % fällig am 15.12.2025 (d)(f) | £ | 30.764 | | 34.480 | 0,58 |
| 7,125 % fällig am 15.06.2025 (d)(f) | | 41.150 | | 48.076 | 0,81 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (d)(f) | | 38.430 | | 46.008 | 0,77 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (d)(f) | $ | 15.500 | | 15.267 | 0,26 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2022 (d)(f) | £ | 20.100 | | 24.365 | 0,41 |
| 8,000 % fällig am 15.06.2024 (d)(f) | $ | 24.174 | | 23.811 | 0,40 |
| 8,875 % fällig am 15.09.2027 (d)(f) | £ | 36.200 | | 43.727 | 0,73 |
| **BCP Modular Services Finance PLC** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.11.2028 | € | 19.300 | | 16.093 | 0,27 |
| **Bupa Finance PLC** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 24.09.2031 (d)(f) | £ | 11.100 | | 9.062 | 0,15 |
| **HSBC Bank PLC** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 30.09.2022 (d)(h) | $ | 19.480 | | 15.044 | 0,25 |
| 2,977 % fällig am 15.12.2022 (d)(h) | | 8.850 | | 6.846 | 0,11 |
| 3,117 % fällig am 30.12.2022 (d)(h) | | 20.800 | | 16.035 | 0,27 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 09.03.2026 (d)(f) | | 9.100 | | 7.651 | 0,13 |
| 4,600 % fällig am 17.12.2030 (d)(f) | | 15.300 | | 11.799 | 0,20 |
| 4,700 % fällig am 09.03.2031 (d)(f) | | 11.600 | | 8.752 | 0,15 |
| 4,750 % fällig am 04.07.2029 (d)(f) | € | 83.102 | | 72.986 | 1,23 |
| **Legal & General Group PLC** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 24.03.2031 (d)(f) | £ | 41.200 | | 42.380 | 0,71 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | | |
| 3,369 % fällig am 14.12.2046 (h) | $ | 6.699 | | 4.761 | 0,08 |
| 3,511 % fällig am 18.03.2026 (h) | | 1.000 | | 975 | 0,02 |
| 3,750 % fällig am 18.03.2028 (h) | | 1.000 | | 952 | 0,02 |
| 4,947 % fällig am 27.06.2025 (d)(f) | € | 52.240 | | 51.413 | 0,86 |
| 5,125 % fällig am 27.12.2024 (d)(f) | £ | 300 | | 336 | 0,01 |
| 6,750 % fällig am 27.06.2026 (d)(f) | $ | 1.700 | | 1.602 | 0,03 |
| 7,500 % fällig am 27.09.2025 (d)(f) | | 25.491 | | 24.909 | 0,42 |
| 7,875 % fällig am 27.06.2029 (d)(f) | £ | 45.613 | | 54.851 | 0,92 |
| **NatWest Group PLC** | | | | | |
| 4,445 % fällig am 08.05.2030 (h) | $ | 33.800 | | 31.853 | 0,54 |
| 4,500 % fällig am 31.03.2028 (d)(f) | £ | 21.300 | | 20.403 | 0,34 |
| 4,600 % fällig am 28.06.2031 (d)(f) | $ | 44.359 | | 32.770 | 0,55 |
| 4,892 % fällig am 18.05.2029 (h) | | 50.126 | | 48.626 | 0,82 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| 5,076 % fällig am 27.01.2030 (h) | | 1.500 | | 1.470 | 0,02 |
| 5,125 % fällig am 12.05.2027 (d)(f) | £ | 26.050 | | 26.826 | 0,45 |
| 6,000 % fällig am 29.12.2025 (d)(f) | $ | 50.100 | | 46.488 | 0,78 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | | |
| 6,750 % fällig am 24.06.2024 (d)(f) | £ | 53.260 | $ | 62.415 | 1,05 |
| **Santander UK PLC** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 07.11.2023 (h) | $ | 8.753 | | 8.826 | 0,15 |
| **Virgin Media Finance PLC** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.07.2030 | € | 1.000 | | 783 | 0,01 |
| **Virgin Money UK PLC** | | | | | |
| 8,250 % fällig am 17.06.2027 (d)(f) | £ | 13.734 | | 15.857 | 0,27 |
| 9,250 % fällig am 08.06.2024 (d)(f) | | 25.200 | | 30.306 | 0,51 |
| **Vodafone Group PLC** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 27.08.2080 | € | 19.700 | | 15.671 | 0,26 |
| 3,100 % fällig am 03.01.2079 | | 2.100 | | 2.103 | 0,04 |
| 5,125 % fällig am 04.06.2081 | $ | 4.383 | | 2.933 | 0,05 |
| 7,000 % fällig am 04.04.2079 | | 51.600 | | 50.769 | 0,85 |
| | | | | 1.063.597 | 17,87 |
| | | **AKTIEN** | | | |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | | | |
| **Nationwide Building Society** | | | | | |
| 10,250 % | | 650.146 | | 115.661 | 1,95 |
| Summe Großbritannien | | | | 1.179.258 | 19,82 |
| | | **PARI (000S)** | | | |
| **USA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Bank of America Corp.** | | | | | |
| 1,843 % fällig am 04.02.2025 (h) | $ | 44.500 | | 42.931 | 0,72 |
| 5,875 % fällig am 15.03.2028 (d) | | 5.000 | | 4.396 | 0,07 |
| **Coty, Inc.** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.04.2026 | € | 11.300 | | 10.481 | 0,18 |
| **Deutsche Postbank Funding Trust** | | | | | |
| 1,807 % fällig am 02.12.2022 (d) | | 1.704 | | 1.411 | 0,02 |
| 2,081 % fällig am 07.06.2023 (d) | | 12.980 | | 10.817 | 0,18 |
| **Doctors Co. An Interinsurance Exchange** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 18.01.2032 (h) | $ | 3.400 | | 2.985 | 0,05 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.03.2024 (h) | | 7.500 | | 7.407 | 0,13 |
| **Liberty Mutual Group, Inc.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 23.05.2059 | € | 15.500 | | 14.658 | 0,25 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | | |
| 5,650 % fällig am 01.05.2079 (h) | $ | 8.224 | | 7.235 | 0,12 |
| Summe USA | | | | 102.321 | 1,72 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | | |
| **U.S. TREASURY BILLS** | | | | | |
| 0,589 % fällig am 12.07.2022 (b)(c) | | 90.500 | | 90.474 | 1,52 |
| 0,641 % fällig am 19.07.2022 (b)(c) | | 22.100 | | 22.089 | 0,37 |
| 0,692 % fällig am 19.07.2022 (b)(c) | | 8.200 | | 8.196 | 0,14 |
| 0,704 % fällig am 26.07.2022 (b)(c)(h) | | 32.100 | | 32.077 | 0,54 |
| 0,747 % fällig am 12.07.2022 (b)(c) | | 14.700 | | 14.696 | 0,25 |
| 0,751 % fällig am 12.07.2022 (b)(c) | | 6.400 | | 6.398 | 0,11 |
| 0,761 % fällig am 12.07.2022 (b)(c) | | 3.600 | | 3.599 | 0,06 |
| 0,789 % fällig am 12.07.2022 (b)(c) | | 31.200 | | 31.191 | 0,52 |
| 0,812 % fällig am 12.07.2022 (b)(c) | | 6.900 | | 6.898 | 0,12 |
| 0,817 % fällig am 19.07.2022 (b)(c) | | 14.700 | | 14.692 | 0,25 |
| 0,824 % fällig am 28.07.2022 (b)(c) | | 26.200 | | 26.179 | 0,44 |
| 0,890 % fällig am 02.08.2022 (a)(b)(c) | | 37.800 | | 37.762 | 0,63 |
| 1,020 % fällig am 11.08.2022 (b)(c) | | 10.400 | | 10.385 | 0,17 |
| 1,041 % fällig am 02.08.2022 (a)(b)(c) | | 3.700 | | 3.696 | 0,06 |
| 1,120 % fällig am 01.09.2022 (b)(c) | | 18.900 | | 18.851 | 0,32 |
| 1,251 % fällig am 08.09.2022 (b)(c) | | 4.600 | | 4.586 | 0,08 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| 1,266 % fällig am 08.09.2022 (b)(c) | $ 23.300 | $ 23.231 | 0,39 |
| 1,272 % fällig am 08.09.2022 (b)(c) | 37.700 | 37.589 | 0,63 |
| 1,310 % fällig am 11.08.2022 (b)(c) | 10.000 | 9.985 | 0,17 |
| 1,480 % fällig am 23.08.2022 (b)(c) | 21.200 | 21.154 | 0,35 |
| 1,542 % fällig am 22.09.2022 (b)(c) | 14.800 | 14.745 | 0,25 |
| 1,615 % fällig am 22.09.2022 (b)(c) | $ 79.300 | $ 79.004 | 1,33 |
| 1,652 % fällig am 22.09.2022 (b)(c) | 17.100 | 17.036 | 0,29 |
| 2,072 % fällig am 25.10.2022 (b)(c) | 250.000 | 248.390 | 4,17 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 782.903 | 13,16 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | **$ 6.292.114** | **105,73** |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e) | 1.166.064 | $ 11.600 | 0,19 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$ 11.600** | **0,19** |

**PENSIONSGESCHÄFTE**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 8.494 | U,S Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | $ (8.664) | $ 8.494 | $ 8.494 | 0,14 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (8.664)** | **$ 8.494** | **$ 8.494** | **0,14** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09.2022 | 819 | $ (183) | 0,00 |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 1 | 3 | 0,00 |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 1.484 | 5.690 | 0,10 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 203 | 284 | 0,00 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 3.116 | (1.526) | (0,03) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 256 | (1.858) | (0,03) |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Long | 09.2022 | 904 | (618) | (0,01) |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09.2022 | 4.276 | (3.798) | (0,06) |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09.2022 | 407 | 2.068 | 0,03 |
| | | | | $ 62 | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 62** | **0,00** |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Bank of America Corp. | 1,000 % | 20.12.2022 | $ 2.700 | $ (12) | 0,00 |
| Barclays Bank PLC | 1,000 | 20.12.2022 | € 6.000 | (27) | 0,00 |
| Jaguar Land Rover Automotive PLC | 5,000 | 20.06.2027 | 20.000 | (1.901) | (0,03) |
| Morgan Stanley | 1,000 | 20.12.2022 | $ 600 | (1) | 0,00 |
| | | | | $ (1.941) | (0,03) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-38 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2027 | $ 156.100 | $ (1.892) | (0,03) |
| iTraxx Crossover 37 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2027 | € 175.000 | (16.434) | (0,28) |
| iTraxx Europe Main 37 10-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 533.500 | (12.635) | (0,21) |
| | | | | $ (30.961) | (0,52) |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 % | 21.09.2024 | £ 376.500 | $ (4.899) | (0,08) |
| Erhalt | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2032 | 113.800 | 8.967 | 0,15 |
| Erhalt | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 15.09.2051 | 3.800 | 269 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2052 | 105.700 | 18.057 | 0,30 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 % | 21.09.2027 | € 44.000 | $ 2.122 | 0,04 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2024 | 62.100 | 1.231 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2052 | 134.800 | 25.646 | 0,43 |
| | | | | | $ 51.393 | 0,86 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 18.491** | **0,31** |

(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 | Nenn-betrag[2] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Deutsche Bank AG | 1,000 % | 20.12.2026 | € 9.900 | $ (220) | $ (899) | $ (1.119) | (0,02) |
| BPS | Deutsche Bank AG | 1,000 | 20.12.2026 | 4.700 | (119) | (412) | (531) | (0,01) |
| | Deutsche Bank AG | 1,000 | 20.06.2027 | 5.000 | (602) | (46) | (648) | (0,01) |
| | UniCredit SpA | 1,000 | 20.06.2027 | 9.100 | (1.321) | (76) | (1.397) | (0,02) |
| CBK | Commerzbank AG | 1,000 | 20.12.2026 | 15.000 | (1.064) | (426) | (1.490) | (0,02) |
| | Commerzbank AG | 1,000 | 20.06.2027 | 10.000 | (815) | (348) | (1.163) | (0,02) |
| | Deutsche Bank AG | 1,000 | 20.12.2026 | 5.000 | (116) | (449) | (565) | (0,01) |
| GST | Deutsche Bank AG | 1,000 | 20.12.2026 | 5.000 | (128) | (437) | (565) | (0,01) |
| JPM | Banca Monte dei Paschi di Siena SpA | 5,000 | 20.12.2022 | 20.000 | (194) | (122) | (316) | (0,01) |
| | Deutsche Bank AG | 1,000 | 20.12.2026 | 15.000 | (317) | (1.379) | (1.696) | (0,03) |
| | UniCredit SpA | 1,000 | 20.06.2027 | 7.000 | (1.029) | (45) | (1.074) | (0,02) |
| | | | | | $ (5.925) | $ (4.639) | $ (10.564) | (0,18) |

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

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

### TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nenn-betrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPM | Receive | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR plus a specified spread | € 32.500 | 20.12.2022 | $ 50 | $ (2.891) | $ (2.841) | (0,05) |

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | AUD 250 | $ 174 | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ 4.950 | 6.207 | 195 | 0 | 195 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 42.603 | € 40.196 | 0 | (580) | (580) | (0,01) |
| | 07.2022 | 1.894 | £ 1.511 | 0 | (59) | (59) | 0,00 |
| | 08.2022 | SGD 520 | $ 373 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CHF 883 | 921 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | € 28.987 | 30.869 | 564 | 0 | 564 | 0,01 |
| | 07.2022 | £ 5.948 | 7.229 | 10 | (5) | 5 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 148.448 | € 140.322 | 0 | (1.749) | (1.749) | (0,03) |
| | 07.2022 | 23.320 | £ 18.964 | 0 | (289) | (289) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | 12.122 | € 11.445 | 0 | (157) | (157) | 0,00 |
| | 07.2022 | 105.531 | £ 86.423 | 0 | (574) | (574) | (0,01) |
| | 08.2022 | SGD 140 | $ 102 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | € 40.801 | 43.807 | 1.152 | 0 | 1.152 | 0,02 |
| | 07.2022 | $ 2.622 | € 2.456 | 0 | (55) | (55) | 0,00 |
| GLM | 09.2022 | 377 | HKD 2.950 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPM | 08.2022 | SGD | 1.212 | $ | 881 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 19 | CNH | 127 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | AUD | 724 | $ | 523 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 07.2022 | CAD | 2.092 | | 1.657 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 253.687 | | 272.437 | 7.286 | (66) | 7.220 | 0,12 |
| | 07.2022 | £ | 2.695 | | 3.314 | 41 | 0 | 41 | 0,00 |
| | 07.2022 | SEK | 5.705 | $ | 584 | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 671 | AUD | 974 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.150.932 | € | 1.094.042 | 0 | (7.165) | (7.165) | (0,12) |
| | 07.2022 | | 7.804 | £ | 6.313 | 0 | (137) | (137) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 974 | $ | 671 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 1.094.042 | | 1.153.025 | 7.146 | 0 | 7.146 | 0,12 |
| | 08.2022 | $ | 43 | CNH | 288 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 05.2023 | | 43 | | 290 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | £ | 9 | $ | 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | SGD | 84 | | 61 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 103 | CHF | 98 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 601 | € | 572 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 902 | £ | 744 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| RBC | 07.2022 | | 4.120 | CAD | 5.297 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 5.297 | $ | 4.120 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 320 | | 48 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | € | 402.666 | | 431.270 | 10.303 | 0 | 10.303 | 0,17 |
| | 07.2022 | £ | 31.235 | | 38.362 | 429 | 0 | 429 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 76 | CNH | 511 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | CAD | 22.834 | $ | 17.878 | 176 | 0 | 176 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 656.563 | | 827.742 | 30.379 | 0 | 30.379 | 0,51 |
| | 07.2022 | $ | 12.434 | CAD | 15.996 | 3 | (36) | (33) | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 15.997 | $ | 12.434 | 35 | (2) | 33 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | € | 2.151.422 | | 2.311.744 | 62.540 | 0 | 62.540 | 1,06 |
| | | | | | | $ 120.377 | $ (10.894) | $ 109.483 | 1,85 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) ausschüttend, Investor 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | AUD | 26.063 | $ | 18.119 | $ 197 | $ 0 | $ 197 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 18.124 | AUD | 26.063 | 0 | (198) | (198) | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | AUD | 30.684 | $ | 21.307 | 207 | 0 | 207 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 31.526 | AUD | 43.788 | 0 | (1.415) | (1.415) | (0,02) |
| | 08.2022 | AUD | 238 | $ | 164 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 21.256 | AUD | 30.607 | 0 | (205) | (205) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | AUD | 475 | $ | 331 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | $ | 56 | AUD | 82 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | AUD | 6.040 | $ | 4.194 | 41 | 0 | 41 | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | | 10.901 | | 7.500 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 7.502 | AUD | 10.901 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | AUD | 1.838 | $ | 1.312 | 48 | 0 | 48 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 33.018 | | 45.947 | 0 | (1.423) | (1.423) | (0,02) |
| SCX | 07.2022 | AUD | 26.720 | $ | 18.378 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 18.309 | AUD | 26.618 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | AUD | 21.963 | $ | 15.126 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 14.221 | AUD | 20.659 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | | 30.997 | | 43.396 | 0 | (1.156) | (1.156) | (0,02) |
| | | | | | | $ 529 | $ (4.415) | $ (3.886) | (0,06) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | BRL | 50.714 | $ | 9.841 | $ 143 | $ 0 | $ 143 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 11.208 | BRL | 54.460 | 1 | (794) | (793) | (0,01) |
| | 08.2022 | BRL | 26 | $ | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 9.763 | BRL | 50.714 | 0 | (149) | (149) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | BRL | 50.714 | $ | 9.815 | 117 | 0 | 117 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 11.122 | BRL | 55.354 | 0 | (537) | (537) | (0,01) |
| | 08.2022 | BRL | 329 | $ | 62 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 9.737 | BRL | 50.714 | 0 | (123) | (123) | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | BRL | 12.769 | $ | 2.528 | 87 | 0 | 87 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 11.361 | BRL | 57.166 | 0 | (429) | (429) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 1.208 | | 6.313 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | BRL | 4.816 | $ | 971 | 50 | 0 | 50 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 57 | | 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | | 50.714 | | 9.863 | 165 | 0 | 165 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 654 | BRL | 3.191 | 0 | (44) | (44) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 9.784 | | 50.714 | 0 | (170) | (170) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | BRL | 1.694 | $ | 329 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 237 | BRL | 1.251 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | BRL | 1.251 | $ | 235 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | | | | | | $ 570 | $ (2.259) | $ (1.689) | (0,03) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die ausschüttende Investor CAD (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | CAD | 40 | $ | 31 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.123 | CAD | 1.425 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | | 1.136 | | 1.441 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | | 6 | | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | CAD | 36 | $ | 28 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | $ | 1.136 | CAD | 1.438 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | | | | | | $ 0 | $ (60) | $ (60) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | CHF | 485 | $ | 502 | $ 0 | $ (4) | $ (4) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 20.888 | CHF | 19.967 | 7 | (38) | (31) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CHF | 259 | $ | 266 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | $ | 20.804 | CHF | 19.913 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | CHF | 18.394 | $ | 19.365 | 151 | 0 | 151 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 20.804 | CHF | 19.955 | 40 | 0 | 40 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 19.365 | | 18.364 | 0 | (150) | (150) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | | 6 | | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | CHF | 933 | $ | 974 | 1 | (2) | (1) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | | 292 | | 298 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 10 | CHF | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 199 | $ (210) | $ (11) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend II, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class R EUR (Hedged) ausschüttend und Class T EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | € | 498 | $ | 535 | $ 14 | $ 0 | $ 14 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 24 | € | 23 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | € | 766.355 | $ | 806.098 | 4.911 | 0 | 4.911 | 0,08 |
| | 08.2022 | $ | 785.224 | € | 745.194 | 0 | (4.721 ) | (4.721 ) | (0,08 ) |
| CBK | 07.2022 | € | 3.998 | $ | 4.269 | 89 | 0 | 89 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 869 | € | 809 | 0 | (23 ) | (23 ) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | € | 777.621 | $ | 817.989 | 5.102 | (77 ) | 5.025 | 0,08 |
| | 07.2022 | $ | 867.816 | € | 805.304 | 0 | (25.910 ) | (25.910 ) | (0,44 ) |
| | 08.2022 | | 785.370 | | 745.194 | 0 | (4.867 ) | (4.867 ) | (0,08 ) |
| SOG | 07.2022 | | 834.569 | | 776.482 | 0 | (22.796 ) | (22.796 ) | (0,38 ) |
| UAG | 07.2022 | | 733.386 | | 682.473 | 0 | (19.895 ) | (19.895 ) | (0,33 ) |
| | | | | | | $ 10.116 | $ (78.289 ) | $ (68.173 ) | (1,15 ) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) ausschüttend und Class R GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | £ | 171 | $ | 215 | $ 7 | $ 0 | $ 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 49.058 | £ | 38.800 | 0 | (1.937) | (1.937) | (0,03) |
| BPS | 07.2022 | £ | 619 | $ | 752 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 795 | £ | 634 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | £ | 1.231 | $ | 1.513 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 49.227 | £ | 39.025 | 0 | (1.834) | (1.834) | (0,03) |
| CBK | 07.2022 | | 179 | | 143 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | £ | 136 | $ | 167 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 37 | £ | 29 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | £ | 67 | $ | 81 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | $ | 80 | £ | 65 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | £ | 36.892 | $ | 44.897 | 94 | 0 | 94 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 44.918 | £ | 36.892 | 0 | (93) | (93) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | | 48.532 | | 38.495 | 0 | (1.781) | (1.781) | (0,03) |
| | | | | | | $ 120 | $ (5.679) | $ (5.559) | (0,09 ) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional RMB (Hedged) ausschüttend und Investor 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 | 07.2022 | $ | 1.773 | CNH | 11.846 | $ 0 | $ (6) | $ (6) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | | 1.794 | | 11.970 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.617 | | 10.844 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | | 1.577 | | 10.529 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| IND | 07.2022 | CNH | 316 | $ | 47 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | | 172 | | 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 0 | $ (21) | $ (21) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend und M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | SGD | 19.408 | $ | 13.965 | $ 20 | $ 0 | $ 20 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 32.144 | SGD | 44.042 | 0 | (498) | (498) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 13.965 | | 19.407 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | SGD | 38.924 | $ | 28.017 | 48 | 0 | 48 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 29 | SGD | 40 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 28.017 | | 38.925 | 0 | (47) | (47) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | SGD | 3.483 | $ | 2.516 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 164 | SGD | 226 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | SGD | 168 | $ | 121 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 57 | SGD | 79 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | SGD | 900 | $ | 656 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | $ | 32.012 | SGD | 43.750 | 0 | (576) | (576) | (0,01) |
| UAG | 07.2022 | | 33.506 | | 45.883 | 0 | (537) | (537) | (0,01) |
| | | | | | | $ 91 | $ (1.679) | $ (1.588) | (0,03) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 15.091** | **0,26** |
| **Summe Anlagen** | **$ 6.345.852** | **106,63** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ (394.791)** | **(6,63)** |
| **Nettovermögen** | **$ 5.951.061** | **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)** **Wertpapier per Emissionstermin.**

**(b)** **Nullkuponwertpapier.**

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

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

**(e)** **Mit dem Fonds verbunden.**

**(f)** **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(g)** **Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeits-datum | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Bank of Nova Scotia | 3,625 % | 27.10.2081 | 29.09.2021 | $ 21.700 | $ 16.436 | 0,28 |

**(h)** **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 548.768 und Barmittel in Höhe von USD 1.263 als Sicherheiten verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 12.535 als Sicherheiten erhalten.**

**Barmittel in Höhe von USD 97.668 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 62.475 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 6.292.114 | $ 0 | $ 6.292.114 |
| Investmentfonds | 11.600 | 0 | 0 | 11.600 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 8.494 | 0 | 8.494 |
| Finanzderivate[3] | 7.578 | 26.066 | 0 | 33.644 |
| **Summen** | **$ 19.178** | **$ 6.326.674** | **$ 0** | **$ 6.345.852** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 231.912 | $ 8.191.098 | $ 0 | $ 8.423.010 |
| Investmentfonds | 481.206 | 0 | 0 | 481.206 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 62.523 | 0 | 62.523 |
| Finanzderivate[3] | 11.041 | 3.107 | 0 | 14.148 |
| **Summen** | **$ 724.159** | **$ 8.256.728** | **$ 0** | **$ 8.980.887** |

(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 2022:**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 1,200 % | 06.05.2022 | 05.05.2024 | $ (3.457) | $ (3.460) | (0,06) |
| BRC | (5,500) | 10.03.2022 | 08.03.2024 | € (1.752) | (1.800) | (0,03) |
| FBF | (1,450) | 09.06.2022 | 09.06.2024 | (6.758) | (7.066) | (0,12) |
| | (1,000) | 10.06.2022 | 09.06.2024 | (8.440) | (8.818) | (0,15) |
| JML | (5,500) | 10.03.2022 | 08.03.2024 | (1.692) | (1.737) | (0,03) |
| | (5,000) | 24.06.2022 | 22.06.2024 | (555) | (579) | (0,01) |
| | (3,250) | 24.06.2022 | 22.06.2024 | (6.543) | (6.836) | (0,11) |
| | (3,000) | 12.05.2022 | 11.05.2024 | (3.603) | (3.751) | (0,06) |
| | (3,000) | 24.06.2022 | 22.06.2024 | (3.531) | (3.690) | (0,06) |
| | 1,500 | 13.05.2022 | 10.08.2022 | $ (130.481) | (130.747) | (2,20) |
| | 1,500 | 18.05.2022 | 10.08.2022 | (15.357) | (15.385) | (0,26) |
| | 1,500 | 30.06.2022 | 10.08.2022 | (26.276) | (26.277) | (0,44) |
| MEI | (3,000) | 06.04.2022 | 01.04.2024 | € (1.906) | (1.978) | (0,03) |
| SCX | 1,820 | 10.06.2022 | 09.09.2022 | $ (182.304) | (182.497) | (3,07) |
| | 1,850 | 10.06.2022 | 01.07.2022 | (16.006) | (16.024) | (0,27) |
| | 1,850 | 10.06.2022 | 09.09.2022 | (149.777) | (149.938) | (2,52) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (560.583)** | **(9,42)** |

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ (1) | $ 0 | $ (1) |
| BOA | (5.447) | 5.390 | (57) |
| BPS | (4.711) | 3.740 | (971) |
| BRC | (2.552) | 2.504 | (48) |
| CBK | (2.608) | 2.707 | 99 |
| DUB | 82 | 0 | 82 |
| GLM | (352) | 260 | (92) |
| GST | (565) | 522 | (43) |
| JPM | (5.867) | 5.450 | (417) |
| MBC | (19.921) | 18.322 | (1.599) |
| MYI | (42) | (20) | (62) |
| SCX | 10.134 | (9.130) | 1.004 |
| SOG | (22.795) | 23.580 | 785 |
| TOR | 28.786 | (30.100) | (1.314) |
| UAG | 40.950 | (36.704) | 4.246 |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2022:

| | 30-Jun-2022 (%) | 31-Dec-2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 85,54 | 81,02 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 18,21 | 11,44 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 1,98 | k. A. |
| Investmentfonds | 0,19 | 5,28 |
| Pensionsgeschäfte | 0,14 | 0,69 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,00 | 0,16 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,31 | 0,11 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,26 | (0,12) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (9,42) | (0,26) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Österreich | 1,75 | 1,19 |
| Belgien | 1,14 | 0,99 |
| Kanada | 1,04 | 0,82 |
| Cayman-Inseln | 0,09 | 0,06 |
| China | 0,01 | k. A. |
| Dänemark | 0,41 | 0,58 |
| Finnland | 0,68 | 0,42 |
| Frankreich | 11,11 | 8,34 |
| Deutschland | 3,83 | 2,68 |
| Hongkong | 0,07 | 0,02 |
| Irland | 3,66 | 2,75 |
| Israel | 0,25 | 0,19 |
| Italien | 8,32 | 7,95 |
| Japan | k. A. | 0,21 |
| Jersey, Kanalinseln | 1,65 | 1,44 |
| Luxemburg | 1,08 | 1,16 |
| Mexiko | 0,66 | 0,47 |
| Niederlande | 15,21 | 13,49 |
| Norwegen | 0,35 | 0,12 |
| Portugal | 0,18 | 0,13 |
| Slowenien | 0,44 | 0,35 |
| Spanien | 9,99 | 10,15 |
| Schweden | 0,68 | 0,74 |
| Schweiz | 8,43 | 7,68 |
| Großbritannien | 19,82 | 22,43 |
| USA | 1,72 | 3,97 |
| Kurzfristige Instrumente | 13,16 | 4,13 |
| Investmentfonds | 0,19 | 5,28 |
| Pensionsgeschäfte | 0,14 | 0,69 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,00 | 0,16 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,03 ) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,52 ) | 0,02 |
| Zinsswaps | 0,86 | 0,09 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,18 ) | (0,01 ) |
| Total Return Swaps auf Indizes | (0,05 ) | k. A. |
| Devisenterminkontrakte | 1,85 | (0,55 ) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (1,36 ) | 0,44 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (6,63 ) | 1,42 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Climate Bond Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **GPT Wholesale Office Fund** | | | | |
| 3,222 % fällig am 05.11.2031 | AUD | 500 | $ 277 | 0,10 |
| **Lendlease Finance Ltd.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 27.10.2027 | | 930 | 572 | 0,21 |
| 3,700 % fällig am 31.03.2031 | | 200 | 113 | 0,04 |
| **Woolworths Group Ltd.** | | | | |
| 0,375 % fällig am 15.11.2028 | € | 2.100 | 1.783 | 0,65 |
| Summe Australien | | | 2.745 | 1,00 |
| **ÖSTERREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Erste Group Bank AG** | | | | |
| 0,125 % fällig am 17.05.2028 | | 700 | 615 | 0,23 |
| **BELGIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **KBC Group NV** | | | | |
| 0,250 % fällig am 01.03.2027 | | 1.300 | 1.219 | 0,44 |
| **Proximus SADP** | | | | |
| 0,750 % fällig am 17.11.2036 | | 500 | 374 | 0,14 |
| Summe Belgien | | | 1.593 | 0,58 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Klabin Austria GmbH** | | | | |
| 3,200 % fällig am 12.01.2031 | $ | 1.000 | 764 | 0,28 |
| **Suzano Austria GmbH** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.01.2032 | | 275 | 208 | 0,08 |
| Summe Brasilien | | | 972 | 0,36 |
| **KANADA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Telus Corp.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 13.05.2032 | | 1.900 | 1.707 | 0,62 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Canada Government International Bond** | | | | |
| 2,250 % fällig am 01.12.2029 | CAD | 2.800 | 2.044 | 0,75 |
| Summe Kanada | | | 3.751 | 1,37 |
| **CHILE** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Chile Government International Bond** | | | | |
| 0,830 % fällig am 02.07.2031 | € | 2.100 | 1.719 | 0,63 |
| 2,750 % fällig am 31.01.2027 | $ | 800 | 748 | 0,27 |
| 3,500 % fällig am 15.04.2053 | | 400 | 304 | 0,11 |
| Summe Chile | | | 2.771 | 1,01 |
| **CHINA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Contemporary Ruiding Development Ltd.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 09.09.2026 | | 1.300 | 1.147 | 0,42 |
| **FINNLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Castellum Helsinki Finance Holding Abp** | | | | |
| 0,875 % fällig am 17.09.2029 | € | 400 | 285 | 0,10 |
| **Kojamo Oyj** | | | | |
| 0,875 % fällig am 28.05.2029 | | 2.900 | 2.020 | 0,74 |
| **SBB Treasury Oyj** | | | | |
| 1,125 % fällig am 26.11.2029 | | 900 | 567 | 0,21 |
| **Tornator Oyj** | | | | |
| 1,250 % fällig am 14.10.2026 | | 200 | 198 | 0,07 |
| Summe Finnland | | | 3.070 | 1,12 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AXA S.A.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 16.01.2054 | £ | 480 | 554 | 0,20 |
| **Banque Federative du Credit Mutuel S.A.** | | | | |
| 0,250 % fällig am 29.06.2028 | € | 100 | $ 90 | 0,03 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 04.06.2026 | | 4.400 | 4.286 | 1,56 |
| 1,675 % fällig am 30.06.2027 | $ | 500 | 441 | 0,16 |
| 4,625 % fällig am 25.02.2031 (d)(e) | | 1.900 | 1.407 | 0,51 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 14.01.2028 | € | 900 | 826 | 0,30 |
| **CNP Assurances** | | | | |
| 2,000 % fällig am 27.07.2050 | | 200 | 173 | 0,06 |
| 4,875 % fällig am 07.10.2030 (d)(e) | $ | 800 | 627 | 0,23 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 0,125 % fällig am 09.12.2027 | € | 100 | 88 | 0,03 |
| **Faurecia SE** | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.06.2029 | | 1.500 | 1.107 | 0,40 |
| 2,750 % fällig am 15.02.2027 | | 500 | 409 | 0,15 |
| **Ile-de-France Mobilites** | | | | |
| 0,400 % fällig am 28.05.2031 | | 800 | 724 | 0,26 |
| **SEB S.A.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 16.06.2025 | | 600 | 602 | 0,22 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 0,625 % fällig am 02.12.2027 | | 1.200 | 1.108 | 0,41 |
| **Valeo** | | | | |
| 1,000 % fällig am 03.08.2028 | | 1.200 | 980 | 0,36 |
| 1,625 % fällig am 18.03.2026 | | 600 | 567 | 0,21 |
| **Verallia S.A.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 14.05.2028 | | 1.300 | 1.121 | 0,41 |
| 1,875 % fällig am 10.11.2031 | | 400 | 313 | 0,12 |
| | | | 15.423 | 5,62 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Agence Francaise de Developpement** | | | | |
| 1,375 % fällig am 17.09.2024 | | 1.000 | 1.050 | 0,38 |
| **France Government International Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 25.06.2044 | | 850 | 602 | 0,22 |
| **Societe Du Grand Paris EPIC** | | | | |
| 0,300 % fällig am 25.11.2031 | | 1.900 | 1.677 | 0,61 |
| 1,000 % fällig am 18.02.2070 | | 100 | 54 | 0,02 |
| **Societe Nationale SNCF S.A.** | | | | |
| 0,625 % fällig am 17.04.2030 | | 800 | 753 | 0,28 |
| | | | 4.136 | 1,51 |
| Summe Frankreich | | | 19.559 | 7,13 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Commerzbank AG** | | | | |
| 3,000 % fällig am 14.09.2027 | | 500 | 511 | 0,19 |
| **Deutsche Bahn Finance GmbH** | | | | |
| 0,625 % fällig am 08.12.2050 | | 50 | 28 | 0,01 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 1,875 % fällig am 23.02.2028 | | 1.900 | 1.794 | 0,65 |
| **E.ON SE** | | | | |
| 0,875 % fällig am 18.10.2034 | | 400 | 312 | 0,11 |
| **Infineon Technologies AG** | | | | |
| 2,000 % fällig am 24.06.2032 | | 200 | 185 | 0,07 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.09.2028 (b) | | 100 | 94 | 0,03 |
| 1,375 % fällig am 07.06.2032 | | 13.700 | 13.496 | 4,92 |
| 2,000 % fällig am 15.11.2029 (a) | | 2.400 | 2.539 | 0,93 |
| **Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen** | | | | |
| 1,000 % fällig am 26.05.2042 | | 700 | 527 | 0,19 |
| **ProGroup AG** | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.03.2026 | | 1.000 | 924 | 0,34 |
| **Schaeffler AG** | | | | |
| 3,375 % fällig am 12.10.2028 | | 1.700 | 1.446 | 0,53 |
| **Vonovia SE** | | | | |
| 2,375 % fällig am 25.03.2032 | | 2.700 | 2.326 | 0,85 |
| **ZF Finance GmbH** | | | | |
| 2,000 % fällig am 06.05.2027 | | 800 | 647 | 0,24 |
| 2,250 % fällig am 03.05.2028 | | 600 | 463 | 0,17 |
| | | | 25.292 | 9,23 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.08.2031 (b) | € | 1.400 | $1.301 | 0,47 |
| **Land Nordrhein-Westfalen** | | | | |
| 0,000 % fällig am 12.10.2035 (b) | | 20 | 15 | 0,01 |
| | | | 1.316 | 0,48 |
| Summe Deutschland | | | 26.608 | 9,71 |
| **INDIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Indian Railway Finance Corp. Ltd.** | | | | |
| 3,570 % fällig am 21.01.2032 | $ | 1.000 | 857 | 0,31 |
| **JSW Hydro Energy Ltd.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 18.05.2031 | | 276 | 220 | 0,08 |
| **ReNew Power Pvt Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 05.03.2027 | | 1.400 | 1.283 | 0,47 |
| **ReNew Wind Energy AP2** | | | | |
| 4,500 % fällig am 14.07.2028 | | 1.700 | 1.333 | 0,49 |
| Summe Indien | | | 3.693 | 1,35 |
| **IRLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AIB Group PLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 30.05.2031 | € | 600 | 569 | 0,21 |
| **Johnson Controls International PLC** | | | | |
| 2,000 % fällig am 16.09.2031 | $ | 1.400 | 1.116 | 0,41 |
| **Smurfit Kappa Treasury ULC** | | | | |
| 0,500 % fällig am 22.09.2029 | € | 1.000 | 834 | 0,30 |
| **Zurich Finance Ireland Designated Activity Co.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 19.04.2051 | $ | 650 | 519 | 0,19 |
| 3,500 % fällig am 02.05.2052 | | 1.200 | 975 | 0,35 |
| Summe Irland | | | 4.013 | 1,46 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Assicurazioni Generali SpA** | | | | |
| 4,125 % fällig am 04.05.2026 | € | 1.400 | 1.468 | 0,54 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 0,750 % fällig am 04.12.2024 | | 600 | 602 | 0,22 |
| 0,750 % fällig am 16.03.2028 | | 1.400 | 1.243 | 0,45 |
| | | | 3.313 | 1,21 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 1,500 % fällig am 30.04.2045 | | 1.050 | 755 | 0,27 |
| Summe Italien | | | 4.068 | 1,48 |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **East Japan Railway Co.** | | | | |
| 1,104 % fällig am 15.09.2039 | | 800 | 588 | 0,22 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | |
| 0,848 % fällig am 19.07.2029 | | 800 | 704 | 0,26 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | |
| 3,261 % fällig am 22.05.2030 | $ | 800 | 718 | 0,26 |
| **Norinchukin Bank** | | | | |
| 2,080 % fällig am 22.09.2031 | | 1.000 | 817 | 0,30 |
| **NTT Finance Corp.** | | | | |
| 0,399 % fällig am 13.12.2028 | € | 1.300 | 1.181 | 0,43 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | |
| 2,472 % fällig am 14.01.2029 | $ | 1.300 | 1.133 | 0,41 |
| **Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.** | | | | |
| 2,800 % fällig am 10.03.2027 | | 800 | 751 | 0,27 |
| | | | 5.892 | 2,15 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Japan Finance Organization for Municipalities** | | | | |
| 0,010 % fällig am 02.02.2028 | € | 400 | 375 | 0,14 |
| Summe Japan | | | 6.267 | 2,29 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Aptiv PLC** | | | | | |
| 3,100 % fällig am 01.12.2051 | $ | 200 | $ | 129 | 0,05 |
| 4,350 % fällig am 15.03.2029 | | 1.000 | | 947 | 0,34 |
| Summe Jersey, Kanalinseln | | | | 1.076 | 0,39 |
| **LUXEMBURG** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Acef Holding S.C.A.** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 14.06.2028 | € | 2.100 | | 1.767 | 0,64 |
| **CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 27.01.2028 | | 1.200 | | 1.038 | 0,38 |
| 0,900 % fällig am 12.10.2029 | | 1.500 | | 1.243 | 0,45 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 14.01.2030 | | 600 | | 445 | 0,16 |
| 2,750 % fällig am 22.01.2028 | £ | 900 | | 845 | 0,31 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 17.01.2034 | € | 1.100 | | 812 | 0,29 |
| **NE Property BV** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 20.01.2030 | | 1.400 | | 1.042 | 0,38 |
| **Prologis International Funding S.A.** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 23.03.2033 | | 475 | | 348 | 0,13 |
| 0,875 % fällig am 09.07.2029 | | 125 | | 109 | 0,04 |
| 1,625 % fällig am 17.06.2032 | | 1.425 | | 1.177 | 0,43 |
| 2,750 % fällig am 22.02.2032 | £ | 200 | | 215 | 0,08 |
| **Segro Capital SARL** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 22.09.2031 | € | 1.000 | | 786 | 0,29 |
| **SELP Finance SARL** | | | | | |
| 0,875 % fällig am 27.05.2029 | | 1.000 | | 841 | 0,31 |
| Summe Luxemburg | | | | 10.668 | 3,89 |
| **MAURITIUS** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Azure Power Energy Ltd.** | | | | | |
| 3,575 % fällig am 19.08.2026 | $ | 1.253 | | 1.038 | 0,38 |
| **Greenko Power Ltd.** | | | | | |
| 4,300 % fällig am 13.12.2028 | | 489 | | 392 | 0,14 |
| **Greenko Solar Mauritius Ltd.** | | | | | |
| 5,950 % fällig am 29.07.2026 | | 1.000 | | 894 | 0,33 |
| **India Green Energy Holdings** | | | | | |
| 5,375 % fällig am 29.04.2024 | | 2.100 | | 1.965 | 0,72 |
| **India Green Power Holdings** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 22.02.2027 | | 400 | | 313 | 0,11 |
| Summe Mauritius | | | | 4.602 | 1,68 |
| **MEXIKO** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Nemak S.A.B. de C.V.** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 20.07.2028 | € | 1.000 | | 752 | 0,27 |
| **MULTINATIONAL** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.09.2028 | | 500 | | 415 | 0,15 |
| 3,000 % fällig am 01.09.2029 | | 150 | | 117 | 0,05 |
| **NXP BV** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 11.05.2031 | $ | 1.200 | | 988 | 0,36 |
| 5,000 % fällig am 15.01.2033 | | 1.100 | | 1.075 | 0,39 |
| Summe multinational | | | | 2.595 | 0,95 |
| **NIEDERLANDE** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | | |
| 2,470 % fällig am 13.12.2029 | | 3.400 | | 2.901 | 1,06 |
| **Atrium Finance Issuer BV** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.09.2027 | € | 1.100 | | 931 | 0,34 |
| **Citycon Treasury BV** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 12.03.2028 | | 1.500 | | 1.156 | 0,42 |
| **CTP NV** | | | | | |
| 1,250 % fällig am 21.06.2029 | | 2.300 | | 1.680 | 0,61 |
| **Digital Intrepid Holding BV** | | | | | |
| 0,625 % fällig am 15.07.2031 | | 1.500 | | 1.109 | 0,40 |
| **DSV Finance BV** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 03.03.2031 | € | 500 | $ | 408 | 0,15 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Enel Finance International NV** | | | | |
| 0,000 % fällig am 17.06.2027 (b) | | 600 | 544 | 0,20 |
| 0,875 % fällig am 28.09.2034 | | 1.300 | 946 | 0,35 |
| 1,375 % fällig am 12.07.2026 | $ | 1.000 | 879 | 0,32 |
| **Global Switch Finance BV** | | | | |
| 1,375 % fällig am 07.10.2030 | € | 400 | 341 | 0,12 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 1,125 % fällig am 07.12.2028 | £ | 200 | 204 | 0,07 |
| 4,875 % fällig am 16.05.2029 (d)(e) | $ | 2.600 | 2.130 | 0,78 |
| **JDE Peet's NV** | | | | |
| 2,250 % fällig am 24.09.2031 | | 1.000 | 782 | 0,29 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 0,250 % fällig am 23.02.2026 | € | 2.000 | 1.871 | 0,68 |
| 0,250 % fällig am 07.09.2026 | | 1.400 | 1.282 | 0,47 |
| 1,375 % fällig am 07.03.2024 | | 100 | 103 | 0,04 |
| 3,500 % fällig am 09.04.2025 | | 700 | 742 | 0,27 |
| **Lseg Netherlands BV** | | | | |
| 0,250 % fällig am 06.04.2028 | | 400 | 363 | 0,13 |
| **Mondelez International Holdings Netherlands BV** | | | | |
| 1,250 % fällig am 09.09.2041 | | 1.000 | 657 | 0,24 |
| **Nationale-Nederlanden Bank NV** | | | | |
| 0,500 % fällig am 21.09.2028 | | 1.100 | 962 | 0,35 |
| **Thermo Fisher Scientific Finance BV** | | | | |
| 0,000 % fällig am 18.11.2025 (b) | | 1.400 | 1.359 | 0,50 |
| **Vesteda Finance BV** | | | | |
| 0,750 % fällig am 18.10.2031 | | 1.200 | 962 | 0,35 |
| **VIA Outlets BV** | | | | |
| 1,750 % fällig am 15.11.2028 | | 1.100 | 961 | 0,35 |
| **Volkswagen International Finance NV** | | | | |
| 3,750 % fällig am 28.09.2027 | | 600 | 636 | 0,23 |
| **Wabtec Transportation Netherlands BV** | | | | |
| 1,250 % fällig am 03.12.2027 | | 1.900 | 1.627 | 0,59 |
| Summe Niederlande | | | 25.536 | 9,31 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 25.03.2027 | $ | 686 | 547 | 0,20 |
| **Continuum Energy Levanter Pte. Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 09.02.2027 | | 986 | 780 | 0,28 |
| Summe Singapur | | | 1.327 | 0,48 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **SK Hynix, Inc.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 19.01.2031 | | 300 | 237 | 0,09 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Korea Water Resources Corp.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 27.04.2025 | | 700 | 695 | 0,25 |
| Summe Südkorea | | | 932 | 0,34 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Acciona Energia Financiacion Filiales S.A.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 26.01.2032 | € | 500 | 427 | 0,15 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 14.05.2025 | | 200 | 203 | 0,07 |
| **Banco de Sabadell S.A.** | | | | |
| 0,875 % fällig am 16.06.2028 | | 1.500 | 1.287 | 0,47 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 0,625 % fällig am 24.06.2029 | | 900 | 790 | 0,29 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 0,375 % fällig am 18.11.2026 | | 400 | 377 | 0,14 |
| 0,500 % fällig am 09.02.2029 | | 100 | 86 | 0,03 |
| 0,750 % fällig am 26.05.2028 | | 900 | 812 | 0,30 |
| 1,500 % fällig am 03.12.2026 | £ | 600 | 657 | 0,24 |
| **Iberdrola Finanzas S.A.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 07.03.2024 | € | 1.100 | 1.147 | 0,42 |
| | | | 5.786 | 2,11 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Adif Alta Velocidad** | | | | | |
| 0,550 % fällig am 31.10.2031 | € | 900 | $ | 789 | 0,29 |
| **Spain Government International Bond** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 30.07.2042 | | 1.700 | | 1.268 | 0,46 |
| **Xunta de Galicia** | | | | | |
| 0,084 % fällig am 30.07.2027 | | 50 | | 48 | 0,02 |
| | | | | 2.105 | 0,77 |
| Summe Spanien | | | | 7.891 | 2,88 |
| **SUPRANATIONAL** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 28.07.2026 (b) | | 100 | | 98 | 0,04 |
| 0,010 % fällig am 23.06.2028 | | 2.000 | | 1.878 | 0,68 |
| 0,150 % fällig am 10.10.2034 | | 500 | | 399 | 0,15 |
| **Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 13.02.2025 | $ | 1.240 | | 1.191 | 0,43 |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.07.2027 | AUD | 500 | | 291 | 0,11 |
| 1,500 % fällig am 15.06.2032 | € | 5.600 | | 5.538 | 2,02 |
| **Europäische Union** | | | | | |
| 0,300 % fällig am 04.11.2050 | | 100 | | 60 | 0,02 |
| 0,400 % fällig am 04.02.2037 | | 800 | | 641 | 0,23 |
| 2,625 % fällig am 04.02.2048 | | 200 | | 219 | 0,08 |
| **Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 03.03.2025 | $ | 1.000 | | 976 | 0,36 |
| **International Development Association** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 21.09.2028 | £ | 1.450 | | 1.587 | 0,58 |
| Summe Supranational | | | | 12.878 | 4,70 |
| **SCHWEDEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Castellum AB** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 04.09.2026 | € | 1.100 | | 919 | 0,34 |
| **EQT AB** | | | | | |
| 0,875 % fällig am 14.05.2031 | | 1.200 | | 918 | 0,33 |
| | | | | 1.837 | 0,67 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Svensk Exportkredit AB** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 30.06.2027 | | 1.100 | | 1.158 | 0,42 |
| Summe Schweden | | | | 2.995 | 1,09 |
| **SCHWEIZ** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **UBS AG** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (e) | $ | 2.600 | | 2.599 | 0,95 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Assura Financing PLC** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.06.2033 | £ | 1.100 | | 1.036 | 0,38 |
| **Atlantica Sustainable Infrastructure PLC** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.06.2028 | $ | 900 | | 785 | 0,29 |
| **Berkeley Group PLC** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 11.08.2031 | £ | 1.300 | | 1.165 | 0,43 |
| **British Land Co. PLC** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 14.09.2029 | | 1.400 | | 1.527 | 0,56 |
| **Burberry Group PLC** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 21.09.2025 | | 600 | | 671 | 0,24 |
| **Chanel Ceres PLC** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 31.07.2031 | € | 2.200 | | 1.902 | 0,69 |
| **Derwent London PLC** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 17.11.2031 | £ | 1.200 | | 1.185 | 0,43 |
| **Grainger PLC** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 24.04.2028 | | 700 | | 767 | 0,28 |
| **Lendlease Europe Finance PLC** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 02.12.2033 | | 800 | | 761 | 0,28 |
| **London & Quadrant Housing Trust** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 31.03.2032 | | 400 | | 422 | 0,15 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Marks & Spencer PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 19.05.2026 | £ | 800 | $ 855 | 0,31 |
| 4,500 % fällig am 10.07.2027 | | 300 | 312 | 0,11 |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 2,057 % fällig am 09.11.2028 | | 1.200 | 1.276 | 0,47 |
| **Reckitt Benckiser Treasury Services PLC** | | | | |
| 1,750 % fällig am 19.05.2032 | | 500 | 524 | 0,19 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 2,896 % fällig am 15.03.2032 | $ | 3.400 | 2.824 | 1,03 |
| **Severn Trent Utilities Finance PLC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 22.02.2033 | £ | 600 | 651 | 0,24 |
| **South Eastern Power Networks PLC** | | | | |
| 1,750 % fällig am 30.09.2034 | | 2.100 | 1.984 | 0,72 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 0,800 % fällig am 17.11.2029 | € | 1.800 | 1.551 | 0,57 |
| **Tesco Corporate Treasury Services PLC** | | | | |
| 0,375 % fällig am 27.07.2029 | | 1.300 | 1.053 | 0,38 |
| 1,875 % fällig am 02.11.2028 | £ | 700 | 724 | 0,26 |
| **Travis Perkins PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 17.02.2026 | | 1.100 | 1.165 | 0,43 |
| **Vmed O2 UK Financing PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.07.2031 | $ | 2.400 | 1.944 | 0,71 |
| **Vodafone Group PLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 04.06.2081 | | 950 | 636 | 0,23 |
| **Workspace Group PLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 11.03.2028 | £ | 400 | 400 | 0,15 |
| **Zenith Finco PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 30.06.2027 | | 700 | 687 | 0,25 |
| | | | 26.807 | 9,78 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 0,875 % fällig am 31.07.2033 | | 700 | 727 | 0,26 |
| Summe Großbritannien | | | 27.534 | 10,04 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust** | | | | |
| 2,100 % fällig am 20.05.2048 | $ | 1.133 | 979 | 0,36 |
| 4,000 % fällig am 20.04.2049 | | 1.078 | 1.022 | 0,38 |
| **Loanpal Solar Loan Ltd.** | | | | |
| 2,220 % fällig am 20.03.2048 | | 644 | 551 | 0,20 |
| | | | 2.552 | 0,94 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AES Corp.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 15.01.2026 | | 1.300 | 1.148 | 0,42 |
| 2,450 % fällig am 15.01.2031 | | 1.859 | 1.497 | 0,55 |
| **Alexandria Real Estate Equities, Inc.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 18.05.2032 | | 400 | 316 | 0,12 |
| 2,950 % fällig am 15.03.2034 | | 300 | 250 | 0,09 |
| 3,000 % fällig am 18.05.2051 | | 900 | 607 | 0,22 |
| **Allstate Corp.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 15.12.2030 | | 250 | 199 | 0,07 |
| **Amgen, Inc.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 22.02.2029 | | 1.300 | 1.200 | 0,44 |
| **Autodesk, Inc.** | | | | |
| 2,400 % fällig am 15.12.2031 | | 1.000 | 817 | 0,30 |
| **AvalonBay Communities, Inc.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 01.12.2028 | | 1.000 | 870 | 0,32 |
| 2,050 % fällig am 15.01.2032 | | 1.000 | 826 | 0,30 |
| **Avangrid, Inc.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 01.06.2029 | | 1.965 | 1.840 | 0,67 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 2,456 % fällig am 22.10.2025 | | 100 | 95 | 0,03 |
| **Boise Cascade Co.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.07.2030 | | 300 | 263 | 0,10 |
| **Boston Properties LP** | | | | |
| 2,450 % fällig am 01.10.2033 | | 1.900 | 1.462 | 0,53 |
| 2,550 % fällig am 01.04.2032 | | 900 | 717 | 0,26 |
| **CBRE Services, Inc.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.04.2031 | | 1.370 | 1.116 | 0,41 |
| **Chubb INA Holdings, Inc.** | | | | |
| 0,875 % fällig am 15.06.2027 | € | 200 | 191 | 0,07 |
| **Clearway Energy Operating LLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.02.2031 | $ | 1.100 | $ 890 | 0,32 |
| 3,750 % fällig am 15.01.2032 | | 900 | 715 | 0,26 |
| 4,750 % fällig am 15.03.2028 | | 100 | 90 | 0,03 |
| **Colgate-Palmolive Co.** | | | | |
| 0,300 % fällig am 10.11.2029 | € | 400 | 359 | 0,13 |
| **Community Preservation Corp.** | | | | |
| 2,867 % fällig am 01.02.2030 | $ | 360 | 321 | 0,12 |
| **Consolidated Edison Co. of New York, Inc.** | | | | |
| 3,350 % fällig am 01.04.2030 | | 1.025 | 956 | 0,35 |
| 3,950 % fällig am 01.04.2050 | | 725 | 630 | 0,23 |
| **Continental Wind LLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 28.02.2033 | | 352 | 374 | 0,14 |
| **Crown Cork & Seal Co., Inc.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 15.12.2026 | | 725 | 744 | 0,27 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 4,900 % fällig am 01.10.2026 | | 750 | 752 | 0,27 |
| 6,200 % fällig am 15.07.2030 | | 1.000 | 1.042 | 0,38 |
| **Dominion Energy, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.08.2031 | | 2.350 | 1.935 | 0,71 |
| **DTE Electric Co.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 01.04.2028 | | 2.200 | 1.963 | 0,72 |
| **Duke Energy Carolinas LLC** | | | | |
| 2,850 % fällig am 15.03.2032 | | 900 | 800 | 0,29 |
| **Duke Energy Florida LLC** | | | | |
| 2,400 % fällig am 15.12.2031 | | 850 | 728 | 0,27 |
| **Equinix, Inc.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 15.03.2033 | € | 500 | 387 | 0,14 |
| 1,550 % fällig am 15.03.2028 | $ | 620 | 522 | 0,19 |
| 2,500 % fällig am 15.05.2031 | | 700 | 568 | 0,21 |
| **ERP Operating LP** | | | | |
| 1,850 % fällig am 01.08.2031 | | 700 | 575 | 0,21 |
| **Farmers Exchange Capital** | | | | |
| 5,454 % fällig am 15.10.2054 | | 30 | 30 | 0,01 |
| **Ford Motor Co.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.02.2032 | | 200 | 150 | 0,05 |
| **Gap, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.10.2029 | | 1.250 | 880 | 0,32 |
| 3,875 % fällig am 01.10.2031 | | 500 | 350 | 0,13 |
| **Georgia Power Co.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.03.2051 | | 800 | 589 | 0,21 |
| **Goodman U.S. Finance Five LLC** | | | | |
| 4,625 % fällig am 04.05.2032 | | 1.000 | 982 | 0,36 |
| **Hanwha Energy USA Holdings Corp.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 30.07.2022 | | 400 | 400 | 0,15 |
| **HAT Holdings LLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.09.2030 | | 3.200 | 2.558 | 0,93 |
| 6,000 % fällig am 15.04.2025 | | 500 | 480 | 0,17 |
| **Healthpeak Properties, Inc.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 01.12.2028 | | 700 | 605 | 0,22 |
| **Hilton Domestic Operating Co., Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.05.2031 | | 500 | 417 | 0,15 |
| **Host Hotels & Resorts LP** | | | | |
| 2,900 % fällig am 15.12.2031 | | 700 | 557 | 0,20 |
| 3,375 % fällig am 15.12.2029 | | 600 | 508 | 0,19 |
| 3,500 % fällig am 15.09.2030 | | 2.075 | 1.775 | 0,65 |
| **Hudson Pacific Properties LP** | | | | |
| 3,950 % fällig am 01.11.2027 | | 1.000 | 953 | 0,35 |
| **Kellogg Co.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 20.05.2029 | € | 900 | 797 | 0,29 |
| **Kilroy Realty LP** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.11.2032 | $ | 4.000 | 3.127 | 1,14 |
| 2,650 % fällig am 15.11.2033 | | 300 | 233 | 0,08 |
| **Kimco Realty Corp.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 01.10.2030 | | 1.125 | 969 | 0,35 |
| **Leeward Renewable Energy Operations LLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.07.2029 | | 700 | 560 | 0,20 |
| **Liberty Utilities Finance GP** | | | | |
| 2,050 % fällig am 15.09.2030 | | 2.475 | 2.032 | 0,74 |
| **Merck & Co., Inc.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 10.12.2028 | | 700 | 623 | 0,23 |
| **Micron Technology, Inc.** | | | | |
| 2,703 % fällig am 15.04.2032 | | 625 | 499 | 0,18 |
| **MidAmerican Energy Co.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 01.08.2052 | | 950 | 685 | 0,25 |
| 4,250 % fällig am 15.07.2049 | | 400 | 372 | 0,14 |
| **Mississippi Power Co.** | | | | |
| 3,100 % fällig am 30.07.2051 | $ | 900 | $ 639 | 0,23 |
| **Moody's Corp.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 19.08.2031 | | 300 | 245 | 0,09 |
| 3,100 % fällig am 29.11.2061 | | 840 | 578 | 0,21 |
| **New York State Electric & Gas Corp.** | | | | |
| 2,150 % fällig am 01.10.2031 | | 1.100 | 909 | 0,33 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 15.06.2028 | | 2.100 | 1.828 | 0,67 |
| 2,200 % fällig am 02.12.2026 | AUD | 3.350 | 2.040 | 0,74 |
| **NiSource, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.06.2052 | $ | 300 | 294 | 0,11 |
| **Northern States Power Co.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 01.04.2031 | | 600 | 525 | 0,19 |
| 2,600 % fällig am 01.06.2051 | | 200 | 141 | 0,05 |
| **NSTAR Electric Co.** | | | | |
| 3,100 % fällig am 01.06.2051 | | 1.070 | 822 | 0,30 |
| **Oberlin College** | | | | |
| 2,874 % fällig am 01.10.2051 | | 1.800 | 1.246 | 0,45 |
| **Owens Corning** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.08.2029 | | 110 | 102 | 0,04 |
| **PacifiCorp** | | | | |
| 2,900 % fällig am 15.06.2052 | | 600 | 439 | 0,16 |
| **Pfizer, Inc.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 01.04.2030 | | 75 | 69 | 0,02 |
| **Public Service Co. of Colorado** | | | | |
| 2,700 % fällig am 15.01.2051 | | 75 | 53 | 0,02 |
| 3,200 % fällig am 01.03.2050 | | 25 | 20 | 0,01 |
| 3,700 % fällig am 15.06.2028 | | 1.000 | 986 | 0,36 |
| **Public Service Co. of Oklahoma** | | | | |
| 2,200 % fällig am 15.08.2031 | | 2.050 | 1.711 | 0,62 |
| **Rayonier LP** | | | | |
| 2,750 % fällig am 17.05.2031 | | 1.300 | 1.087 | 0,40 |
| **Regency Centers LP** | | | | |
| 3,700 % fällig am 15.06.2030 | | 200 | 182 | 0,07 |
| **Rexford Industrial Realty LP** | | | | |
| 2,150 % fällig am 01.09.2031 | | 400 | 315 | 0,11 |
| **salesforce.com, Inc.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.07.2028 | | 750 | 656 | 0,24 |
| **Solar Star Funding LLC** | | | | |
| 5,375 % fällig am 30.06.2035 | | 164 | 177 | 0,06 |
| **Southern California Edison Co.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.06.2031 | | 1.800 | 1.513 | 0,55 |
| **Southwestern Public Service Co.** | | | | |
| 3,150 % fällig am 01.05.2050 | | 450 | 344 | 0,13 |
| **Sunnova Energy Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.09.2026 | | 970 | 845 | 0,31 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.04.2026 | | 1.900 | 1.728 | 0,63 |
| **TerraForm Power Operating LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 31.01.2028 | | 1.650 | 1.498 | 0,55 |
| **Topaz Solar Farms LLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 30.09.2039 | | 841 | 765 | 0,28 |
| **UDR, Inc.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 15.03.2033 | | 900 | 681 | 0,25 |
| 3,100 % fällig am 01.11.2034 | | 150 | 123 | 0,04 |
| **Union Electric Co.** | | | | |
| 2,150 % fällig am 15.03.2032 | | 300 | 249 | 0,09 |
| 3,900 % fällig am 01.04.2052 | | 600 | 529 | 0,19 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | |
| 0,375 % fällig am 22.03.2029 | € | 800 | 711 | 0,26 |
| 1,500 % fällig am 18.09.2030 | $ | 4.110 | 3.289 | 1,20 |
| 2,850 % fällig am 03.09.2041 | | 900 | 676 | 0,25 |
| **Wisconsin Public Service Corp.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 01.12.2051 | | 450 | 328 | 0,12 |
| **WP Carey, Inc.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 01.02.2032 | | 800 | 645 | 0,24 |
| | | | 77.884 | 28,40 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **New York Water & Sewer System, New York Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | | |
| 5,724 % fällig am 15.06.2042 | | 170 | 201 | 0,07 |
| **New York Water & Sewer System, New York Revenue Bonds, Series 2010** | | | | |
| 5,882 % fällig am 15.06.2044 | | 110 | 134 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **San Francisco, California Public Utilities Commission Water Revenue Bonds, Series 2020** | | | |
| 1,988 % fällig am 01.11.2031 | $ 255 | $ 215 | 0,08 |
| 2,825 % fällig am 01.11.2041 | 145 | 115 | 0,04 |
| **State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020** | | | |
| 2,154 % fällig am 01.07.2030 | 170 | 148 | 0,06 |
| | | 813 | 0,30 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **U.S. Treasury Notes** | | | |
| 0,375 % fällig am 30.11.2025 | 7.490 | 6.843 | 2,50 |
| 1,125 % fällig am 15.01.2025 | $ 3.600 | $ 3.434 | 1,25 |
| | | 10.277 | 3,75 |
| Summe USA | | 91.526 | 33,39 |
| **JUNGFERNINSELN (BRITISCH)** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.** | | | |
| 6,750 % fällig am 24.04.2033 | 823 | 776 | 0,28 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **U.S. TREASURY BILLS** | | | |
| 0,900 % fällig am 28.07.2022 (b)(c)(f) | $ 118 | $ 118 | 0,04 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 118 | 0,04 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | **$ 274.677** | **100,19** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2022 | 207 | $ 702 | 0,25 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Short | 09/2022 | 9 | 67 | 0,02 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09/2022 | 28 | 17 | 0,01 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2022 | 186 | (178) | (0,06) |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09/2022 | 17 | 21 | 0,01 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09/2022 | 38 | 170 | 0,06 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09/2022 | 79 | 393 | 0,14 |
| | | | | $ 1.192 | 0,43 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 1.192** | **0,43** |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.06.2028 | € 200 | $ (9) | 0,00 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 % | 21.09.2052 | £ 1.100 | $ 190 | 0,07 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2027 | $ 3.200 | (41) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,000 | 16.06.2026 | CAD 900 | (51) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,840 | 08.07.2051 | $ 500 | 110 | 0,04 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,888 | 06.07.2051 | 200 | 42 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,943 | 15.06.2051 | 400 | 83 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,945 | 23.06.2051 | 100 | 21 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,968 | 23.06.2051 | 200 | 41 | 0,01 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2027 | € 2.400 | 117 | 0,04 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2052 | 2.400 | 586 | 0,21 |
| | | | | | $ 1.098 | 0,40 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 1.089** | **0,40** |

(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**

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 08.2022 | € 13.562 | $ 14.275 | $ 57 | $ (1) | $ 56 | 0,02 |
| | 08.2022 | £ 204 | 251 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 3.305 | € 3.092 | 0 | (64) | (64) | (0,02) |
| | 08.2022 | 371 | £ 297 | 0 | (11) | (11) | (0,01) |
| BPS | 08.2022 | CAD 582 | $ 450 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | € 747 | 791 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 353 | € 331 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | MXN 16.807 | $ 829 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | £ 125 | 152 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | 08.2022 | € 95.781 | 101.705 | 1.283 | 0 | 1.283 | 0,47 |
| | 08.2022 | £ 19.342 | 23.860 | 353 | 0 | 353 | 0,13 |
| GLM | 07.2022 | $ 462 | MXN 9.446 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| JPM | 08.2022 | € 5.879 | $ 6.309 | 145 | 0 | 145 | 0,05 |
| | 08.2022 | $ 582 | € 555 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 08.2022 | CAD 85 | $ 66 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 286 | € 266 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 08.2022 | 324 | £ 268 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | € 22 | $ 23 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ 2 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | SGD 6 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 17 | € 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 2.553 | £ 2.106 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | € 510 | $ 540 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| RBC | 08.2022 | AUD 5.087 | 3.616 | 117 | 0 | 117 | 0,04 |
| | 08.2022 | CAD 2.060 | 1.592 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| SCX | 08.2022 | € 798 | 847 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 331 | £ 265 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| UAG | 09.2022 | 376 | MXN 7.488 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | | | | $ 1.990 | $ (115) | $ 1.875 | 0,68 |

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | $ 348 | CHF 332 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | 12 | 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | 348 | 333 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 342 | 327 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | € 30 | $ 32 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | 54.861 | 57.706 | 352 | 0 | 352 | 0,13 |
| | 07.2022 | $ 321 | € 302 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 08.2022 | 57.060 | 54.151 | 0 | (343) | (343) | (0,12) |
| CBK | 07.2022 | € 15 | $ 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 390 | € 364 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | € 54.372 | $ 57.199 | 355 | 0 | 355 | 0,13 |
| | 07.2022 | $ 59.939 | € 55.582 | 0 | (1.831) | (1.831) | (0,67) |
| | 08.2022 | 57.071 | 54.151 | 0 | (354) | (354) | (0,13) |
| SOG | 07.2022 | 59.806 | 55.644 | 0 | (1.634) | (1.634) | (0,60) |
| UAG | 07.2022 | 51.114 | 47.566 | 0 | (1.387) | (1.387) | (0,51) |
| | | | | $ 708 | $ (5.564) | $ (4.856) | (1,77) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | £ 123 | $ 152 | $ 3 | $ 0 | $ 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 25.476 | £ 20.155 | 0 | (999) | (999) | (0,37) |
| BPS | 07.2022 | £ 253 | $ 309 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 160 | £ 128 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | £ 63 | $ 77 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 24.539 | £ 19.453 | 0 | (914) | (914) | (0,33) |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | 07.2022 | £ 35 | $ 44 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | 275 | 340 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | $ 43 | £ 36 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 24.339 | 19.361 | 0 | (826) | (826) | (0,30) |
| SOG | 07.2022 | £ 18.590 | $ 22.624 | 47 | 0 | 47 | 0,02 |
| | 08.2022 | $ 22.635 | £ 18.590 | 0 | (47) | (47) | (0,02) |
| UAG | 07.2022 | £ 606 | $ 740 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | | | | $ 65 | $ (2.791) | $ (2.726) | (1,00) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | $ 0 | SEK 2 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | SEK 68 | $ 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 9.697 | SEK 94.636 | 0 | (462) | (462) | (0,17) |
| BRC | 07.2022 | SEK 97.392 | $ 9.584 | 80 | 0 | 80 | 0,03 |
| | 08.2022 | $ 9.584 | SEK 97.311 | 0 | (79) | (79) | (0,03) |
| CBK | 07.2022 | 10.342 | 101.179 | 0 | (468) | (468) | (0,17) |
| MBC | 07.2022 | SEK 38 | $ 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 163 | SEK 1.607 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | SEK 8 | $ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 10.746 | SEK 105.017 | 0 | (498) | (498) | (0,18) |
| | | | | $ 80 | $ (1.513) | $ (1.433) | (0,52) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | SGD 816 | $ 587 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 1.287 | SGD 1.763 | 0 | (20) | (20) | (0,01) |
| | 08.2022 | 587 | 816 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | SGD 1.637 | $ 1.178 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ 4 | SGD 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 1.178 | 1.637 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | SGD 59 | $ 43 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 4 | SGD 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 7 | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | 11 | 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 1.321 | 1.805 | 0 | (24) | (24) | (0,01) |
| UAG | 07.2022 | SGD 2 | $ 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 1.367 | SGD 1.872 | 0 | (22) | (22) | (0,01) |
| | | | | $ 4 | $ (69) | $ (65) | (0,02) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (7.206)** | **(2,63)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 269.752** | **98,39** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ 4.423** | **1,61** |
| **Nettovermögen** | **$ 274.175** | **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**

**(a) Wertpapier per Emissionstermin.**

**(b) Nullkuponwertpapier.**

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

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

**(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(f) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurde zum 30. Juni 2022 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von USD 118 und Barmittel in Höhe von USD 10.344 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von USD 2.371 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 274.677 | $ 0 | $ 274.677 |
| Finanzderivate[3] | 1.161 | (6.086) | 0 | (4.925) |
| **Summen** | **$ 1.161** | **$ 268.591** | **$ 0** | **$ 269.752** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 321.810 | $ 0 | $ 321.810 |
| Finanzderivate[3] | 836 | 3.725 | 0 | 4.561 |
| **Summen** | **$ 836** | **$ 325.535** | **$ 0** | **$ 326.371** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (1.494) | $ 1.360 | $ (134) |
| BPS | 1 | 0 | 1 |
| BRC | (912) | 850 | (62) |
| CBK | (479) | 420 | (59) |
| DUB | 1.636 | 1.862 | 3.498 |
| GLM | 5 | 0 | 5 |
| JPM | 145 | 0 | 145 |
| MBC | (1.834) | 1.660 | (174) |
| MYI | 9 | 0 | 9 |
| RBC | 112 | 0 | 112 |
| SCX | (1.347) | 1.330 | (17) |
| SOG | (1.634) | 1.700 | 66 |
| UAG | (1.414) | 1.280 | (134) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 83,96 | 74,31 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 16,19 | 23,74 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 0,04 | 0,04 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,43 | 0,29 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,40 | 0,02 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (2,63) | 1,08 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Australien | 1,00 | 1,49 |
| Österreich | 0,23 | 0,24 |
| Belgien | 0,58 | 0,62 |
| Brasilien | 0,36 | 0,66 |
| Kanada | 1,37 | k. A. |
| Chile | 1,01 | 0,85 |
| China | 0,42 | 0,39 |
| Finnland | 1,12 | 1,82 |
| Frankreich | 7,13 | 7,69 |
| Deutschland | 9,71 | 2,48 |
| Hongkong | k. A. | 0,41 |
| Indien | 1,35 | 0,97 |
| Irland | 1,46 | 1,98 |
| Italien | 1,48 | 1,59 |
| Japan | 2,29 | 2,04 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,39 | 0,40 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Luxemburg | 3,89 | 2,99 |
| Mauritius | 1,68 | 1,92 |
| Mexiko | 0,27 | 0,34 |
| Multinational | 0,95 | 0,59 |
| Niederlande | 9,31 | 10,39 |
| Singapur | 0,48 | 0,53 |
| Südkorea | 0,34 | 0,21 |
| Spanien | 2,88 | 3,13 |
| Supranational | 4,70 | 2,59 |
| Schweden | 1,09 | 0,79 |
| Schweiz | 0,95 | 0,85 |
| Vereinigtes Königreich | 10,04 | 9,61 |
| Vereinigte Staaten | 33,39 | 33,05 |
| Virgin Islands (British) | 0,28 | 0,28 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,04 | 7,19 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,43 | 0,29 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen –Schutzverkauf | 0,00 | 0,00 |
| Zinsswaps | 0,40 | 0,02 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Devisenterminkontrakte | 0,68 | 0,23 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (3,31) | 0,85 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 1,61 | 0,52 |
| Net Assets | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Australia Government International Bond** | | | | |
| 0,250 % fällig am 21.11.2032 | AUD | 5.111 | $ 3.093 | 0,17 |
| 0,750 % fällig am 21.11.2027 | | 3.894 | 2.663 | 0,15 |
| 3,000 % fällig am 20.09.2025 | | 1.606 | 1.210 | 0,07 |
| Summe Australien | | | 6.966 | 0,39 |
| **KANADA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Canadian Government Real Return Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.12.2050 (c) | CAD | 230 | 142 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 01.12.2026 (c) | | 2.728 | 2.441 | 0,13 |
| Summe Kanada | | | 2.583 | 0,14 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Allegro CLO Ltd.** | | | | |
| 2,209 % fällig am 16.10.2031 | $ | 500 | 492 | 0,03 |
| **Anchorage Capital CLO Ltd.** | | | | |
| 2,276 % fällig am 22.07.2032 | | 2.200 | 2.138 | 0,12 |
| **Apidos CLO** | | | | |
| 1,974 % fällig am 17.07.2030 | | 2.000 | 1.972 | 0,11 |
| 2,073 % fällig am 20.04.2031 | | 1.900 | 1.867 | 0,10 |
| **Atlas Senior Loan Fund Ltd.** | | | | |
| 2,134 % fällig am 15.01.2031 | | 6.458 | 6.363 | 0,35 |
| 2,194 % fällig am 16.01.2030 | | 1.247 | 1.235 | 0,07 |
| **Atrium Corp.** | | | | |
| 1,966 % fällig am 22.04.2027 | | 424 | 417 | 0,02 |
| **Barings CLO Ltd.** | | | | |
| 1,863 % fällig am 20.01.2028 | | 1.959 | 1.938 | 0,11 |
| **BlueMountain CLO Ltd.** | | | | |
| 2,316 % fällig am 22.10.2030 | | 1.912 | 1.890 | 0,10 |
| **Carbone CLO Ltd.** | | | | |
| 2,203 % fällig am 20.01.2031 | | 4.700 | 4.611 | 0,25 |
| **Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.** | | | | |
| 2,044 % fällig am 15.01.2031 | | 591 | 578 | 0,03 |
| **Catamaran CLO Ltd.** | | | | |
| 2,236 % fällig am 22.04.2030 | | 2.786 | 2.749 | 0,15 |
| **CBAM CLO Ltd.** | | | | |
| 2,313 % fällig am 20.07.2030 | | 4.400 | 4.351 | 0,24 |
| **Cedar Funding CLO Ltd.** | | | | |
| 2,144 % fällig am 17.07.2031 | | 700 | 686 | 0,04 |
| **CIFC Funding Ltd.** | | | | |
| 2,044 % fällig am 18.04.2031 | | 2.600 | 2.555 | 0,14 |
| 2,224 % fällig am 16.11.2030 | | 6.600 | 6.508 | 0,36 |
| 2,283 % fällig am 20.07.2030 | | 1.000 | 991 | 0,05 |
| 2,285 % fällig am 27.04.2031 | | 1.200 | 1.178 | 0,07 |
| **Dryden CLO Ltd.** | | | | |
| 2,421 % fällig am 15.05.2031 | | 700 | 688 | 0,04 |
| **Dryden Senior Loan Fund** | | | | |
| 1,944 % fällig am 15.04.2029 | | 2.389 | 2.366 | 0,13 |
| 2,611 % fällig am 15.08.2030 | | 4.100 | 4.055 | 0,22 |
| **Elevation CLO Ltd.** | | | | |
| 2,274 % fällig am 15.10.2029 | | 2.254 | 2.232 | 0,12 |
| **Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.** | | | | |
| 2,504 % fällig am 15.09.2037 | | 3.600 | 3.551 | 0,20 |
| **ICG U.S. CLO Ltd.** | | | | |
| 2,216 % fällig am 22.07.2031 | | 2.500 | 2.458 | 0,14 |
| **KKR CLO Ltd.** | | | | |
| 2,224 % fällig am 15.01.2031 | | 700 | 690 | 0,04 |
| **LCM LP** | | | | |
| 2,103 % fällig am 20.07.2031 | | 3.300 | 3.227 | 0,18 |
| 2,174 % fällig am 15.10.2031 | | 1.200 | 1.174 | 0,07 |
| **Madison Park Funding Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 29.07.2030 | | 400 | 396 | 0,02 |
| 1,794 % fällig am 15.04.2029 | | 4.568 | 4.508 | 0,25 |
| **Magnetite Ltd.** | | | | |
| 2,024 % fällig am 15.04.2031 | | 300 | 296 | 0,02 |
| **Marathon CLO Ltd.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 21.11.2027 | | 193 | 193 | 0,01 |
| **Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd.** | | | | |
| 2,103 % fällig am 20.04.2031 | | 1.000 | 975 | 0,05 |
| **Octagon Investment Partners Ltd.** | | | | |
| 2,004 % fällig am 16.04.2031 | $ | 3.500 | $ 3.438 | 0,19 |
| **Octagon Loan Funding Ltd.** | | | | |
| 2,635 % fällig am 18.11.2031 | | 2.500 | 2.453 | 0,14 |
| **OZLM Ltd.** | | | | |
| 2,124 % fällig am 17.04.2031 | | 2.759 | 2.700 | 0,15 |
| 2,213 % fällig am 20.01.2031 | | 3.400 | 3.336 | 0,18 |
| **Regatta Funding Ltd.** | | | | |
| 2,294 % fällig am 17.10.2030 | | 4.300 | 4.250 | 0,23 |
| **Sound Point CLO Ltd.** | | | | |
| 2,183 % fällig am 21.01.2031 | | 1.400 | 1.377 | 0,08 |
| 2,194 % fällig am 18.04.2031 | | 2.200 | 2.168 | 0,12 |
| 2,314 % fällig am 26.07.2031 | | 1.500 | 1.467 | 0,08 |
| **TIAA CLO Ltd.** | | | | |
| 2,263 % fällig am 20.07.2031 | | 500 | 491 | 0,03 |
| **TICP CLO Ltd.** | | | | |
| 1,903 % fällig am 20.04.2028 | | 767 | 758 | 0,04 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | |
| 1,924 % fällig am 15.07.2027 | | 66 | 66 | 0,00 |
| **Voya CLO Ltd.** | | | | |
| 2,138 % fällig am 14.07.2031 | | 495 | 485 | 0,03 |
| 2,254 % fällig am 15.10.2030 | | 1.992 | 1.967 | 0,11 |
| **Wellfleet CLO Ltd.** | | | | |
| 1,973 % fällig am 20.04.2028 | | 1.730 | 1.716 | 0,09 |
| | | | 96.000 | 5,30 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | |
| 2,528 % fällig am 18.11.2027 | | 258 | 211 | 0,01 |
| Summe Cayman Inseln | | | 96.211 | 5,31 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 31.140 | 3.444 | 0,19 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 6.345 | 653 | 0,04 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 14.517 | 1.626 | 0,09 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2053 | | 2.793 | 333 | 0,02 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 1 | 0 | 0,00 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.10.2043 | | 7.041 | 805 | 0,04 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 22.062 | 2.444 | 0,13 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 10.732 | 1.213 | 0,07 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2053 | | 1.000 | 119 | 0,01 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 3 | 0 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 148.477 | 16.405 | 0,90 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 34.782 | 3.629 | 0,20 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 145.772 | 16.169 | 0,89 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2053 | | 6.093 | 706 | 0,04 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 13 | 2 | 0,00 |
| 3,500 % fällig am 01.10.2053 | | 22.600 | 3.067 | 0,17 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 55.971 | 6.181 | 0,34 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 6.227 | 654 | 0,04 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 24.295 | 2.775 | 0,15 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2053 | | 4.096 | 471 | 0,03 |
| 2,500 % fällig am 01.04.2047 | | 13 | 2 | 0,00 |
| | | | 60.698 | 3,35 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Denmark Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.11.2023 (c) | | 12.788 | 1.879 | 0,10 |
| Summe Dänemark | | | 62.577 | 3,45 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **France Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 01.03.2025 (c) | € | 18.864 | 20.806 | 1,15 |
| 0,100 % fällig am 25.07.2031 (c) | | 9.074 | 9.911 | 0,55 |
| 0,100 % fällig am 25.07.2038 (c) | | 6.548 | 6.810 | 0,38 |
| 0,100 % fällig am 25.07.2047 (c) | | 5.258 | 5.422 | 0,30 |
| 0,250 % fällig am 25.07.2024 (c) | | 44.097 | 49.345 | 2,72 |
| 1,100 % fällig am 25.07.2022 (c) | | 9.823 | 10.339 | 0,57 |
| 2,100 % fällig am 25.07.2023 (c) | | 32.313 | 36.168 | 1,99 |
| Summe Frankreich | | | 138.801 | 7,66 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.04.2023 (c) | € | 13.164 | $ 14.285 | 0,79 |
| **GUERNSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.09.2022 | $ | 400 | 400 | 0,02 |
| **Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.11.2024 | | 15 | 15 | 0,00 |
| Summe Guernsey, Kanalinseln | | | 415 | 0,02 |
| **IRLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Ares European CLO** | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.10.2030 | € | 1.397 | 1.435 | 0,08 |
| **Ares European CLO DAC** | | | | |
| 0,610 % fällig am 15.04.2030 | | 693 | 710 | 0,04 |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | | 4.000 | 4.089 | 0,23 |
| 0,850 % fällig am 20.04.2032 | | 2.100 | 2.138 | 0,12 |
| **Armada Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.07.2031 | | 500 | 509 | 0,03 |
| **Bain Capital Euro DAC** | | | | |
| 1,100 % fällig am 24.01.2033 | | 1.300 | 1.333 | 0,07 |
| **Black Diamond CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 03.10.2029 | | 45 | 47 | 0,00 |
| 0,860 % fällig am 20.01.2032 | | 2.346 | 2.422 | 0,13 |
| 0,980 % fällig am 15.05.2032 | | 2.600 | 2.656 | 0,15 |
| 2,012 % fällig am 03.10.2029 | $ | 30 | 30 | 0,00 |
| **BlueMountain Fuji EUR CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.01.2031 | € | 2.100 | 2.139 | 0,12 |
| 1,050 % fällig am 15.01.2031 | | 1.000 | 1.010 | 0,06 |
| **BNPP AM Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,600 % fällig am 15.04.2031 | | 1.600 | 1.626 | 0,09 |
| **Cairn CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 20.10.2028 | | 70 | 73 | 0,00 |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | | 2.300 | 2.343 | 0,13 |
| **Carlyle Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 15.08.2030 | | 7.382 | 7.567 | 0,42 |
| 0,700 % fällig am 15.01.2031 | | 2.200 | 2.247 | 0,12 |
| 0,890 % fällig am 15.08.2032 | | 900 | 913 | 0,05 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.11.2031 | | 3.850 | 3.954 | 0,22 |
| **CVC Cordatus Loan Fund DAC** | | | | |
| 0,890 % fällig am 26.08.2032 | | 500 | 507 | 0,03 |
| **Dryden Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.05.2032 | | 1.332 | 1.350 | 0,07 |
| 0,860 % fällig am 15.05.2034 | | 2.400 | 2.428 | 0,13 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | | 327 | 340 | 0,02 |
| 0,650 % fällig am 26.06.2030 | | 1.584 | 1.627 | 0,09 |
| 0,760 % fällig am 15.07.2031 | | 1.400 | 1.409 | 0,08 |
| 1,040 % fällig am 15.07.2031 | | 700 | 694 | 0,04 |
| **Invesco Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,920 % fällig am 15.07.2032 | | 2.600 | 2.647 | 0,15 |
| **Jubilee CLO DAC** | | | | |
| 0,519 % fällig am 15.12.2029 | | 1.908 | 1.974 | 0,11 |
| **Laurelin DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 20.10.2031 | | 1.200 | 1.229 | 0,07 |
| **Madison Park Euro Funding DAC** | | | | |
| 0,800 % fällig am 15.07.2032 | | 700 | 709 | 0,04 |
| **Man GLG Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,870 % fällig am 15.01.2030 | | 161 | 166 | 0,01 |
| **Oak Hill European Credit Partners DAC** | | | | |
| 0,740 % fällig am 20.10.2031 | | 1.100 | 1.120 | 0,06 |
| **OCP Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,820 % fällig am 15.01.2032 | | 10.100 | 10.417 | 0,57 |
| 0,880 % fällig am 22.09.2034 | | 2.600 | 2.631 | 0,14 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.10.2031 | | 900 | 922 | 0,05 |
| **Rockford Tower Europe CLO DAC** | | | | |
| 1,030 % fällig am 20.12.2031 | | 2.700 | 2.764 | 0,15 |
| **Segovia European CLO DAC** | | | | |
| 0,880 % fällig am 20.07.2032 | | 2.300 | 2.337 | 0,13 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Tikehau CLO BV** | | | | |
| 0,870 % fällig am 04.08.2034 | € | 2.600 | $ 2.650 | 0,15 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | |
| 0,810 % fällig am 15.02.2034 | | 3.700 | 3.739 | 0,21 |
| 0,920 % fällig am 15.07.2030 | | 970 | 1.002 | 0,05 |
| | | | 79.903 | 4,41 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **European Loan Conduit DAC** | | | | |
| 1,000 % fällig am 17.02.2030 | | 597 | 616 | 0,03 |
| Summe Irland | | | 80.519 | 4,44 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.05.2033 (c) | | 6.708 | 6.078 | 0,34 |
| 0,400 % fällig am 15.05.2030 (c) | | 17.293 | 17.234 | 0,95 |
| 0,450 % fällig am 22.05.2023 (c) | | 3.505 | 3.813 | 0,21 |
| 1,400 % fällig am 26.05.2025 (c) | | 29.305 | 31.935 | 1,76 |
| 2,350 % fällig am 15.09.2024 (c) | | 24.575 | 28.160 | 1,56 |
| 2,550 % fällig am 15.09.2041 (c) | | 1.369 | 1.690 | 0,09 |
| 2,600 % fällig am 15.09.2023 (c) | | 11.115 | 12.570 | 0,69 |
| Summe Italien | | | 101.480 | 5,60 |
| **JAPAN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Japan Government International Bond** | | | | |
| 0,005 % fällig am 10.03.2031 (c) | ¥ | 337.742 | 2.630 | 0,15 |
| 0,100 % fällig am 10.09.2024 (c) | | 909.040 | 6.885 | 0,38 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2025 (c) | | 988.425 | 7.509 | 0,41 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2026 (c) | | 748.457 | 5.771 | 0,32 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2028 (c) | | 700.769 | 5.421 | 0,30 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2029 (c) | | 3.120.475 | 24.187 | 1,33 |
| Summe Japan | | | 52.403 | 2,89 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 4,441 % fällig am 24.04.2023 | $ | 400 | 403 | 0,02 |
| **NEUSEELAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **New Zealand Government International Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 20.09.2025 | NZD | 2.941 | 1.871 | 0,10 |
| **PERU** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | PEN | 2.200 | 529 | 0,03 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 2.600 | 606 | 0,03 |
| Summe Peru | | | 1.135 | 0,06 |
| **KATAR** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 3,875 % fällig am 23.04.2023 | $ | 300 | 301 | 0,02 |
| **SAUDI-ARABIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Saudi Arabia Government International Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 17.04.2025 | | 310 | 312 | 0,02 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (d)(f) | € | 400 | $ 403 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Spain Government International Bond** | | | | |
| 0,150 % fällig am 30.11.2023 (c) | | 15.635 | 17.185 | 0,95 |
| 0,500 % fällig am 30.04.2030 | | 2.500 | 2.311 | 0,13 |
| 0,650 % fällig am 30.11.2027 (c) | | 25.115 | 27.845 | 1,54 |
| 0,700 % fällig am 30.11.2033 (c) | | 1.237 | 1.322 | 0,07 |
| | | | 48.663 | 2,69 |
| Summe Spanien | | | 49.066 | 2,71 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Sweden Government International Bond** | | | | |
| 0,125 % fällig am 01.06.2026 | SEK | 2.769 | 286 | 0,02 |
| 0,125 % fällig am 01.12.2027 | | 14.451 | 1.517 | 0,08 |
| 1,000 % fällig am 01.06.2025 | | 112.431 | 11.741 | 0,65 |
| Summe Schweden | | | 13.544 | 0,75 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 3,747 % fällig am 25.06.2024 | $ | 600 | 601 | 0,04 |
| 4,519 % fällig am 25.06.2024 | | 400 | 399 | 0,02 |
| | | | 1.000 | 0,06 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Canada Square Funding PLC** | | | | |
| 1,550 % fällig am 17.10.2051 | £ | 1.141 | 1.385 | 0,08 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | |
| 1,795 % fällig am 16.09.2069 | | 513 | 622 | 0,03 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 1,048 % fällig am 18.06.2038 | | 15 | 17 | 0,00 |
| 1,743 % fällig am 18.03.2039 | | 13 | 15 | 0,00 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | | |
| 1,703 % fällig am 25.05.2053 | | 2.015 | 2.442 | 0,14 |
| **Polaris PLC** | | | | |
| 1,740 % fällig am 23.10.2059 | | 3.656 | 4.381 | 0,24 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,605 % fällig am 20.10.2051 | | 1.177 | 1.425 | 0,08 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | |
| 1,902 % fällig am 12.06.2053 | | 1.406 | 1.708 | 0,09 |
| | | | 11.995 | 0,66 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | | |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 10,250 % | | 7.021 | 1.249 | 0,07 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 0,125 % fällig am 22.03.2024 (c) | £ | 15.731 | 20.218 | 1,12 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2026 (c) | | 12.038 | 15.754 | 0,87 |
| 0,125 % fällig am 10.08.2028 (c) | | 4.010 | 5.414 | 0,30 |
| 1,250 % fällig am 22.11.2027 (c) | | 4.133 | 5.856 | 0,32 |
| 1,875 % fällig am 22.11.2022 (c) | | 4.225 | 5.315 | 0,29 |
| 2,500 % fällig am 17.07.2024 | | 20.596 | 29.138 | 1,61 |
| | | | 81.695 | 4,51 |
| Summe Großbritannien | | | 95.939 | 5,30 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,674 % fällig am 25.12.2033 | $ | 908 | 875 | 0,05 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,584 % fällig am 25.10.2035 | | 1.300 | 1.238 | 0,07 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.10.2036 | | 2.544 | 2.368 | 0,13 |
| 2,224 % fällig am 25.10.2034 | $ | 362 | $ 362 | 0,02 |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,974 % fällig am 25.10.2037 | | 188 | 188 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,914 % fällig am 25.09.2036 | | 569 | 556 | 0,03 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,569 % fällig am 25.10.2034 | | 369 | 360 | 0,02 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 2,314 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 800 | 752 | 0,04 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 2,419 % fällig am 25.02.2036 | | 71 | 71 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.02.2036 | | 2.200 | 2.160 | 0,12 |
| **Ellington Loan Acquisition Trust** | | | | |
| 2,724 % fällig am 25.05.2037 | | 691 | 669 | 0,03 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,934 % fällig am 25.07.2036 | | 169 | 162 | 0,01 |
| 2,899 % fällig am 25.07.2034 | | 1.986 | 1.956 | 0,11 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 2,479 % fällig am 25.08.2034 | | 115 | 112 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.03.2035 | | 1.465 | 1.401 | 0,08 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.11.2036 | | 738 | 670 | 0,04 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 2,774 % fällig am 25.12.2037 | | 935 | 959 | 0,05 |
| **Mid-State Capital Corp. Trust** | | | | |
| 5,787 % fällig am 15.10.2040 | | 94 | 94 | 0,01 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 2,284 % fällig am 25.01.2035 | | 401 | 390 | 0,02 |
| 2,599 % fällig am 25.07.2034 | | 149 | 143 | 0,01 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,389 % fällig am 25.02.2035 | | 522 | 500 | 0,03 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,164 % fällig am 25.01.2036 | | 1.700 | 1.591 | 0,09 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,824 % fällig am 25.11.2034 | | 188 | 168 | 0,01 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 2,509 % fällig am 25.08.2035 | | 62 | 62 | 0,00 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | | |
| 1,914 % fällig am 25.09.2036 | | 3.000 | 2.875 | 0,16 |
| 1,934 % fällig am 25.09.2037 | | 295 | 284 | 0,01 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 2,344 % fällig am 25.10.2035 | | 1.495 | 1.338 | 0,07 |
| 2,599 % fällig am 25.08.2034 | | 2.297 | 2.198 | 0,12 |
| | | | 24.502 | 1,35 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Broadcom, Inc.** | | | | |
| 3,137 % fällig am 15.11.2035 | | 1.459 | 1.110 | 0,06 |
| **Conagra Brands, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.09.2022 | | 300 | 300 | 0,02 |
| **Lehman Brothers Holdings, Inc.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 08.05.2018 ^ | £ | 100 | 1 | 0,00 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | | |
| 4,875 % fällig am 11.07.2022 | $ | 700 | 700 | 0,04 |
| | | | 2.111 | 0,12 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010** | | | | |
| 7,734 % fällig am 15.02.2033 | | 200 | 254 | 0,01 |
| **Bay Area Toll Authority, California Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | | |
| 6,918 % fällig am 01.04.2040 | | 600 | 737 | 0,04 |
| **California State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2009** | | | | |
| 7,300 % fällig am 01.10.2039 | | 500 | 648 | 0,04 |
| 7,500 % fällig am 01.04.2034 | | 100 | 129 | 0,01 |
| 7,550 % fällig am 01.04.2039 | | 200 | 272 | 0,01 |
| **Los Angeles Department of Water & Power, California Revenue Bonds, Series 2010** | | | | |
| 5,516 % fällig am 01.07.2027 | | 500 | 540 | 0,03 |
| **New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured, New York Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | | |
| 5,508 % fällig am 01.08.2037 | | 200 | 220 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **New York State Urban Development Corp., Revenue Bonds, (BABs), Series 2009** | | | |
| 5,770 % fällig am 15.03.2039 | $ 100 | $ 108 | 0,01 |
| | | 2.908 | 0,16 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | |
| 3,562 % fällig am 25.09.2045 | 0 | 0 | 0,00 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | |
| 2,496 % fällig am 20.09.2034 | 7 | 7 | 0,00 |
| **BCAP LLC Trust** | | | |
| 5,250 % fällig am 26.04.2037 | 205 | 132 | 0,01 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 2,744 % fällig am 25.11.2034 | 5 | 5 | 0,00 |
| 2,817 % fällig am 25.02.2034 | 7 | 7 | 0,00 |
| 2,961 % fällig am 25.01.2035 | 23 | 22 | 0,00 |
| 3,278 % fällig am 25.05.2047 ^ | 7 | 6 | 0,00 |
| 3,349 % fällig am 25.09.2034 | 56 | 54 | 0,00 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | |
| 3,044 % fällig am 25.10.2033 | 10 | 10 | 0,00 |
| 3,497 % fällig am 25.08.2036 ^ | 13 | 7 | 0,00 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | |
| 3,342 % fällig am 25.03.2037 ^ | 5 | 5 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | |
| 3,440 % fällig am 25.09.2035 | 2 | 2 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.08.2034 | 394 | 369 | 0,02 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | |
| 1,822 % fällig am 20.07.2046 ^ | 9 | 7 | 0,00 |
| 2,004 % fällig am 25.09.2046 ^ | 9 | 9 | 0,00 |
| 3,163 % fällig am 25.02.2037 ^ | 7 | 7 | 0,00 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 2,264 % fällig am 25.03.2035 | 70 | 65 | 0,00 |
| 2,384 % fällig am 25.09.2034 | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,920 % fällig am 25.09.2047 ^ | 6 | 6 | 0,00 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | |
| 2,064 % fällig am 25.06.2045 | 77 | 72 | 0,01 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,938 % fällig am 25.09.2035 | 2 | 2 | 0,00 |
| 3,093 % fällig am 25.06.2034 | 5 | 5 | 0,00 |
| 3,574 % fällig am 25.07.2035 | 40 | 39 | 0,00 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,512 % fällig am 20.06.2035 | 208 | 195 | 0,01 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | |
| 2,284 % fällig am 25.10.2035 | 3 | 3 | 0,00 |
| **Impac CMB Trust** | | | |
| 2,524 % fällig am 25.10.2033 | 2 | 2 | 0,00 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,104 % fällig am 25.07.2035 | 1.465 | 1.384 | 0,08 |
| 2,264 % fällig am 25.07.2045 | 3 | 2 | 0,00 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | |
| 2,661 % fällig am 25.08.2035 | 8 | 7 | 0,00 |
| 2,816 % fällig am 25.04.2035 | 22 | 21 | 0,00 |
| **Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 1,764 % fällig am 15.12.2030 | 1 | 1 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | |
| 2,314 % fällig am 25.08.2036 | 3.500 | 3.394 | 0,19 |
| **MF1 Ltd.** | | | |
| 3,443 % fällig am 15.07.2035 | 284 | 283 | 0,02 |
| **New Residential Mortgage Loan Trust** | | | |
| 4,500 % fällig am 25.05.2058 | 513 | 510 | 0,03 |
| **Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 3,424 % fällig am 25.04.2035 | 500 | 489 | 0,03 |
| **Regal Trust** | | | |
| 1,742 % fällig am 29.09.2031 | 7 | 7 | 0,00 |
| **Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust** | | | |
| 6,500 % fällig am 25.03.2032 | 7 | 6 | 0,00 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | |
| 1,995 % fällig am 20.07.2036 | 644 | 574 | 0,03 |
| 2,295 % fällig am 19.10.2026 | 4 | 4 | 0,00 |
| 2,602 % fällig am 20.04.2035 | 20 | 20 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | |
| 2,175 % fällig am 19.07.2034 | $ 2 | $ 2 | 0,00 |
| 2,255 % fällig am 19.10.2034 | 10 | 10 | 0,00 |
| 2,295 % fällig am 19.03.2034 | 8 | 8 | 0,00 |
| **Towd Point Mortgage Trust** | | | |
| 2,750 % fällig am 25.10.2056 | 729 | 723 | 0,04 |
| 3,250 % fällig am 25.03.2058 | 719 | 705 | 0,04 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 1,876 % fällig am 25.06.2042 | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,244 % fällig am 25.01.2045 | 12 | 11 | 0,00 |
| 2,364 % fällig am 25.01.2045 | 61 | 59 | 0,00 |
| 2,404 % fällig am 25.10.2044 | 179 | 162 | 0,01 |
| | | 9.422 | 0,52 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae** | | | |
| 2,194 % fällig am 25.09.2036 | 1 | 1 | 0,00 |
| 5,254 % fällig am 01.11.2034 | 218 | 218 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2044 | 4 | 5 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.06.2028 | 6 | 7 | 0,00 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 1,475 % fällig am 15.03.2024 | 1 | 1 | 0,00 |
| 1,774 % fällig am 15.12.2031 | 1 | 1 | 0,00 |
| 1,824 % fällig am 15.04.2028 | 4 | 4 | 0,00 |
| 1,904 % fällig am 25.09.2031 | 10 | 10 | 0,00 |
| 1,974 % fällig am 15.03.2032 | 60 | 60 | 0,00 |
| 2,350 % fällig am 01.01.2034 | 1 | 1 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 15.01.2035 | 196 | 205 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 15.04.2036 | 3 | 3 | 0,00 |
| **Ginnie Mae** | | | |
| 0,382 % fällig am 20.08.2068 | 582 | 567 | 0,03 |
| 1,240 % fällig am 20.08.2062 | 989 | 986 | 0,05 |
| 1,362 % fällig am 20.10.2043 | 494 | 489 | 0,03 |
| 1,573 % fällig am 20.03.2060 | 25 | 24 | 0,00 |
| 1,845 % fällig am 20.02.2035 | 28 | 28 | 0,00 |
| 2,085 % fällig am 20.02.2038 | 15 | 15 | 0,00 |
| 2,383 % fällig am 20.07.2062 | 663 | 662 | 0,04 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 | 900 | 810 | 0,05 |
| 3,000 % fällig am 01.08.2052 | 9.700 | 9.027 | 0,50 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2052 | 40.880 | 39.280 | 2,17 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2052 | 13.114 | 12.913 | 0,71 |
| | | 65.317 | 3,60 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | |
| 1,625 % fällig am 15.11.2050 | 6.710 | 4.723 | 0,26 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c)** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.01.2023 | 48.252 | 49.069 | 2,71 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2024 | 36.277 | 36.632 | 2,02 |
| 0,125 % fällig am 15.10.2024 | 138.689 | 139.570 | 7,70 |
| 0,125 % fällig am 15.04.2025 | 67.815 | 67.867 | 3,74 |
| 0,125 % fällig am 15.10.2025 | 63.388 | 63.359 | 3,50 |
| 0,125 % fällig am 15.04.2026 | 67.599 | 66.991 | 3,70 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2026 | 6.645 | 6.593 | 0,36 |
| 0,125 % fällig am 15.10.2026 (g)(h) | 262.548 | 260.267 | 14,36 |
| 0,125 % fällig am 15.04.2027 | 29.075 | 28.640 | 1,58 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2030 | 2.142 | 2.044 | 0,11 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2031 | 21.268 | 20.239 | 1,12 |
| 0,125 % fällig am 15.01.2032 (h) | 31.596 | 30.019 | 1,66 |
| 0,125 % fällig am 15.02.2051 (g) | 555 | 428 | 0,02 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 | $ 62.240 | $ 62.633 | 3,46 |
| 0,250 % fällig am 15.07.2029 | 1.819 | 1.765 | 0,10 |
| 0,250 % fällig am 15.02.2050 | 675 | 534 | 0,03 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2023 | 32.667 | 33.245 | 1,83 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 | 18.995 | 19.191 | 1,06 |
| 0,375 % fällig am 15.01.2027 | 3.721 | 3.709 | 0,20 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2027 | 28.691 | 28.601 | 1,58 |
| 0,500 % fällig am 15.04.2024 | 66.394 | 67.324 | 3,71 |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028 | 34.218 | 34.003 | 1,88 |
| 0,625 % fällig am 15.04.2023 | 54.264 | 55.194 | 3,04 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2024 | 105.795 | 107.622 | 5,94 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2026 | 19.853 | 20.083 | 1,11 |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 | 54.502 | 54.924 | 3,03 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2045 | 614 | 551 | 0,03 |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 | 6.571 | 6.636 | 0,37 |
| 0,875 % fällig am 15.02.2047 | 3.592 | 3.326 | 0,18 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2046 | 1.464 | 1.390 | 0,08 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 | 2.977 | 3.050 | 0,17 |
| 1,750 % fällig am 15.01.2028 | 5.585 | 5.932 | 0,33 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2040 | 508 | 594 | 0,03 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2041 | 3.564 | 4.147 | 0,23 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 | 16.408 | 17.391 | 0,96 |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 | 1.628 | 1.810 | 0,10 |
| 3,875 % fällig am 15.04.2029 | 1.145 | 1.383 | 0,08 |
| | | 1.311.479 | 72,37 |
| Summe USA | | 1.415.739 | 78,12 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | |
| 51,049 % fällig am 30.09.2022 (a)(b) | ARS 2.400 | 8 | 0,00 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 8 | 0,00 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | **$ 2.134.558** | **117,79** |
| | **AKTIEN** | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)** | 1.802 | 18 | 0,00 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$ 18** | **0,00** |

**PENSIONSGESCHÄFTE**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 576 | U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | $ (588) | $ 576 | $ 576 | 0,03 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (588)** | **$ 576** | **$ 576** | **0,03** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month Euribor March Futures | Long | 03.2023 | 487 | $ (2.275) | (0,13) |
| Australia Government 3-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 69 | (4) | 0,00 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 63 | 34 | 0,00 |
| Euro-Bobl September Futures | Long | 09.2022 | 146 | (8) | 0,00 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09.2022 | 283 | 131 | 0,01 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09.2022 | 602 | (3.100) | (0,17) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 46 | 148 | 0,01 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 270 | 1.976 | 0,11 |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 205 | 845 | 0,05 |
| Euro-Schatz September Futures | Long | 09.2022 | 628 | (248) | (0,01) |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 138 | (100) | (0,01) |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 1.331 | (1.130) | (0,06) |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 126 | (75) | (0,01) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 78 | (129) | (0,01) |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2022 | 568 | 1.241 | 0,07 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 696 | 882 | 0,05 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09.2022 | 107 | (159) | (0,01) |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Long | 09.2022 | 138 | (687) | (0,04) |
| | | | | $ (2.658) | (0,15) |
| **Total Financial Derivative Instruments Dealt in on a Regulated Market** | | | | **$ (2.658)** | **(0,15)** |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| General Electric Co, | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 200 | $ 13 | 0,00 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,300 % | 20.09.2027 | ¥ 74.880 | $ 1 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,000 | 15.12.2047 | $ 1.750 | 205 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,428 | 20.12.2047 | 400 | 15 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,478 | 20.12.2047 | 1.115 | 28 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,499 | 20.12.2047 | 570 | 13 | 0,00 |
| Zahlung[3] | 3-Month EUR-EURIBOR | 0,526 | 21.11.2023 | € 9.900 | (206) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month NZD-BBR | 3,250 | 21.03.2028 | NZD 900 | 15 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,840 | 21.11.2028 | $ 13.800 | 694 | 0,04 |
| Zahlung[3] | 3-Month USD-LIBOR | 1,880 | 25.01.2052 | 5.000 | (988) | (0,05) |
| Zahlung[3] | 3-Month USD-LIBOR | 1,888 | 21.11.2053 | 2.800 | (536) | (0,03) |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | € 77.600 | (6.503) | (0,36) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 12.04.2027 | 4.900 | (225) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 11.05.2027 | 2.400 | (111) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,700 | 11.04.2027 | 2.100 | (92) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 13.05.2027 | 4.700 | (152) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.05.2027 | 2.100 | (68) | 0,00 |
| Zahlung | CPTFEMU | 1,066 | 15.02.2024 | 3.800 | (492) | (0,03) |
| Zahlung | CPTFEMU | 1,168 | 15.03.2024 | 3.300 | (430) | (0,02) |
| Zahlung | CPTFEMU | 1,380 | 15.03.2031 | 4.000 | (680) | (0,04) |
| Zahlung | CPTFEMU | 1,475 | 15.05.2023 | 1.900 | (201) | (0,01) |
| Zahlung | CPTFEMU | 1,535 | 15.06.2023 | 2.900 | (299) | (0,02) |
| Zahlung | CPTFEMU | 1,946 | 15.03.2048 | 60 | (11) | 0,00 |
| Zahlung | CPTFEMU | 2,421 | 15.05.2052 | 700 | (13) | 0,00 |
| Zahlung | CPTFEMU | 2,455 | 15.06.2032 | 16.000 | 86 | 0,00 |
| Zahlung | CPTFEMU | 2,488 | 15.05.2037 | 4.790 | (8) | 0,00 |
| Erhalt | CPTFEMU | 2,570 | 15.06.2032 | 8.800 | (156) | (0,01) |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | CPTFEMU | 2,580 % | 15.03.2052 | € 500 | $ 10 | 0,00 |
| Zahlung | CPTFEMU | 2,590 | 15.03.2052 | 4.940 | 147 | 0,01 |
| Erhalt | CPTFEMU | 2,600 | 15.05.2032 | 10.600 | (104) | (0,01) |
| Erhalt | CPTFEMU | 2,720 | 15.06.2032 | 15.500 | (480) | (0,03) |
| Erhalt | CPTFEMU | 4,375 | 15.06.2024 | 100.000 | (513) | (0,03) |
| Erhalt | CPURNSA | 1,798 | 25.08.2027 | $ 1.000 | 143 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 1,890 | 27.08.2027 | 3.000 | 409 | 0,02 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,954 | 03.06.2029 | 700 | (86) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,998 | 25.07.2029 | 3.600 | (424) | (0,02) |
| Zahlung | CPURNSA | 2,155 | 17.10.2027 | 1.900 | (210) | (0,01) |
| Erhalt | CPURNSA | 2,210 | 05.02.2023 | 5.270 | 477 | 0,03 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,263 | 27.04.2023 | 1.450 | 122 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,263 | 09.05.2023 | 1.790 | 151 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,311 | 24.02.2031 | 5.100 | 495 | 0,03 |
| Zahlung | CPURNSA | 2,335 | 05.02.2028 | 2.680 | (233) | (0,01) |
| Zahlung | CPURNSA | 2,353 | 09.05.2028 | 1.790 | (144) | (0,01) |
| Zahlung | CPURNSA | 2,360 | 09.05.2028 | 2.690 | (214) | (0,01) |
| Zahlung | CPURNSA | 2,364 | 10.05.2028 | 2.750 | (218) | (0,01) |
| Erhalt | CPURNSA | 2,419 | 05.03.2026 | 2.300 | 214 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,573 | 26.08.2028 | 1.100 | 59 | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,645 | 10.09.2028 | 1.500 | 69 | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,690 | 01.06.2026 | 2.100 | 156 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,703 | 25.05.2026 | 1.270 | 94 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,768 | 13.05.2026 | 3.100 | 224 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,813 | 14.05.2026 | 1.400 | 98 | 0,01 |
| Erhalt | FRCPXTOB | 1,030 | 15.03.2024 | € 3.300 | 304 | 0,02 |
| Zahlung | FRCPXTOB | 1,910 | 15.01.2038 | 390 | (55) | 0,00 |
| Zahlung | UKRPI | 3,100 | 15.06.2031 | £ 2.300 | (293) | (0,02) |
| Zahlung | UKRPI | 3,400 | 15.06.2030 | 1.610 | (257) | (0,01) |
| Zahlung | UKRPI | 3,515 | 15.02.2041 | 2.700 | (231) | (0,01) |
| Zahlung | UKRPI | 3,530 | 15.10.2031 | 540 | (92) | (0,01) |
| Zahlung | UKRPI | 3,566 | 15.03.2036 | 2.700 | (316) | (0,02) |
| Zahlung | UKRPI | 3,580 | 15.03.2036 | 2.000 | (309) | (0,02) |
| Erhalt | UKRPI | 4,049 | 15.07.2022 | 14.900 | 1.377 | 0,08 |
| Zahlung | UKRPI | 4,066 | 15.09.2031 | 300 | (25) | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 4,180 | 15.09.2022 | 3.000 | 279 | 0,02 |
| Erhalt | UKRPI | 4,220 | 15.08.2022 | 2.700 | 253 | 0,01 |
| Erhalt | UKRPI | 4,480 | 15.09.2023 | 1.500 | 170 | 0,01 |
| Erhalt | UKRPI | 5,200 | 15.06.2024 | 1.200 | 4 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 5,330 | 15.06.2024 | 14.700 | 4 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 6,290 | 15.03.2024 | 8.500 | 221 | 0,01 |
| Erhalt | UKRPI | 6,440 | 15.05.2024 | 4.700 | 42 | 0,00 |
| Zahlung | UKRPI | 6,500 | 15.03.2024 | 3.400 | (70) | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 6,600 | 15.05.2024 | 19.900 | 77 | 0,00 |
| | | | | | $ (8.789) | (0,48) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (8.776)** | **(0,48)** |

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

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

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

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

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

**OPTIONSKAUF**

**ZINSSWAPOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,195 % | 02.11.2022 | 950 | $ 1 | $ 405 | 0,02 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,197 | 04.11.2022 | 1.040 | 79 | 443 | 0,02 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,000 | 15.03.2023 | 600 | 68 | 283 | 0,02 |
| BRC | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,410 | 02.02.2023 | 30.200 | 151 | 26 | 0,00 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,197 | 04.11.2022 | 560 | 42 | 239 | 0,01 |
| CBK | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,720 | 23.02.2023 | 58.700 | 323 | 100 | 0,01 |
| DUB | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,237 | 17.11.2023 | 10.300 | 639 | 1.620 | 0,09 |
| GLM | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,200 | 26.04.2023 | 21.100 | 225 | 213 | 0,01 |
| JPM | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,710 | 25.01.2023 | 62.600 | 382 | 83 | 0,00 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,000 | 15.03.2023 | 600 | 66 | 283 | 0,02 |
| MYC | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,428 | 31.01.2023 | 30.000 | 153 | 25 | 0,00 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,190 | 02.11.2022 | 900 | 66 | 385 | 0,02 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,200 | 31.05.2023 | 59.700 | 716 | 669 | 0,04 |
| | | | | | | | $ 2.911 | $ 4.774 | 0,26 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX,IG-38 5-Year Index | Sell | 1,200 % | 20.07.2022 | 3.200 | $ (5) | $ (2) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Sell | 1,200 | 20.07.2022 | 1.800 | (8) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Sell | 1,400 | 17.08.2022 | 2.900 | (8) | (10) | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX,IG-37 5-Year Index | Sell | 1,200 | 20.07.2022 | 2.700 | (5) | (1) | 0,00 |
| BRC | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Sell | 1,200 | 20.07.2022 | 2.200 | (10) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Sell | 1,600 | 17.08.2022 | 1.500 | (4) | (3) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX,IG-38 5-Year Index | Sell | 1,200 | 20.07.2022 | 1.700 | (2) | (1) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX,IG-38 5-Year Index | Sell | 1,400 | 17.08.2022 | 4.400 | (8) | (5) | 0,00 |
| GST | Call - OTC CDX,IG-38 5-Year Index | Buy | 0,700 | 17.08.2022 | 1.600 | (2) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX,IG-38 5-Year Index | Sell | 1,300 | 17.08.2022 | 5.300 | (12) | (8) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC CDX,IG-38 5-Year Index | Sell | 95,000 | 17.08.2022 | 900 | (11) | (14) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX,IG-38 5-Year Index | Sell | 1,250 | 20.07.2022 | 1.900 | (3) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX,IG-38 5-Year Index | Sell | 1,350 | 17.08.2022 | 3.800 | (9) | (5) | 0,00 |
| | | | | | | $ (87) | $ (59) | 0,00 |

### INFLATION-CAPPED OPTIONS

| Kontrahent | Beschreibung | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | Cap - OTC CPALEMU | $ 100.151 | Maximal [(Index Final/Index Initial - -1) - 3,000 %] oder 0 | 22.06.2035 | 1.200 | $ (55) | $ (17) | 0,00 |

## ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,000 % | 02.11.2022 | 2.900 | $ 0 | $ (633) | (0,04) |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,000 | 04.11.2022 | 3.190 | (79) | (697) | (0,04) |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,175 | 15.03.2023 | 1.800 | (66) | (432) | (0,03) |
| BRC | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,558 | 02.02.2023 | 6.600 | (151) | (17) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,000 | 04.11.2022 | 1.710 | (42) | (374) | (0,02) |
| CBK | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,736 | 23.02.2023 | 13.000 | (322) | (55) | 0,00 |
| DUB | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,350 | 08.08.2022 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,550 | 08.08.2022 | 200 | (1) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,340 | 17.11.2023 | 50.700 | (639) | (2.083) | (0,12) |
| GLM | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,350 | 26.04.2023 | 11.700 | (231) | (198) | (0,01) |
| JPM | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,785 | 25.01.2023 | 13.900 | (384) | (54) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,175 | 15.03.2023 | 1.800 | (65) | (432) | (0,02) |
| MYC | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,579 | 31.01.2023 | 6.600 | (154) | (17) | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,350 | 31.05.2023 | 32.900 | (717) | (610) | (0,03) |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,000 | 02.11.2022 | 2.700 | (65) | (589) | (0,03) |
| | | | | | | | $ (2.917) | $ (6.195) | (0,34) |

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPM | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 3,500 % fällig am 01.08.2052 | $ 96,906 | 04.08.2022 | 400 | $ (2) | $ (5) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,141 | 07.09.2022 | 600 | (2) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,156 | 07.09.2022 | 1.000 | (4) | (7) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,656 | 07.09.2022 | 1.700 | (6) | (14) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 101,141 | 07.09.2022 | 600 | (2) | (3) | 0,00 |
| SAL | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | 94,688 | 07.09.2022 | 2.100 | (12) | (11) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 99,156 | 07.07.2022 | 5.100 | (37) | (32) | (0,01) |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 99,563 | 07.07.2022 | 1.300 | (7) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 100,281 | 07.07.2022 | 3.000 | (15) | (6) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 98,234 | 07.09.2022 | 3.100 | (17) | (14) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,406 | 07.09.2022 | 1.400 | (5) | (10) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,656 | 07.09.2022 | 1.600 | (6) | (13) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 100,234 | 07.09.2022 | 3.100 | (14) | (25) | 0,00 |
| | | | | | $ (129) | $ (145) | (0,01) |

[1] Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| DUB | CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 % | 17.10.2057 | $ 1.500 | $ (104) | $ 105 | $ 1 | 0,00 |
| GST | CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 | 17.10.2057 | 1.800 | (94) | 95 | 1 | 0,00 |
| SAL | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 700 | (1) | (6) | (7) | 0,00 |
| | | | | | $ (199) | $ 194 | $ (5) | 0,00 |

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

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

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 1,998 % | 20.06.2028 | ILS 890 | $ 0 | $ (10) | $ (10) | 0,00 |
| BRC | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 1,950 | 20.06.2028 | 810 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| CKL | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 2,100 | 20.06.2028 | 750 | (3) | (4) | (7) | 0,00 |
| GLM | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 1,971 | 16.02.2028 | 1.430 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 1,998 | 20.06.2028 | 610 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| HUS | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 1,998 | 20.06.2028 | 480 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | | | | | | $ (3) | $ (49) | $ (52) | 0,00 |

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nenn-betrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Erhalt | BCOMTR Index | 1.673.815 | 3-Month U.S. Treasury Bill rate plus a specified spread | $ 464.028 | 15.02.2023 | $ 0 | $ (44.491) | $ (44.491) | (2,45) |
| CBK | Erhalt | BCOMTR Index | 155.536 | 3-Month U.S. Treasury Bill rate plus a specified spread | 43.119 | 15.02.2023 | 0 | (4.134) | (4.134) | (0,23) |
| | Erhalt | CIXBSTR3 Index | 324.655 | 3-Month U.S. Treasury Bill rate plus a specified spread | 99.461 | 15.02.2023 | 0 | (9.523) | (9.523) | (0,53) |
| CIB | Erhalt | BCOMTR Index | 154.350 | 3-Month U.S. Treasury Bill rate plus a specified spread | 42.790 | 15.02.2023 | 0 | (4.103) | (4.103) | (0,23) |
| FBF | Erhalt | BCOMTR Index | 83.595 | 3-Month U.S. Treasury Bill rate plus a specified spread | 23.175 | 15.02.2023 | 0 | (2.222) | (2.222) | (0,12) |
| GST | Erhalt | BCOMF1TC Index | 160.460 | 3-Month U.S. Treasury Bill rate plus a specified spread | 71.832 | 15.02.2023 | 0 | (6.978) | (6.978) | (0,38) |
| | Erhalt | BCOMTR Index | 1.547.867 | 3-Month U.S. Treasury Bill rate plus a specified spread | 429.112 | 15.02.2023 | 0 | (41.145) | (41.145) | (2,27) |
| | Erhalt | BCOMTR2 Index | 56.072 | 3-Month U.S. Treasury Bill rate plus a specified spread | 15.820 | 15.02.2023 | 0 | (1.516) | (1.516) | (0,08) |
| JPM | Erhalt | BCOMF1TC Index | 421.556 | 3-Month U.S. Treasury Bill rate plus a specified spread | 98.703 | 15.02.2023 | 0 | (9.589) | (9.589) | (0,53) |
| | Erhalt | BCOMTR Index | 2.275.248 | 3-Month U.S. Treasury Bill rate plus a specified spread | 630.762 | 15.02.2023 | 0 | (60.480) | (60.480) | (3,35) |
| | Erhalt | JMABDEWU Index | 494.170 | 0,053% | 76.190 | 15.02.2023 | 0 | 1.273 | 1.273 | 0,07 |
| MAC | Erhalt | BCOMTR Index | 149.916 | 3-Month U.S. Treasury Bill rate plus a specified spread | 41.561 | 15.02.2023 | 0 | (3.985) | (3.985) | (0,22) |
| MEI | Erhalt | BCOMTR Index | 223.008 | 3-Month U.S. Treasury Bill rate plus a specified spread | 61.824 | 15.02.2023 | 0 | (5.928) | (5.928) | (0,33) |
| SOG | Erhalt | BCOMTR Index | 229.778 | 3-Month U.S. Treasury Bill rate plus a specified spread | 63.701 | 15.02.2023 | 0 | (6.108) | (6.108) | (0,34) |
| | | | | | | | $ 0 | $ (198.929) | $ (198.929) | (10,99) |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | £ | 80.010 | $ | 101.164 | $ 3.996 | $ 0 | $ 3.996 | 0,22 |
| | 07.2022 | $ | 54.512 | DKK | 383.266 | 0 | (633) | (633) | (0,04) |
| | 07.2022 | | 1.344 | € | 1.283 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 382.488 | $ | 54.512 | 645 | 0 | 645 | 0,04 |
| BPS | 07.2022 | € | 5.411 | | 5.816 | 159 | 0 | 159 | 0,01 |
| | 07.2022 | ¥ | 489.700 | | 3.629 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 3.384 | DKK | 23.420 | 0 | (91) | (91) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 432.954 | € | 411.437 | 0 | (2.818) | (2.818) | (0,16) |
| | 07.2022 | | 1.400 | ¥ | 188.000 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 372.920 | $ | 392.952 | 2.363 | 0 | 2.363 | 0,13 |
| BRC | 07.2022 | $ | 37.412 | ¥ | 5.074.956 | 0 | (56) | (56) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 13.480 | SEK | 136.980 | 0 | (113) | (113) | (0,01) |
| | 08.2022 | ¥ | 5.066.714 | $ | 37.412 | 55 | 0 | 55 | 0,00 |
| | 08.2022 | SEK | 136.866 | | 13.480 | 111 | 0 | 111 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 77 | PEN | 288 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | € | 31.663 | $ | 33.996 | 894 | 0 | 894 | 0,05 |
| | 08.2022 | $ | 132 | PEN | 493 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 12.2022 | PEN | 5.499 | $ | 1.311 | 0 | (115) | (115) | (0,01) |
| DUB | 07.2022 | DKK | 113.469 | | 16.803 | 851 | 0 | 851 | 0,05 |
| GLM | 07.2022 | $ | 1.430 | DKK | 9.910 | 0 | (37) | (37) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 74 | PEN | 278 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | CAD | 3.683 | $ | 2.917 | 62 | 0 | 62 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 2.078 | | 2.184 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 07.2022 | NZD | 3.132 | | 2.043 | 96 | 0 | 96 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 7.899 | AUD | 11.470 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.747 | ¥ | 232.000 | 0 | (40) | (40) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 11.470 | $ | 7.900 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYI | 07.2022 | DKK | 383.612 | $ | 56.905 | $ 2.977 | $ 0 | $ 2.977 | 0,16 |
| | 07.2022 | £ | 30 | | 36 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 11.432 | DKK | 80.437 | 0 | (124) | (124) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 2.915 | € | 2.776 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.050 | £ | 1.690 | 3 | (1) | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 7.486 | ¥ | 1.019.261 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 109 | SGD | 151 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 80.274 | $ | 11.432 | 127 | 0 | 127 | 0,01 |
| | 08.2022 | ¥ | 1.017.610 | | 7.486 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | ILS | 626 | | 186 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | SEK | 137.167 | | 14.036 | 651 | 0 | 651 | 0,04 |
| | 07.2022 | $ | 3.685 | € | 3.526 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 5.819 | ¥ | 792.224 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 790.940 | $ | 5.819 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | € | 410.814 | | 441.546 | 12.062 | 0 | 12.062 | 0,67 |
| | 07.2022 | $ | 97.359 | £ | 79.999 | 0 | (204) | (204) | (0,01) |
| | 08.2022 | £ | 79.999 | $ | 97.404 | 202 | 0 | 202 | 0,01 |
| TOR | 07.2022 | ¥ | 7.241.506 | | 57.052 | 3.749 | 0 | 3.749 | 0,21 |
| | 07.2022 | $ | 1.332 | CAD | 1.707 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 10 | € | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 1.708 | $ | 1.332 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | AUD | 11.470 | | 8.193 | 305 | 0 | 305 | 0,02 |
| | 07.2022 | $ | 37.691 | € | 35.075 | 0 | (1.023) | (1.023) | (0,06) |
| | 07.2022 | | 14 | ILS | 47 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 29.399 | $ (5.341) | $ 24.058 | 1,33 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | € | 26.573 | $ | 28.137 | $ 356 | $ 0 | $ 356 | 0,02 |
| BPS | 07.2022 | | 276.275 | | 291.650 | 2.818 | 0 | 2.818 | 0,16 |
| | 07.2022 | $ | 8.490 | € | 8.041 | 0 | (83) | (83) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 237.282 | | 225.185 | 0 | (1.427) | (1.427) | (0,08) |
| CBK | 07.2022 | € | 1.556 | $ | 1.662 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 24.860 | € | 23.154 | 0 | (654) | (654) | (0,04) |
| JPM | 07.2022 | € | 34.596 | $ | 36.587 | 419 | 0 | 419 | 0,02 |
| MBC | 07.2022 | | 248.456 | | 261.427 | 1.682 | (3) | 1.679 | 0,09 |
| | 07.2022 | $ | 282.845 | € | 262.283 | 0 | (8.641) | (8.641) | (0,48) |
| | 08.2022 | | 237.326 | | 225.185 | 0 | (1.471) | (1.471) | (0,08) |
| SOG | 07.2022 | | 294.133 | | 273.661 | 0 | (8.034) | (8.034) | (0,44) |
| UAG | 07.2022 | | 245.251 | | 228.225 | 0 | (6.653) | (6.653) | (0,37) |
| | | | | | | $ 5.310 | $ (26.966) | $ (21.656) | (1,20) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | $ | 21.687 | £ | 17.229 | $ 0 | $ (763) | $ (763) | (0,04) |
| BPS | 07.2022 | | 2.536 | | 2.022 | 1 | (81) | (80) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | £ | 778 | $ | 956 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 18.356 | £ | 14.551 | 0 | (684) | (684) | (0,04) |
| CBK | 07.2022 | £ | 665 | $ | 834 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | | 812 | | 998 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 140 | £ | 111 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | | 49 | | 41 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | £ | 1.461 | $ | 1.794 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 16.350 | £ | 13.006 | 0 | (555) | (555) | (0,03) |
| SOG | 07.2022 | £ | 13.965 | $ | 16.996 | 36 | 0 | 36 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 17.004 | £ | 13.965 | 0 | (35) | (35) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | £ | 478 | $ | 583 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | | | | | | $ 110 | $ (2.123) | $ (2.013) | (0,11) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Class E SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 7.5/2022 | SGD | 2.036 | $ | 1.465 | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,00 |
| | 7.5/2022 | $ | 3.407 | SGD | 4.668 | 0 | (53) | (53) | 0,00 |
| | 8.2/2022 | | 1.465 | | 2.036 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| GLM | 7.5/2022 | SGD | 4.083 | $ | 2.939 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 7.5/2022 | $ | 90 | SGD | 124 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 8.2/2022 | | 2.939 | | 4.083 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| MBC | 7.5/2022 | SGD | 1.492 | $ | 1.077 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 8.2/2022 | | 125 | | 90 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 7.5/2022 | $ | 3.776 | SGD | 5.192 | 0 | (45) | (45) | 0,00 |
| MYI | 7.1/2022 | SGD | 71 | $ | 51 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 7.5/2022 | $ | 285 | SGD | 391 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| UAG | 7.5/2022 | SGD | 249 | $ | 181 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 7.5/2022 | $ | 3.522 | SGD | 4.827 | 0 | (54) | (54) | 0,00 |
| | | | | | | $ 14 | $ (163) | $ (149) | 0,00 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (200.388)** | **(11,06)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 1.923.330** | **106,13** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ (111.105)** | **(6,13)** |
| **Nettovermögen** | **$ 1.812.225** | **100,00** |

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

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

**^** **Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a)** **Nullkuponwertpapier.**

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

**(c)** **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

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

**(e)** **Mit dem Fonds verbunden.**

**(f)** **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(g)** **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 22.680 als Sicherheiten verpfändet.**

**(h)** **Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 167.913 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.**

**Barmittel in Höhe von USD 20.275 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 125.950 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 2.134.558 | $ 0 | $ 2.134.558 |
| Investmentfonds | 18 | 0 | 0 | 18 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 576 | 0 | 576 |
| Finanzderivate[3] | (3.288 ) | (208.534 ) | 0 | (211.822 ) |
| **Summen** | **$ (3.270 )** | **$ 1.926.600** | **$ 0** | **$ 1.923.330** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 1.554.523 | $ 0 | $ 1.554.523 |
| Investmentfonds | 18 | 0 | 0 | 18 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 2.098 | 0 | 2.098 |
| Finanzderivate[3] | 3.330 | 52.131 | 0 | 55.461 |
| **Summen** | **$ 3.348** | **$ 1.608.752** | **$ 0** | **$ 1.612.100** |

(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 2022:**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 1,510 % | 22.06.2022 | 06.07.2022 | $ (9.196) | $ (9.200) | (0,51) |
| | 1,570 | 27.06.2022 | 05.07.2022 | (13.172) | (13.174) | (0,72) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (22.374)** | **(1,23)** |

**Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2022:**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 1,510 % | 24.06.2022 | 01.07.2022 | $ (81.215) | $ (81.239) | (4,48) |
| CSN | 1,590 | 29.06.2022 | 06.07.2022 | (11.679) | (11.680) | (0,65) |
| | 1,590 | 30.06.2022 | 05.07.2022 | (11.209) | (11.209) | (0,62) |
| | 1,600 | 28.06.2022 | 05.07.2022 | (64.201) | (64.209) | (3,54) |
| **Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte** | | | | | **$ (168.337)** | **(9,29)** |

(1) In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 16 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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 3.519 | $ (3.580) | $ (61) |
| BPS | (44.274) | 25.580 | (18.694) |
| BRC | (822) | 770 | (52) |
| CBK | (13.429) | 7.710 | (5.719) |
| CIB | (4.103) | 2.240 | (1.863) |
| CKL | (7) | 0 | (7) |
| DUB | 380 | 0 | 380 |
| FBF | (2.222) | 1.210 | (1.012) |
| GLM | (60) | 0 | (60) |
| GST | (49.646) | 28.690 | (20.956) |
| HUS | (5) | 0 | (5) |
| JPM | (68.544) | 39.280 | (29.264) |
| MAC | (3.985) | 2.450 | (1.535) |
| MBC | (8.337) | 7.610 | (727) |
| MEI | (5.928) | 3.230 | (2.698) |
| MYC | (143) | 244 | 101 |
| MYI | 2.965 | (2.840) | 125 |
| SAL | (119) | 250 | 131 |
| SCX | 124 | 0 | 124 |
| SOG | (2.081) | (640) | (2.721) |
| TOR | 3.749 | (3.890) | (141) |
| UAG | (7.420) | 6.670 | (750) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 93,96 | 89,98 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 23,16 | 17,17 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 0,67 | 0,49 |
| Investmentfonds | 0,00 | 0,00 |
| Pensionsgeschäfte | 0,03 | 0,15 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,15) | 0,14 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,48) | (0,14) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (11,06) | 3,84 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (1,23) | (1,59) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (9,29) | (5,59) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Australien | 0,39 | 0,60 |
| Kanada | 0,14 | 0,20 |
| Cayman-Inseln | 5,31 | 0,45 |
| Dänemark | 3,45 | 4,57 |
| Frankreich | 7,66 | 7,69 |
| Deutschland | 0,79 | k. A. |
| Guernsey, Kanalinseln | 0,02 | 0,03 |
| Irland | 4,44 | 3,94 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Italien | 5,60 | 8,33 |
| Japan | 2,89 | 4,77 |
| Niederlande | 0,02 | 0,03 |
| Neuseeland | 0,10 | 0,15 |
| Peru | 0,06 | 0,10 |
| Katar | 0,02 | 0,04 |
| Saudi-Arabien | 0,02 | 0,02 |
| Spanien | 2,71 | 0,56 |
| Schweden | 0,75 | 1,06 |
| Vereinigtes Königreich | 5,30 | 6,62 |
| Vereinigte Staaten | 78,12 | 68,48 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,00 | k. A. |
| Investmentfonds | 0,00 | 0,00 |
| Pensionsgeschäfte | 0,03 | 0,15 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,15) | 0,14 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,00 | 0,00 |
| Zinsswaps | (0,48) | (0,14) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Zinsswapoptionen | | |
| Zinsswapoptionen | 0,26 | 0,08 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | 0,00 | 0,00 |
| Inflation-Capped Options | 0,00 | 0,00 |
| Zinsswapoptionen | (0,34) | (0,10) |
| Optionen auf Wertpapiere | (0,01) | (0,01) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | 0,00 | 0,00 |
| Zinsswaps | 0,00 | 0,01 |
| Total Return Swaps auf Wertpapiere | (10,99) | 3,70 |
| Devisenterminkontrakte | 1,33 | (0,17) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (1,31) | 0,33 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (6,13) | (11,63) |
| **Nettovermögen** | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **ARGENTINIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 1,000 % fällig am 09.07.2029 | $ | 13 | $ 3 | 0,01 |
| 2,500 % fällig am 09.07.2041 | | 800 | 208 | 0,17 |
| **Provincia de Buenos Aires** | | | | |
| 49,102 % fällig am 12.04.2025 | ARS | 20 | 0 | 0,00 |
| Summe Argentinien | | | 211 | 0,18 |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Santos Finance Ltd.** | | | | |
| 3,649 % fällig am 29.04.2031 | $ | 1.100 | 934 | 0,77 |
| **Virgin Australia Holdings Pty. Ltd** | | | | |
| 8,125 % fällig am 15.11.2024 ^ | | 400 | 20 | 0,02 |
| Summe Australien | | | 954 | 0,79 |
| **BERMUDA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **NCL Corp. Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.02.2027 | | 200 | 171 | 0,14 |
| **Viking Cruises Ltd.** | | | | |
| 13,000 % fällig am 15.05.2025 | | 300 | 308 | 0,25 |
| **Viking Ocean Cruises Ship Ltd.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.02.2029 | | 100 | 79 | 0,07 |
| Summe Bermuda | | | 558 | 0,46 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **CSN Resources S.A.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 10.06.2031 | | 300 | 213 | 0,18 |
| 5,875 % fällig am 08.04.2032 | | 300 | 229 | 0,19 |
| Summe Brasilien | | | 442 | 0,37 |
| **KANADA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **B.C. Unlimited Liability Co.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.01.2028 | | 250 | 217 | 0,18 |
| **Bombardier, Inc.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.06.2026 | | 200 | 166 | 0,14 |
| **Canadian Pacific Railway Co.** | | | | |
| 3,100 % fällig am 02.12.2051 | | 400 | 295 | 0,24 |
| Summe Kanada | | | 678 | 0,56 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Kaisa Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 11,500 % fällig am 30.01.2023 ^ | | 600 | 83 | 0,07 |
| **MGM China Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 18.06.2025 | | 500 | 385 | 0,32 |
| **New Metro Global Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 02.05.2026 | | 300 | 139 | 0,12 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | | |
| 6,720 % fällig am 01.12.2022 ^ | | 37 | 36 | 0,03 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 18.06.2030 | | 300 | 220 | 0,18 |
| 5,125 % fällig am 08.08.2025 | | 350 | 294 | 0,24 |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028 | | 600 | 463 | 0,38 |
| **Sitka Holdings LLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 06.07.2026 | | 300 | 290 | 0,24 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 26.04.2024 ^ | | 450 | 69 | 0,06 |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,240 % fällig am 03.06.2050 | | 200 | 138 | 0,11 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.10.2027 | | 600 | 389 | 0,32 |
| Summe Cayman Inseln | | | 2.506 | 2,07 |
| **CHINA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Yango Justice International Ltd.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.04.2024 ^ | $ | 200 | $ 16 | 0,02 |
| 9,250 % fällig am 15.04.2023 ^ | | 200 | 16 | 0,01 |
| Summe China | | | 32 | 0,03 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Accor S.A.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 29.11.2028 | € | 600 | 500 | 0,41 |
| **Altice France S.A.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.02.2025 | | 200 | 181 | 0,15 |
| Summe Frankreich | | | 681 | 0,56 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 2,625 % fällig am 28.04.2025 | | 500 | 464 | 0,39 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 4,950 % fällig am 01.06.2042 | $ | 200 | 135 | 0,11 |
| **Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA** | | | | |
| 3,500 % fällig am 09.10.2025 | € | 200 | 210 | 0,17 |
| Summe Italien | | | 809 | 0,67 |
| **LIBERIA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Royal Caribbean Cruises Ltd.** | | | | |
| 10,875 % fällig am 01.06.2023 | $ | 300 | 302 | 0,25 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **Intelsat Emergence S.A.** (b)(h) | | 7.480 | 209 | 0,17 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Constellation Oil Services Holding S.A. (3.000% Cash or 4.000% PIK)** | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.12.2026 (a) | $ | 504 | 373 | 0,31 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.03.2030 | | 562 | 465 | 0,38 |
| | | | 838 | 0,69 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | |
| 4,920 % fällig am 01.02.2029 | | 159 | 145 | 0,12 |
| **Ortho-Clinical Diagnostics S.A.** | | | | |
| 4,553 % fällig am 30.06.2025 | | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | 145 | 0,12 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **RECHTE** | | | | |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp 05/12/2025** | | 1.566 | 8 | 0,01 |
| Summe Luxemburg | | | 1.200 | 0,99 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **MEXIKO** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BBVA Bancomer S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 30.09.2022 | $ | 200 | 201 | 0,17 |
| **MULTINATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **American Airlines, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 20.04.2029 | | 300 | 257 | 0,21 |
| **Axalta Coating Systems LLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.06.2027 | | 200 | 180 | 0,15 |
| **Delta Air Lines, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 20.10.2025 | | 100 | 98 | 0,08 |
| 4,750 % fällig am 20.10.2028 | | 400 | 378 | 0,31 |
| **NXP BV** | | | | |
| 3,250 % fällig am 11.05.2041 | $ | 875 | $ 660 | 0,55 |
| Summe multinational | | | 1.573 | 1,30 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Clear Channel International BV** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.08.2025 | | 200 | 187 | 0,16 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 5,750 % fällig am 16.11.2026 (e)(g) | | 200 | 183 | 0,15 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.05.2024 (e)(g) | € | 700 | 716 | 0,59 |
| **Prosus NV** | | | | |
| 3,832 % fällig am 08.02.2051 | $ | 300 | 181 | 0,15 |
| Summe Niederlande | | | 1.267 | 1,05 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Adevinta ASA** | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.11.2025 | € | 100 | 94 | 0,08 |
| **PANAMA** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Carnival Corp.** | | | | |
| 6,127 % fällig am 18.10.2028 | $ | 100 | 90 | 0,07 |
| **PERU** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | PEN | 100 | 23 | 0,02 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 | | 2.900 | 720 | 0,59 |
| Summe Peru | | | 743 | 0,61 |
| **KATAR** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 3,750 % fällig am 16.04.2030 | $ | 400 | 398 | 0,33 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 10,500 % fällig am 21.12.2026 | ZAR | 26.800 | 1.732 | 1,43 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Cellnex Finance Co. S.A.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 08.06.2028 | € | 400 | 328 | 0,27 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC** | | | | |
| 2,950 % fällig am 27.01.2029 | $ | 500 | 150 | 0,13 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 4,600 % fällig am 17.12.2030 (e)(g) | | 300 | 232 | 0,19 |
| **INEOS Quattro Finance PLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.01.2026 | € | 100 | 88 | 0,07 |
| **John Lewis PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 18.12.2034 | £ | 300 | 277 | 0,23 |
| **Market Bidco Finco PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 04.11.2027 | € | 800 | 667 | 0,55 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.08.2030 | £ | 300 | 291 | 0,24 |
| **Vmed O2 UK Financing PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 31.01.2031 | € | 375 | 303 | 0,25 |
| Summe Großbritannien | | | 2.008 | 1,66 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,449 % fällig am 25.12.2045 ^ | $ | 302 | 251 | 0,21 |
| **Argent Securities Trust** | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.09.2036 | | 781 | 286 | 0,24 |
| 1,984 % fällig am 25.04.2036 | | 275 | 99 | 0,08 |
| 2,184 % fällig am 25.04.2036 | | 673 | 245 | 0,20 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,449 % fällig am 25.06.2036 $ | 73 | $ 73 | 0,06 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,784 % fällig am 25.12.2036 | 1.719 | 990 | 0,82 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,049 % fällig am 25.10.2034 | 342 | 335 | 0,28 |
| **GSAMP Trust** | | | |
| 1,714 % fällig am 25.01.2037 | 391 | 251 | 0,21 |
| 1,744 % fällig am 25.12.2036 | 550 | 292 | 0,24 |
| 1,854 % fällig am 25.12.2046 | 682 | 363 | 0,30 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,104 % fällig am 25.08.2036 | 494 | 212 | 0,18 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | |
| 1,744 % fällig am 25.11.2037 | 73 | 30 | 0,02 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | |
| 1,754 % fällig am 25.01.2037 | 360 | 191 | 0,16 |
| 1,764 % fällig am 25.10.2036 | 280 | 142 | 0,12 |
| 1,854 % fällig am 25.09.2036 | 61 | 29 | 0,02 |
| 1,924 % fällig am 25.09.2036 | 1.825 | 741 | 0,61 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | |
| 1,724 % fällig am 25.04.2037 | 65 | 38 | 0,03 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 6,465 % fällig am 25.09.2046 ^ | 647 | 286 | 0,24 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | |
| 4,624 % fällig am 25.01.2033 ^ | 71 | 62 | 0,05 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | |
| 1,924 % fällig am 25.06.2036 | 567 | 452 | 0,37 |
| 1,924 % fällig am 25.09.2036 | 881 | 419 | 0,35 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,874 % fällig am 25.03.2037 | 514 | 293 | 0,24 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | |
| 2,084 % fällig am 25.12.2035 | 1.184 | 1.036 | 0,86 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | |
| 2,504 % fällig am 25.08.2034 | 399 | 381 | 0,31 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | |
| 2,584 % fällig am 25.01.2036 ^ | 136 | 127 | 0,10 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | |
| 1,804 % fällig am 25.07.2037 | 268 | 252 | 0,21 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | |
| 1,924 % fällig am 25.09.2037 | 376 | 275 | 0,23 |
| | | 8.151 | 6,74 |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **COMMON STOCKS** | | | |
| **ENERGIE** | | | |
| **Constellation Oil Services Holding S.A. (b)(h)** | 580.149 | 63 | 0,05 |
| **FINANCIALS** | | | |
| **Stearns Holdings LLC 'B' (b)** | 157.159 | 0 | 0,00 |
| Summe Stammaktien | | 63 | 0,05 |

| | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **AES Corp.** | | | |
| 2,450 % fällig am 15.01.2031 $ | 375 | 302 | 0,25 |
| **Alleghany Corp.** | | | |
| 3,250 % fällig am 15.08.2051 | 225 | 164 | 0,14 |
| **American Airlines Pass-Through Trust** | | | |
| 3,375 % fällig am 01.11.2028 | 391 | 351 | 0,29 |
| **American Homes 4 Rent LP** | | | |
| 3,375 % fällig am 15.07.2051 | 600 | 416 | 0,34 |
| **American Tower Corp.** | | | |
| 2,950 % fällig am 15.01.2051 | 1.425 | 968 | 0,80 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.11.2027 | 400 | 353 | 0,29 |
| **Bank of America Corp.** | | | |
| 3,384 % fällig am 02.04.2026 | 200 | 194 | 0,16 |
| **Baxter International, Inc.** | | | |
| 3,132 % fällig am 01.12.2051 | 900 | 652 | 0,54 |
| **BCPE Ulysses Intermediate, Inc. (7,750 % bar oder 8,500 % PIK)** | | | |
| 7,750 % fällig am 01.04.2027 (a) | 650 | 401 | 0,33 |
| **Boeing Co.** | | | |
| 3,950 % fällig am 01.08.2059 | 900 | 607 | 0,50 |
| 5,705 % fällig am 01.05.2040 $ | 600 | $ 561 | 0,46 |
| 5,805 % fällig am 01.05.2050 | 100 | 92 | 0,08 |
| **Booz Allen Hamilton, Inc.** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.07.2029 | 225 | 197 | 0,16 |
| **Broadcom, Inc.** | | | |
| 3,187 % fällig am 15.11.2036 | 5 | 4 | 0,00 |
| **Brown & Brown, Inc.** | | | |
| 4,950 % fällig am 17.03.2052 | 225 | 198 | 0,16 |
| **CCO Holdings LLC** | | | |
| 4,500 % fällig am 01.06.2033 | 800 | 632 | 0,52 |
| **Centene Corp.** | | | |
| 4,250 % fällig am 15.12.2027 | 100 | 94 | 0,08 |
| **CF Industries, Inc.** | | | |
| 5,375 % fällig am 15.03.2044 | 300 | 280 | 0,23 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | |
| 3,950 % fällig am 30.06.2062 | 475 | 318 | 0,26 |
| **Chesapeake Energy Corp.** | | | |
| 5,500 % fällig am 01.02.2026 | 100 | 95 | 0,08 |
| **Clearway Energy Operating LLC** | | | |
| 3,750 % fällig am 15.02.2031 | 200 | 162 | 0,13 |
| **Crown Castle International Corp.** | | | |
| 2,250 % fällig am 15.01.2031 | 400 | 325 | 0,27 |
| **DAE Funding LLC** | | | |
| 1,550 % fällig am 01.08.2024 | 800 | 750 | 0,62 |
| **DCP Midstream Operating LP** | | | |
| 3,250 % fällig am 15.02.2032 | 200 | 157 | 0,13 |
| **Diamond Sports Group LLC** | | | |
| 5,375 % fällig am 15.08.2026 | 400 | 100 | 0,08 |
| **Directv Financing LLC** | | | |
| 5,875 % fällig am 15.08.2027 | 300 | 257 | 0,21 |
| **DISH DBS Corp.** | | | |
| 5,750 % fällig am 01.12.2028 | 150 | 111 | 0,09 |
| **DT Midstream, Inc.** | | | |
| 4,125 % fällig am 15.06.2029 | 200 | 170 | 0,14 |
| **Duke Energy Florida LLC** | | | |
| 3,400 % fällig am 01.10.2046 | 300 | 237 | 0,20 |
| **Energy Transfer LP** | | | |
| 5,000 % fällig am 15.05.2044 | 300 | 251 | 0,21 |
| **Entergy Corp.** | | | |
| 3,750 % fällig am 15.06.2050 | 100 | 79 | 0,07 |
| **EQM Midstream Partners LP** | | | |
| 7,500 % fällig am 01.06.2030 | 100 | 96 | 0,08 |
| **EQT Corp.** | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2029 | 325 | 315 | 0,26 |
| **Equinix, Inc.** | | | |
| 3,000 % fällig am 15.07.2050 | 450 | 309 | 0,26 |
| **Expedia Group, Inc.** | | | |
| 3,250 % fällig am 15.02.2030 | 400 | 334 | 0,28 |
| **FirstEnergy Transmission LLC** | | | |
| 4,350 % fällig am 15.01.2025 | 325 | 320 | 0,26 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | |
| 4,542 % fällig am 01.08.2026 | 200 | 183 | 0,15 |
| 4,950 % fällig am 28.05.2027 | 600 | 559 | 0,46 |
| **Freeport-McMoRan, Inc.** | | | |
| 5,250 % fällig am 01.09.2029 | 700 | 670 | 0,55 |
| **Frontier Communications Holdings LLC** | | | |
| 8,750 % fällig am 15.05.2030 | 200 | 203 | 0,17 |
| **Global Atlantic Fin Co.** | | | |
| 3,125 % fällig am 15.06.2031 | 300 | 239 | 0,20 |
| **GLP Capital LP** | | | |
| 4,000 % fällig am 15.01.2030 | 1.100 | 965 | 0,80 |
| **Goodman U.S. Finance Five LLC** | | | |
| 4,625 % fällig am 04.05.2032 | 50 | 49 | 0,04 |
| **HCA, Inc.** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.09.2030 | 350 | 299 | 0,25 |
| 4,625 % fällig am 15.03.2052 | 725 | 581 | 0,48 |
| **Hilton Domestic Operating Co., Inc.** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.05.2031 | 400 | 334 | 0,28 |
| **Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC** | | | |
| 4,875 % fällig am 01.07.2031 | 100 | 76 | 0,06 |
| 5,000 % fällig am 01.06.2029 | 500 | 406 | 0,34 |
| **Host Hotels & Resorts LP** | | | |
| 3,375 % fällig am 15.12.2029 | 100 | 85 | 0,07 |
| 3,500 % fällig am 15.09.2030 | 500 | 428 | 0,35 |
| **Hyatt Hotels Corp.** | | | |
| 4,375 % fällig am 15.09.2028 $ | 100 | $ 94 | 0,08 |
| **Infor, Inc.** | | | |
| 1,450 % fällig am 15.07.2023 | 100 | 97 | 0,08 |
| **Intercontinental Exchange, Inc.** | | | |
| 3,000 % fällig am 15.09.2060 | 975 | 660 | 0,55 |
| 4,600 % fällig am 15.03.2033 | 100 | 100 | 0,08 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.08.2024 (e) | 100 | 88 | 0,07 |
| **Kansas City Southern** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.05.2050 | 400 | 313 | 0,26 |
| **Las Vegas Sands Corp.** | | | |
| 3,900 % fällig am 08.08.2029 | 100 | 82 | 0,07 |
| **Leidos, Inc.** | | | |
| 2,300 % fällig am 15.02.2031 | 400 | 319 | 0,26 |
| **Lindblad Expeditions LLC** | | | |
| 6,750 % fällig am 15.02.2027 | 100 | 86 | 0,07 |
| **Live Nation Entertainment, Inc.** | | | |
| 3,750 % fällig am 15.01.2028 | 100 | 86 | 0,07 |
| **Magallanes, Inc.** | | | |
| 5,141 % fällig am 15.03.2052 | 775 | 651 | 0,54 |
| **Manitowoc Co., Inc.** | | | |
| 9,000 % fällig am 01.04.2026 | 500 | 466 | 0,39 |
| **Midcap Financial Issuer Trust** | | | |
| 6,500 % fällig am 01.05.2028 | 400 | 345 | 0,29 |
| **Mileage Plus Holdings LLC** | | | |
| 6,500 % fällig am 20.06.2027 | 100 | 99 | 0,08 |
| **Moody's Corp.** | | | |
| 3,100 % fällig am 29.11.2061 | 475 | 327 | 0,27 |
| **MPH Acquisition Holdings LLC** | | | |
| 5,500 % fällig am 01.09.2028 | 250 | 223 | 0,18 |
| **MPT Operating Partnership LP** | | | |
| 2,550 % fällig am 05.12.2023 £ | 100 | 117 | 0,10 |
| 4,625 % fällig am 01.08.2029 $ | 400 | 352 | 0,29 |
| **MSCI, Inc.** | | | |
| 4,000 % fällig am 15.11.2029 | 100 | 89 | 0,07 |
| **Narragansett Electric Co.** | | | |
| 3,395 % fällig am 09.04.2030 | 100 | 94 | 0,08 |
| **Nationstar Mortgage Holdings, Inc.** | | | |
| 5,125 % fällig am 15.12.2030 | 600 | 449 | 0,37 |
| **Netflix, Inc.** | | | |
| 5,375 % fällig am 15.11.2029 | 300 | 284 | 0,24 |
| **Newell Brands, Inc.** | | | |
| 4,450 % fällig am 01.04.2026 | 325 | 311 | 0,26 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | |
| 2,500 % fällig am 01.02.2031 | 200 | 153 | 0,13 |
| 3,150 % fällig am 01.01.2026 | 300 | 275 | 0,23 |
| 3,950 % fällig am 01.12.2047 ^ | 425 | 295 | 0,24 |
| 4,550 % fällig am 01.07.2030 | 100 | 89 | 0,07 |
| **Park River Holdings, Inc.** | | | |
| 5,625 % fällig am 01.02.2029 | 800 | 500 | 0,41 |
| **PennyMac Financial Services, Inc.** | | | |
| 5,750 % fällig am 15.09.2031 | 300 | 224 | 0,19 |
| **PGT Innovations, Inc.** | | | |
| 4,375 % fällig am 01.10.2029 | 325 | 257 | 0,21 |
| **Prime Healthcare Services, Inc.** | | | |
| 7,250 % fällig am 01.11.2025 | 300 | 257 | 0,21 |
| **SBA Communications Corp.** | | | |
| 3,125 % fällig am 01.02.2029 | 200 | 164 | 0,14 |
| **Southern California Edison Co.** | | | |
| 3,650 % fällig am 01.02.2050 | 400 | 307 | 0,25 |
| **Spirit AeroSystems, Inc.** | | | |
| 7,500 % fällig am 15.04.2025 | 1.100 | 1.025 | 0,85 |
| **Sprint Corp.** | | | |
| 7,875 % fällig am 15.09.2023 | 600 | 620 | 0,51 |
| **Station Casinos LLC** | | | |
| 4,625 % fällig am 01.12.2031 | 200 | 156 | 0,13 |
| **Sysco Corp.** | | | |
| 3,150 % fällig am 14.12.2051 | 425 | 305 | 0,25 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | |
| 2,625 % fällig am 15.04.2026 | 350 | 318 | 0,26 |
| 3,600 % fällig am 15.11.2060 | 875 | 644 | 0,53 |
| **Take-Two Interactive Software, Inc.** | | | |
| 4,000 % fällig am 14.04.2032 | 325 | 305 | 0,25 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Time Warner Entertainment Co. LP** | | | | |
| 8,375 % fällig am 15.07.2033 | $ | 100 | $ 116 | 0,10 |
| **Travel + Leisure Co.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.04.2027 | | 325 | 295 | 0,24 |
| 6,625 % fällig am 31.07.2026 | | 100 | 95 | 0,08 |
| **Triumph Group, Inc.** | | | | |
| 8,875 % fällig am 01.06.2024 | | 885 | 893 | 0,74 |
| **United Airlines, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.04.2026 | | 100 | 88 | 0,07 |
| 4,625 % fällig am 15.04.2029 | | 400 | 341 | 0,28 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.02.2025 | | 300 | 283 | 0,23 |
| **Venture Global Calcasieu Pass LLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.08.2029 | | 200 | 175 | 0,15 |
| 3,875 % fällig am 01.11.2033 | | 300 | 248 | 0,21 |
| **VICI Properties LP** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.02.2029 | | 1.325 | 1.142 | 0,94 |
| 4,250 % fällig am 01.12.2026 | | 100 | 92 | 0,08 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 3,526 % fällig am 24.03.2028 | | 100 | 95 | 0,08 |
| **Weyerhaeuser Co.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 09.03.2052 | | 1.125 | 932 | 0,77 |
| 7,375 % fällig am 15.03.2032 | | 99 | 115 | 0,10 |
| **White Cap Buyer LLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.10.2028 | | 300 | 240 | 0,20 |
| **White Cap Parent LLC (8,250 % bar oder 8,250 % PIK)** | | | | |
| 8,250 % fällig am 15.03.2026 (a) | | 1.100 | 917 | 0,76 |
| **Willis North America, Inc.** | | | | |
| 4,650 % fällig am 15.06.2027 | | 200 | 197 | 0,16 |
| **WP Carey, Inc.** | | | | |
| 3,850 % fällig am 15.07.2029 | | 100 | 93 | 0,08 |
| **Zayo Group Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.03.2027 | | 300 | 249 | 0,21 |
| | | | 34.161 | 28,25 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **ASP Unifrax Holdings, Inc.** | | | | |
| TBD % fällig am 12.12.2025 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC** | | | | |
| 3,845 % fällig am 01.12.2027 | | 197 | 188 | 0,15 |
| **Buckeye Partners LP** | | | | |
| 3,916 % fällig am 01.11.2026 | | 1.092 | 1.047 | 0,87 |
| **Caesars Resort Collection LLC** | | | | |
| 5,166 % fällig am 21.07.2025 | | 99 | 96 | 0,08 |
| **Calpine Corp.** | | | | |
| 4,170 % fällig am 16.12.2027 | | 455 | 433 | 0,36 |
| **Castlelake Aviation Ltd.** | | | | |
| 4,579 % fällig am 22.10.2026 | | 86 | 83 | 0,07 |
| **Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,739 % fällig am 21.08.2026 | | 296 | 254 | 0,21 |
| **Elanco Animal Health, Inc.** | | | | |
| 2,812 % fällig am 01.08.2027 | | 565 | 535 | 0,44 |
| **Embecta Corp.** | | | | |
| 5,054 % fällig am 30.03.2029 | | 83 | 78 | 0,06 |
| **IRB Holding Corp.** | | | | |
| 4,416 % fällig am 05.02.2025 | | 292 | 278 | 0,23 |
| **Parexel International Corp.** | | | | |
| 4,883 % fällig am 15.11.2028 | | 599 | 565 | 0,47 |
| **Rackspace Technology Global, Inc.** | | | | |
| 4,160 % fällig am 15.02.2028 | | 198 | 181 | 0,15 |
| **RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,416 % fällig am 16.11.2025 | | 1.136 | 1.062 | 0,88 |
| **Spirit Aerosystems, Inc.** | | | | |
| 5,416 % fällig am 15.01.2025 | | 396 | 386 | 0,32 |
| **Trans Union LLC** | | | | |
| 3,916 % fällig am 01.12.2028 | | 87 | 83 | 0,07 |
| **TransDigm, Inc.** | | | | |
| 3,916 % fällig am 22.08.2024 | | 199 | 192 | 0,16 |
| 3,916 % fällig am 30.05.2025 | | 299 | 285 | 0,23 |
| **United Airlines, Inc.** | | | | |
| 5,392 % fällig am 21.04.2028 | | 297 | 277 | 0,23 |
| **USI, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 02.12.2026 | $ | 975 | $ 925 | 0,76 |
| | | | 6.948 | 5,74 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **NON-AGENCY-MBS** | | | |
| **Banc of America Funding Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 | 210 | 168 | 0,14 |
| **BCAP LLC Trust** | | | |
| 2,064 % fällig am 25.05.2047 ^ | 174 | 170 | 0,14 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 3,440 % fällig am 25.07.2036 ^ | 47 | 44 | 0,04 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | |
| 1,802 % fällig am 20.09.2046 | 9 | 9 | 0,01 |
| 1,876 % fällig am 25.08.2035 | 12 | 12 | 0,01 |
| 2,004 % fällig am 25.09.2046 ^ | 6 | 5 | 0,00 |
| 2,924 % fällig am 25.10.2035 ^ | 13 | 10 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 ^ | 281 | 173 | 0,14 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | 126 | 106 | 0,09 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2037 ^ | 1.962 | 987 | 0,82 |
| 15,335 % fällig am 25.07.2035 | 159 | 165 | 0,14 |
| 21,906 % fällig am 25.09.2037 | 304 | 324 | 0,27 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 2,733 % fällig am 25.09.2037 ^ | 73 | 67 | 0,06 |
| 5,750 % fällig am 25.07.2037 ^ | 7 | 5 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.09.2035 | 233 | 101 | 0,08 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | |
| 2,476 % fällig am 29.12.2037 | 715 | 511 | 0,42 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | 154 | 93 | 0,08 |
| 6,500 % fällig am 25.10.2021 ^ | 157 | 21 | 0,02 |
| **Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,764 % fällig am 25.07.2047 | 14 | 13 | 0,01 |
| 1,774 % fällig am 25.02.2047 | 3.322 | 2.132 | 1,76 |
| 2,004 % fällig am 25.10.2036 ^ | 179 | 66 | 0,05 |
| **Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,143 % fällig am 25.08.2035 ^ | 13 | 13 | 0,01 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | |
| 2,949 % fällig am 25.08.2035 ^ | 6 | 5 | 0,00 |
| **Impac Secured Assets Trust** | | | |
| 1,924 % fällig am 25.11.2036 | 97 | 94 | 0,08 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,874 % fällig am 25.02.2037 | 24 | 17 | 0,01 |
| 2,496 % fällig am 25.12.2034 | 251 | 248 | 0,21 |
| 2,941 % fällig am 25.05.2037 ^ | 58 | 52 | 0,04 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | |
| 6,500 % fällig am 25.07.2036 ^ | 242 | 127 | 0,11 |
| **Lehman XS Trust** | | | |
| 1,804 % fällig am 25.07.2037 ^ | 305 | 280 | 0,23 |
| 1,906 % fällig am 25.08.2047 ^ | 204 | 185 | 0,15 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,789 % fällig am 25.11.2037 | 206 | 162 | 0,13 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | |
| 1,974 % fällig am 25.08.2035 ^ | 22 | 18 | 0,02 |
| 2,374 % fällig am 25.11.2036 ^ | 589 | 455 | 0,38 |
| 3,564 % fällig am 25.07.2035 | 2 | 2 | 0,00 |
| 4,084 % fällig am 25.12.2035 ^ | 18 | 15 | 0,01 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | |
| 5,750 % fällig am 25.03.2037 ^ | 227 | 88 | 0,07 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2036 | 323 | 161 | 0,13 |
| 6,250 % fällig am 25.11.2036 ^ | 479 | 218 | 0,18 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,104 % fällig am 25.05.2037 ^ | 88 | 81 | 0,07 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 2,074 % fällig am 25.05.2035 ^ | 1.403 | 1.200 | 0,99 |
| | | 8.603 | 7,11 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Freddie Mac** | | | | |
| 5,992 % fällig am 25.11.2055 | | 646 | 396 | 0,33 |
| **Ginnie Mae, TBA** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 | $ | 200 | $ 183 | 0,15 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.08.2052 | | 100 | 87 | 0,07 |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 | | 1.100 | 989 | 0,82 |
| 3,000 % fällig am 01.08.2052 | | 100 | 93 | 0,08 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2052 | | 900 | 886 | 0,73 |
| | | | 2.634 | 2,18 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 2,500 % fällig am 30.04.2024 | | 1.900 | 1.884 | 1,56 |
| 2,750 % fällig am 30.04.2027 | | 2.100 | 2.072 | 1,71 |
| 2,875 % fällig am 15.05.2032 | | 2.100 | 2.076 | 1,72 |
| | | | 6.032 | 4,99 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **OPTIONSSCHEINE** | | | | |
| **Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31. Dezember 2060** | | 753 | 0 | 0,00 |
| **Vistra Corp. - Exp. 2. Februar 2024** | | 31.815 | 9 | 0,01 |
| | | | 9 | 0,01 |
| Summe United States | | | 66.601 | 55,07 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **JUNGFERNINSELN (BRITISCH)** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Studio City Finance Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2029 | $ | 500 | 259 | 0,21 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | | |
| 51,049 % fällig am 30.09.2022 (c)(d) | ARS | 600 | 2 | 0,00 |
| **U.S. TREASURY BILLS** | | | | |
| 0,672 % fällig am 07.07.2022 (c)(d) | $ | 2.200 | 2.199 | 1,82 |
| 0,676 % fällig am 19.07.2022 (c)(d) | | 6.100 | 6.097 | 5,04 |
| 0,722 % fällig am 26.07.2022 (c)(d) | | 5.900 | 5.896 | 4,87 |
| 0,797 % fällig am 14.07.2022 (c)(d) | | 5.200 | 5.198 | 4,30 |
| 0,874 % fällig am 21.07.2022 (c)(d) | | 2.200 | 2.199 | 1,82 |
| | | | 21.589 | 17,85 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 21.591 | 17,85 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **$ 105.258** | **87,03** |
| | | **AKTIEN** | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)** | | 1.152.870 | 11.469 | 9,47 |
| **PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)** | | 9.239 | 125 | 0,11 |
| | | | 11.594 | 9,58 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)** | | 4.000 | 396 | 0,33 |
| **Summe Investmentfonds** | | | **$11.990** | **9,91** |

**PENSIONSGESCHÄFTE**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 1,480 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 2.000 | U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.02.2041 | $ (2.046) | $ 2.000 | $ 2.000 | 1,65 |
| FICC | 0,400 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 482 | U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | (492) | 482 | 482 | 0,40 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (2.538)** | **$ 2.482** | **$ 2.482** | **2,05** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 4 | $ 17 | 0,01 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 77 | 96 | 0,08 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 102 | (40) | (0,03) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 101 | 95 | 0,08 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2022 | 12 | 15 | 0,01 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 53 | 71 | 0,06 |
| | | | | $ 254 | 0,21 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 254** | **0,21** |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Anheuser-Busch InBev S.A. | (1,000) % | 20.12.2023 | € 1.300 | $ 18 | 0,01 |
| AutoZone, Inc. | (1,000) | 20.06.2024 | $ 1.400 | 14 | 0,01 |
| Bath & Body Works, Inc. | (1,000) | 20.12.2023 | 350 | 3 | 0,00 |
| ConocoPhillips | (1,000) | 20.12.2024 | 100 | (1) | 0,00 |
| Johnson Controls International PLC | (1,000) | 20.12.2024 | 1.500 | 32 | 0,03 |
| Lowe's Cos., Inc. | (1,000) | 20.12.2023 | 700 | 8 | 0,01 |
| Tyson Foods, Inc. | (1,000) | 20.06.2024 | 1.400 | 22 | 0,02 |
| | | | | $ 96 | 0,08 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Bombardier, Inc. | 5,000 % | 20.12.2024 | $ 200 | $ (5) | (0,01) |
| DISH DBS Corp. | 5,000 | 20.12.2022 | 200 | (11) | (0,01) |
| MetLife, Inc. | 1,000 | 20.12.2024 | 100 | (1) | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.06.2025 | € 100 | 13 | 0,01 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.12.2025 | 200 | (1) | 0,00 |
| Toll Brothers Finance Corp. | 1,000 | 20.06.2026 | $ 1.000 | (51) | (0,04) |
| | | | | $ (56) | (0,05) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-37 10-Year Index | (1,000) % | 20.12.2031 | $ 3.600 | $ 100 | 0,08 |
| CDX.IG-38 10-Year Index | (1,000) | 20.06.2032 | 4.100 | 45 | 0,04 |
| | | | | $ 145 | 0,12 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-38 5-Year Index | 5,000 % | 20.06.2027 | $ 2.574 | $ (179) | (0,15) |
| iTraxx Crossover 37 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2027 | € 100 | (5) | 0,00 |
| iTraxx Europe Main 36 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 200 | (1) | 0,00 |
| iTraxx Europe Main 37 10-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 200 | (2) | 0,00 |
| | | | | $ (187) | (0,15) |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 % | 21.09.2027 | £ 2.900 | $ (101) | (0,08) |
| Erhalt[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2032 | 900 | 71 | 0,06 |
| Erhalt[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2052 | 800 | 139 | 0,11 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 15.09.2027 | ¥ 94.200 | 9 | 0,01 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2027 | $ 30.900 | (141) | (0,12) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,250 | 04.01.2027 | BRL 1.800 | (12) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,700 | 04.01.2027 | 7.400 | (31) | (0,03) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,963 | 22.04.2031 | CAD 900 | (88) | (0,07) |
| Zahlung[4] | 3-Month USD-LIBOR | 1,270 | 04.11.2023 | $ 3.300 | (15) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,300 | 28.04.2027 | ZAR 15.500 | 27 | 0,02 |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | € 2.100 | 178 | 0,15 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 13.05.2027 | 600 | (19) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.05.2027 | 300 | (10) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,140 | 24.03.2023 | MXN 7.200 | (11) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,345 | 13.06.2023 | 15.200 | (30) | (0,02) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,400 | 05.03.2026 | 10.000 | (58) | (0,05) |
| | | | | | $ (92) | (0,08) |
| **Total Centrally Cleared Financial Derivative Instruments** | | | | | **$ (94)** | **(0,08)** |

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

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

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

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

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

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

**OPTIONSKAUF**

**ZINSSWAPOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,021 % | 25.10.2023 | 1.500 | $ 85 | $ 275 | 0,23 |
| BPS | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,000 | 15.03.2023 | 260 | 30 | 123 | 0,10 |
| JPM | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,000 | 15.03.2023 | 180 | 20 | 85 | 0,07 |
| | | | | | | | $ 135 | $ 483 | 0,40 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

**CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX,IG-38 5-Year Index | Sell | 1,200 % | 20.07.2022 | 300 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Sell | 1,400 | 17.08.2022 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX,IG-37 5-Year Index | Sell | 1,200 | 20.07.2022 | 300 | (1) | 0 | 0,00 |
| BRC | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Sell | 7,000 | 17.08.2022 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Sell | 1,600 | 17.08.2022 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX,IG-38 5-Year Index | Sell | 1,200 | 20.07.2022 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX,IG-38 5-Year Index | Sell | 1,400 | 17.08.2022 | 200 | 0 | 0 | 0,00 |
| GST | Call - OTC CDX,IG-38 5-Year Index | Buy | 0,700 | 17.08.2022 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX,IG-38 5-Year Index | Sell | 1,300 | 17.08.2022 | 300 | (1) | (1) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC CDX,IG-38 5-Year Index | Sell | 95,000 | 17.08.2022 | 100 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Sell | 7,000 | 17.08.2022 | 200 | (2) | (2) | (0,01) |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Sell | 1,200 | 20.07.2022 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX,IG-38 5-Year Index | Sell | 1,250 | 20.07.2022 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX,IG-38 5-Year Index | Sell | 1,350 | 17.08.2022 | 200 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (8) | $ (8) | (0,01) |

## ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 0,020 % | 25.10.2023 | 7.500 | $ (86) | $ (388) | (0,32) |
| BPS | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,175 | 15.03.2023 | 790 | (29) | (190) | (0,16) |
| CBK | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,600 | 07.07.2022 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,000 | 07.07.2022 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| DUB | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,350 | 08.08.2022 | 300 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,550 | 08.08.2022 | 300 | (1) | (6) | 0,00 |
| GLM | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,870 | 02.11.2022 | 12.400 | (25) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,270 | 02.11.2022 | 12.400 | (25) | (284) | (0,23) |
| JPM | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,175 | 15.03.2023 | 550 | (20) | (132) | (0,11) |
| MYC | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,570 | 05.07.2022 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,970 | 05.07.2022 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | $ (191) | $ (1.000) | (0,82) |

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SAL | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | $ 99,156 | 07.07.2022 | 200 | $ (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 | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | Mexico Government International Bond | (1,000) % | 20.12.2023 | $ 2.200 | $ 25 | $ (32) | $ (7) | (0,01) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | Italy Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2024 | $ 200 | $ 1 | $ 2 | $ 3 | 0,00 |
| | Pertamina Persero PT | 1,000 | 20.12.2024 | 100 | 0 | 1 | 1 | 0,00 |
| FBF | Italy Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 600 | 1 | 9 | 10 | 0,01 |
| | | | | | $ 2 | $ 12 | $ 14 | 0,01 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | CDX,HY-31 5-Year Index 25-35 % | 5,000 % | 20.12.2023 | $ 100 | $ 10 | $ (6) | $ 4 | 0,00 |
| GST | CDX,HY-31 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2023 | 200 | 23 | (14) | 9 | 0,01 |
| JPM | CDX,HY-31 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2023 | 300 | 39 | (25) | 14 | 0,01 |
| | | | | | $ 72 | $ (45) | $ 27 | 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.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | £ 1.080 | $ 1.366 | $ 54 | $ 0 | $ 54 | 0,04 |
| | 07.2022 | PEN 5.523 | 1.367 | 0 | (83) | (83) | (0,07) |
| | 07.2022 | ZAR 2.821 | 184 | 12 | 0 | 12 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ 131 | NOK 1.248 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 09.2022 | 751 | PEN 2.901 | 7 | 0 | 7 | 0,01 |
| | 12.2022 | PEN 2.936 | $ 769 | 8 | 0 | 8 | 0,01 |
| BPS | 07.2022 | MXN 1.384 | 66 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | PLN 13 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 5.045 | € 4.786 | 0 | (42) | (42) | (0,04) |
| | 07.2022 | 468 | £ 382 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07.2022 | 69 | MXN 1.384 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08.2022 | € | 4.118 | $ | 4.339 | $ 26 | $ 0 | $ 26 | 0,02 |
| | 08.2022 | $ | 29 | IDR | 424.361 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 18 | MXN | 393 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 11 | ZAR | 182 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | ZAR | 182 | $ | 12 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09.2022 | MXN | 1.384 | | 68 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11.2022 | $ | 8 | ZAR | 129 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 129 | $ | 9 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| BRC | 08.2022 | $ | 32 | IDR | 466.891 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 90 | NOK | 884 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 3.434 | $ | 230 | 23 | 0 | 23 | 0,02 |
| CBK | 07.2022 | € | 598 | | 639 | 13 | 0 | 13 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 29 | PEN | 109 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 104 | | 391 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| DUB | 12.2022 | ZAR | 3.896 | $ | 248 | 14 | 0 | 14 | 0,01 |
| | 02.2023 | | 3.013 | | 180 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | $ | 103 | BRL | 517 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 165 | MXN | 3.371 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 05.2023 | ZAR | 5.296 | $ | 317 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| JPM | 08.2022 | CNH | 84 | | 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 39 | IDR | 571.568 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | AUD | 484 | $ | 333 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 350 | AUD | 484 | 0 | (17) | (17) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 129 | £ | 105 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 193 | $ | 29 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 333 | AUD | 484 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 207 | CLP | 173.709 | 0 | (22) | (22) | (0,02) |
| | 08.2022 | | 17 | IDR | 251.439 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 05.2023 | CNH | 194 | $ | 29 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | $ | 6 | € | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 36 | IDR | 525.233 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 298 | PEN | 1.128 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 343 | $ | 51 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 207 | CHF | 207 | 10 | 0 | 10 | 0,01 |
| | 08.2022 | | 216 | PEN | 807 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 09.2022 | ZAR | 3.553 | $ | 230 | 14 | 0 | 14 | 0,01 |
| | 11.2022 | $ | 262 | COP | 1.113.540 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 1.823 | $ | 121 | 11 | 0 | 11 | 0,01 |
| SOG | 07.2022 | € | 4.188 | | 4.502 | 122 | 0 | 122 | 0,10 |
| | 08.2022 | $ | 139 | NOK | 1.361 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | BRL | 517 | $ | 100 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 99 | BRL | 517 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | | 101 | ZAR | 1.625 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 36 | MXN | 708 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 5.835 | $ | 357 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | | | | | | $ 332 | $ (199) | $ 133 | 0,11 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | CHF | 309 | $ | 310 | $ 0 | $ (13) | $ (13) | (0,01) |
| | 07.2022 | $ | 7.466 | CHF | 7.135 | 0 | (14) | (14) | (0,01) |
| BPS | 07.2022 | | 61 | | 59 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | | 7.461 | | 7.142 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | CHF | 6.847 | $ | 7.209 | 56 | 0 | 56 | 0,05 |
| | 07.2022 | $ | 7.120 | CHF | 6.830 | 14 | 0 | 14 | 0,01 |
| | 08.2022 | | 7.209 | | 6.836 | 0 | (56) | (56) | (0,05) |
| SCX | 07.2022 | CHF | 275 | $ | 277 | 0 | (10) | (10) | (0,01) |
| UAG | 07.2022 | $ | 217 | CHF | 207 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 70 | $ (94) | $ (24) | (0,02) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | € | 10 | $ | 10 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 17 | € | 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | € | 17.286 | $ | 18.179 | 107 | 0 | 107 | 0,09 |
| | 08.2022 | $ | 16.407 | € | 15.571 | 0 | (99) | (99) | (0,08) |
| CBK | 07.2022 | | 216 | | 201 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | € | 15.620 | $ | 16.433 | 102 | 0 | 102 | 0,08 |
| | 07.2022 | $ | 18.443 | € | 17.102 | 0 | (563) | (563) | (0,47) |
| | 08.2022 | | 16.411 | | 15.571 | 0 | (102) | (102) | (0,08) |
| MYI | 07.2022 | € | 2.545 | $ | 2.699 | 39 | 0 | 39 | 0,03 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SOG | 07.2022 | $ 18.366 | € 17.087 | $ 0 | $ (502) | $ (502) | (0,41) |
| UAG | 07.2022 | 15.644 | 14.558 | 0 | (424) | (424) | (0,35) |
| | | | | $ 248 | $ (1.696) | $ (1.448) | (1,19) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **$ (1.831)** | **(1,51)** |
| **Summe Anlagen** | | | | | | **$ 118.059** | **97,61** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | | | | | **$ 2.886** | **2,39** |
| **Nettovermögen** | | | | | | **$ 120.945** | **100,00** |

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

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

**^** **Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a)** **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

**(b)** **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

**(c)** **Nullkuponwertpapier.**

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

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

**(f)** **Mit dem Fonds verbunden.**

**(g)** **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(h)** **Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|
| Constellation Oil Services Holding S.A. | 10.06.2022 | $ 63 | $ 63 | 0,05 |
| Intelsat Emergence S.A. | 12.11.2019 | 750 | 209 | 0,17 |
| | | $ 813 | $ 272 | 0,22 |

**Barmittel in Höhe von USD 2.583 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 1.594 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 104.111 | $ 1.138 | $ 105.258 |
| Investmentfonds | 11.594 | 396 | 0 | 11.990 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 2.482 | 0 | 2.482 |
| Finanzderivate[3] | 17 | (1.688) | 0 | (1.671) |
| **Summen** | **$ 11.620** | **$ 105.301** | **$ 1.138** | **$ 118.059** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 5 | $ 122.049 | $ 1.418 | $ 123.472 |
| Investmentfonds | 13.600 | 0 | 0 | 13.600 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 1.827 | 0 | 1.827 |
| Finanzderivate[3] | 12 | (18) | 0 | (6) |
| **Summen** | **$ 13.617** | **$ 123.858** | **$ 1.418** | **$ 138.893** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (148) | $ 271 | $ 123 |
| BPS | (79) | 0 | (79) |
| BRC | 25 | 0 | 25 |
| CBK | 1 | 0 | 1 |
| DUB | 23 | 0 | 23 |
| FBF | 10 | 0 | 10 |
| GLM | (282) | 263 | (19) |
| GST | 8 | 0 | 8 |
| JPM | (39) | 0 | (39) |
| MBC | (603) | 460 | (143) |
| MYI | 38 | 0 | 38 |
| SAL | (1) | 0 | (1) |
| SCX | 18 | 0 | 18 |
| SOG | (381) | 280 | (101) |
| UAG | (421) | 320 | (101) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 26,31 | 27,56 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 57,98 | 57,54 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 2,74 | 3,29 |
| Investmentfonds | 9,91 | 9,73 |
| Pensionsgeschäfte | 2,05 | 1,31 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,21 | (0,02) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,08) | (0,30) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (1,51) | 0,31 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Argentinien | 0,18 | 0,21 |
| Australien | 0,79 | 0,82 |
| Österreich | k. A. | 0,08 |
| Bermuda | 0,46 | 0,91 |
| Brasilien | 0,37 | 0,94 |
| Kanada | 0,56 | 0,62 |
| Cayman-Inseln | 2,07 | 3,02 |
| China | 0,03 | 0,07 |
| Frankreich | 0,56 | 0,65 |
| Guernsey, Kanalinseln | k. A. | 0,51 |
| Hongkong | k. A. | 0,14 |
| Italien | 0,67 | 0,73 |
| Jersey, Kanalinseln | k. A. | 0,39 |
| Liberia | 0,25 | 0,46 |
| Luxemburg | 0,99 | 1,47 |
| Mexiko | 0,17 | 0,15 |
| Multinational | 1,30 | 0,61 |
| Niederlande | 1,05 | 1,66 |
| Norwegen | 0,08 | 0,08 |
| Panama | 0,07 | 0,87 |
| Peru | 0,61 | 0,86 |
| Katar | 0,33 | 0,32 |
| Singapur | k. A. | 0,08 |
| Südafrika | 1,43 | k. A. |
| Spanien | 0,27 | 0,29 |
| Großbritannien | 1,66 | 3,47 |
| USA | 55,07 | 48,78 |
| Jungferninseln (Britisch) | 0,21 | 0,37 |
| Kurzfristige Instrumente | 17,85 | 19,83 |
| Investmentfonds | 9,91 | 9,73 |
| Pensionsgeschäfte | 2,05 | 1,31 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,21 | (0,02) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf | 0,08 | 0,01 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,05) | 0,04 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | 0,12 | (0,03) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,15) | 0,02 |
| Zinsswaps | (0,08) | (0,34) |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | k. A. | 0,01 |
| Zinsswapoptionen | 0,40 | 0,13 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,01) | (0,02) |
| Zinsswapoptionen | (0,82) | (0,20) |
| Optionen auf Wertpapiere | 0,00 | 0,00 |
| 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 | 0,01 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | 0,02 | 0,04 |
| Devisenterminkontrakte | 0,11 | (0,14) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (1,21) | 0,50 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 2,39 | 0,58 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **ALBANIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Albania Government International Bond** | | | | |
| 3,500 % fällig am 16.06.2027 | € | 17.900 | $ 16.010 | 0,16 |
| **ARGENTINIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 1,125 % fällig am 09.07.2035 | $ | 28.828 | 6.097 | 0,06 |
| 2,500 % fällig am 09.07.2041 | | 177.599 | 46.176 | 0,46 |
| Summe Argentinien | | | 52.273 | 0,52 |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Pacific National Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 22.03.2028 | | 1.000 | 957 | 0,01 |
| **Santos Finance Ltd.** | | | | |
| 3,649 % fällig am 29.04.2031 | | 3.400 | 2.888 | 0,03 |
| **Woodside Finance Ltd.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 15.09.2026 | | 600 | 579 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 04.03.2029 | | 2.300 | 2.215 | 0,02 |
| Summe Australien | | | 6.639 | 0,07 |
| **WEISSRUSSLAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Belarus Government International Bond** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.02.2026 | | 6.700 | 1.039 | 0,01 |
| **BERMUDA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aircastle Ltd.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 26.01.2028 | | 10.500 | 8.689 | 0,09 |
| 4,250 % fällig am 15.06.2026 | | 1.700 | 1.575 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 11.08.2025 | | 35.000 | 33.830 | 0,34 |
| **Bacardi Ltd.** | | | | |
| 4,700 % fällig am 15.05.2028 | | 24.440 | 24.165 | 0,24 |
| Summe Bermuda | | | 68.259 | 0,68 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.08.2022 (f)(h) | | 13.194 | 56 | 0,00 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.10.2029 | £ | 15.498 | 16.668 | 0,17 |
| 6,250 % fällig am 14.12.2026 | | 7.200 | 8.499 | 0,08 |
| Summe Brasilien | | | 25.223 | 0,25 |
| **KANADA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Air Canada Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,300 % fällig am 15.07.2031 | $ | 821 | 748 | 0,01 |
| 4,125 % fällig am 15.11.2026 | | 1.189 | 1.111 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 01.10.2030 | | 3.895 | 3.899 | 0,04 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028 | € | 23.350 | 22.617 | 0,22 |
| 4,850 % fällig am 17.04.2028 | $ | 200 | 199 | 0,00 |
| Summe Kanada | | | 28.574 | 0,28 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Atlas Senior Loan Fund Ltd.** | | | | |
| 2,194 % fällig am 16.01.2030 | | 1.796 | 1.778 | 0,02 |
| **Catamaran CLO Ltd.** | | | | |
| 2,236 % fällig am 22.04.2030 | | 4.477 | 4.419 | 0,05 |
| **OZLM Ltd.** | | | | |
| 2,441 % fällig am 16.05.2030 | | 5.400 | 5.308 | 0,05 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | |
| 2,163 % fällig am 20.01.2029 | | 6.083 | 6.024 | 0,06 |
| 2,401 % fällig am 07.09.2030 | | 8.000 | 7.891 | 0,08 |
| **Vibrant CLO Ltd.** | | | | |
| 2,103 % fällig am 15.09.2030 | | 2.100 | 2.060 | 0,02 |
| | | | 27.480 | 0,28 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | |
| 2,528 % fällig am 18.11.2027 | $ | 13.810 | $ 11.269 | 0,11 |
| 2,875 % fällig am 15.02.2025 | | 10.000 | 9.210 | 0,09 |
| 3,250 % fällig am 15.02.2027 | | 5.200 | 4.532 | 0,04 |
| 4,250 % fällig am 15.04.2026 | | 3.900 | 3.617 | 0,04 |
| 5,250 % fällig am 15.05.2024 | | 1.200 | 1.180 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2026 | | 11.300 | 10.978 | 0,11 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 12.07.2026 | | 2.400 | 1.127 | 0,01 |
| 3,125 % fällig am 22.10.2025 | | 38.000 | 18.715 | 0,19 |
| 4,750 % fällig am 17.01.2023 | | 2.800 | 2.475 | 0,02 |
| 5,125 % fällig am 17.01.2025 | | 2.000 | 1.096 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 08.04.2024 | | 9.900 | 5.954 | 0,06 |
| 7,250 % fällig am 08.04.2026 | | 20.500 | 11.234 | 0,11 |
| **Kaisa Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 9,375 % fällig am 30.06.2024 ^ | | 9.850 | 1.375 | 0,01 |
| 9,750 % fällig am 28.09.2023 ^ | | 22.900 | 3.176 | 0,03 |
| 10,500 % fällig am 15.01.2025 ^ | | 21.600 | 2.970 | 0,03 |
| 10,875 % fällig am 23.07.2023 ^ | | 5.800 | 804 | 0,01 |
| 11,250 % fällig am 16.04.2025 ^ | | 17.000 | 2.338 | 0,02 |
| 11,500 % fällig am 30.01.2023 ^ | | 900 | 124 | 0,00 |
| 11,650 % fällig am 01.06.2026 ^ | | 9.300 | 1.279 | 0,01 |
| 11,700 % fällig am 11.11.2025 ^ | | 5.750 | 802 | 0,01 |
| 11,950 % fällig am 12.11.2023 ^ | | 4.400 | 614 | 0,01 |
| **KWG Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 10.11.2024 | | 400 | 80 | 0,00 |
| **Lima Metro Line Finance Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 05.07.2034 | | 3.019 | 2.983 | 0,03 |
| **Melco Resorts Finance Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 06.06.2025 | | 3.600 | 2.696 | 0,03 |
| 5,375 % fällig am 04.12.2029 | | 9.500 | 5.748 | 0,06 |
| 5,750 % fällig am 21.07.2028 | | 1.000 | 645 | 0,01 |
| **MGM China Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.02.2027 | | 400 | 283 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 18.06.2025 | | 200 | 154 | 0,00 |
| 5,875 % fällig am 15.05.2026 | | 200 | 151 | 0,00 |
| **New Metro Global Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 02.05.2026 | | 1.200 | 555 | 0,01 |
| **Noble Finance Co. (11,000 % bar oder 15,000 % PIK)** | | | | |
| 11,000 % fällig am 15.02.2028 (d) | | 507 | 556 | 0,01 |
| Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar und 1,000 % PIK) | | | | |
| 7,350 % fällig am 01.12.2026 ^(d) | | 27.718 | 17.102 | 0,17 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | | |
| 6,720 % fällig am 01.12.2022 ^ | | 13 | 12 | 0,00 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd. (6,720 % bar und 1,000 % PIK)** | | | | |
| 7,720 % fällig am 01.12.2026 ^(d) | | 514 | 128 | 0,00 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2023 | | 24.000 | 23.919 | 0,24 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2024 | | 504 | 500 | 0,00 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 3,100 % fällig am 08.03.2029 | | 500 | 355 | 0,00 |
| 3,800 % fällig am 08.01.2026 | | 18.500 | 14.852 | 0,15 |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028 | | 5.100 | 3.940 | 0,04 |
| **Seagate HDD Cayman** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.01.2031 | | 1.900 | 1.557 | 0,02 |
| **Seazen Group Ltd.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 13.07.2025 | | 12.500 | 7.341 | 0,07 |
| 6,000 % fällig am 12.08.2024 | | 2.300 | 1.380 | 0,01 |
| 6,150 % fällig am 15.04.2023 | | 300 | 224 | 0,00 |
| **Sitka Holdings LLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 06.07.2026 | | 7.800 | 7.550 | 0,07 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 26.04.2024 ^ | | 19.200 | 2.928 | 0,03 |
| 6,500 % fällig am 09.07.2023 ^ | | 4.800 | 732 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 26.01.2026 ^ | | 300 | 44 | 0,00 |
| 6,650 % fällig am 03.08.2024 ^ | | 5.900 | 871 | 0,01 |
| 7,000 % fällig am 09.07.2025 ^ | | 7.400 | 1.110 | 0,01 |
| 7,250 % fällig am 14.06.2022 ^ | | 30.400 | 4.621 | 0,05 |
| 7,500 % fällig am 01.02.2024 ^ | | 5.500 | 839 | 0,01 |
| 7,950 % fällig am 11.10.2023 ^ | | 11.800 | 1.799 | 0,02 |
| 8,350 % fällig am 19.04.2023 ^ | | 1.100 | 168 | 0,00 |
| **Trafford Centre Finance Ltd.** | | | | |
| 2,033 % fällig am 28.07.2038 | £ | 3.700 | 3.932 | 0,04 |
| 8,280 % fällig am 28.10.2022 | | 11 | 13 | 0,00 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.10.2024 | $ | 300 | $ 223 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2026 | | 10.200 | 7.080 | 0,07 |
| 5,500 % fällig am 01.10.2027 | | 6.200 | 4.022 | 0,04 |
| 5,625 % fällig am 26.08.2028 | | 4.500 | 2.785 | 0,03 |
| | | | 218.747 | 2,17 |
| Summe Cayman Inseln | | | 246.227 | 2,45 |
| **CHILE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A.** | | | | |
| 3,650 % fällig am 07.05.2030 | | 4.000 | 3.605 | 0,03 |
| **GNL Quintero S.A.** | | | | |
| 4,634 % fällig am 31.07.2029 | | 3.883 | 3.735 | 0,04 |
| Summe Chile | | | 7.340 | 0,07 |
| **CHINA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **New Metro Global Ltd.** | | | | |
| 4,800 % fällig am 15.12.2024 | | 1.000 | 550 | 0,01 |
| **Yango Justice International Ltd.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.04.2024 ^ | | 28.200 | 2.270 | 0,02 |
| 7,500 % fällig am 17.02.2025 ^ | | 19.100 | 1.671 | 0,01 |
| 7,875 % fällig am 04.09.2024 ^ | | 19.800 | 1.733 | 0,02 |
| Summe China | | | 6.224 | 0,06 |
| **KOLUMBIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ecopetrol S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 28.05.2045 | | 200 | 137 | 0,00 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Colombia Government International Bond** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.06.2045 | | 53.320 | 35.834 | 0,36 |
| 5,625 % fällig am 26.02.2044 | | 3.100 | 2.238 | 0,02 |
| 6,125 % fällig am 18.01.2041 | | 100 | 78 | 0,00 |
| 7,375 % fällig am 18.09.2037 | | 100 | 93 | 0,00 |
| 10,375 % fällig am 28.01.2033 | | 950 | 1.130 | 0,01 |
| | | | 39.373 | 0,39 |
| Summe Kolumbien | | | 39.510 | 0,39 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **TDC Net A/S** | | | | |
| 5,056 % fällig am 31.05.2028 | € | 12.800 | 12.538 | 0,12 |
| **DOMINIKANISCHE REPUBLIK** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Dominican Republic Government International Bond** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.02.2048 | $ | 43.400 | 32.984 | 0,33 |
| 6,850 % fällig am 27.01.2045 | | 17.100 | 13.571 | 0,13 |
| Summe Dominikanische Republik | | | 46.555 | 0,46 |
| **ECUADOR** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ecuador Government International Bond** | | | | |
| 0,000 % fällig am 31.07.2030 (f) | | 21.089 | 9.079 | 0,09 |
| 0,500 % fällig am 31.07.2040 | | 13.650 | 5.875 | 0,06 |
| Summe Ecuador | | | 14.954 | 0,15 |
| **ÄGYPTEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Egypt Government International Bond** | | | | |
| 5,625 % fällig am 16.04.2030 | € | 2.650 | 1.727 | 0,02 |
| 6,375 % fällig am 11.04.2031 | | 21.400 | 14.141 | 0,14 |
| 7,500 % fällig am 16.02.2061 | $ | 45.100 | 25.228 | 0,25 |
| 8,500 % fällig am 31.01.2047 | | 9.700 | 5.775 | 0,06 |
| Summe Ägypten | | | 46.871 | 0,47 |
| **FINNLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Balder Finland Oyj** | | | | |
| 1,375 % fällig am 24.05.2030 | € | 3.700 | 2.278 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **FRANKREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Accor S.A.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 29.11.2028 | € | 1.100 | $ 916 | 0,01 |
| **Altareit S.C.A.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 02.07.2025 | | 100 | 96 | 0,00 |
| **Altice France S.A.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.01.2028 | | 3.200 | 2.514 | 0,03 |
| 4,000 % fällig am 15.07.2029 (l) | | 12.200 | 9.370 | 0,09 |
| 4,250 % fällig am 15.10.2029 | | 21.100 | 16.527 | 0,17 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 1,904 % fällig am 30.09.2028 | $ | 41.200 | 35.243 | 0,35 |
| 2,219 % fällig am 09.06.2026 | | 5.300 | 4.900 | 0,05 |
| 2,819 % fällig am 19.11.2025 | | 1.000 | 956 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 16.11.2027 | | 1.400 | 1.308 | 0,01 |
| 4,400 % fällig am 14.08.2028 | | 2.200 | 2.107 | 0,02 |
| 4,705 % fällig am 10.01.2025 | | 47.400 | 47.413 | 0,47 |
| 5,198 % fällig am 10.01.2030 | | 4.200 | 4.200 | 0,04 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 14.01.2025 | | 5.300 | 5.038 | 0,05 |
| **CGG S.A.** | | | | |
| 8,750 % fällig am 01.04.2027 | | 43.300 | 36.897 | 0,37 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 1,907 % fällig am 16.06.2026 | | 14.250 | 13.125 | 0,13 |
| **Electricite de France S.A.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 21.09.2028 | | 6.000 | 5.835 | 0,06 |
| **Holding d'Infrastructures de Transport SASU** | | | | |
| 1,475 % fällig am 18.01.2031 | € | 6.000 | 5.103 | 0,05 |
| **La Mondiale SAM** | | | | |
| 5,050 % fällig am 17.12.2025 (h) | | 13.665 | 14.241 | 0,14 |
| **Loxam S.A.S.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.04.2026 | | 1.600 | 1.422 | 0,01 |
| 3,750 % fällig am 15.07.2026 | | 2.000 | 1.800 | 0,02 |
| 4,500 % fällig am 15.02.2027 | | 5.800 | 5.229 | 0,05 |
| **New Immo Holding S.A.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 26.11.2026 | | 200 | 183 | 0,00 |
| **Renault S.A.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 24.06.2025 | | 14.300 | 13.010 | 0,13 |
| 2,375 % fällig am 25.05.2026 | | 63.500 | 57.076 | 0,57 |
| 2,500 % fällig am 02.06.2027 | | 1.500 | 1.265 | 0,01 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 12.01.2027 | $ | 700 | 667 | 0,01 |
| 7,375 % fällig am 04.10.2023 (h)(j) | | 400 | 386 | 0,00 |
| 7,875 % fällig am 18.12.2023 (h)(j) | | 2.600 | 2.554 | 0,03 |
| **TDF Infrastructure SASU** | | | | |
| 1,750 % fällig am 01.12.2029 | € | 55.600 | 48.123 | 0,48 |
| **Verallia S.A.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 10.11.2031 | | 20.900 | 16.351 | 0,16 |
| | | | 353.855 | 3,52 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Altice France S.A.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 02.02.2026 | | 14.191 | 13.457 | 0,13 |
| 5,411 % fällig am 14.08.2026 | $ | 4.061 | 3.716 | 0,04 |
| **Casino Guichard Perrachon S.A.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 31.08.2025 | € | 37.500 | 35.333 | 0,35 |
| | | | 52.506 | 0,52 |
| Summe Frankreich | | | 406.361 | 4,04 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ADLER Real Estate AG** | | | | |
| 1,875 % fällig am 27.04.2023 | € | 3.800 | 3.128 | 0,03 |
| 2,125 % fällig am 06.02.2024 | | 1.800 | 1.377 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 27.04.2026 | | 2.700 | 1.883 | 0,02 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,750 % fällig am 17.02.2027 | | 4.400 | 4.072 | 0,04 |
| 1,375 % fällig am 03.09.2026 | | 15.400 | 14.978 | 0,15 |
| 1,375 % fällig am 17.02.2032 | | 19.400 | 15.505 | 0,15 |
| 1,625 % fällig am 20.01.2027 | | 46.900 | 43.968 | 0,44 |
| 1,750 % fällig am 17.01.2028 | | 11.400 | 10.404 | 0,10 |
| 1,750 % fällig am 19.11.2030 | | 20.200 | 17.441 | 0,17 |
| 2,552 % fällig am 07.01.2028 | $ | 15.600 | 13.516 | 0,14 |
| 2,625 % fällig am 12.02.2026 | € | 5.000 | 5.031 | 0,05 |
| 3,035 % fällig am 28.05.2032 (k) | $ | 1.100 | 872 | 0,01 |
| 3,547 % fällig am 18.09.2031 | | 24.450 | 20.492 | 0,20 |
| 3,950 % fällig am 27.02.2023 | $ | 1.100 | $ 1.098 | 0,01 |
| 3,961 % fällig am 26.11.2025 | | 21.500 | 20.796 | 0,21 |
| 4,500 % fällig am 01.04.2025 | | 13.100 | 12.488 | 0,12 |
| 5,625 % fällig am 19.05.2031 | € | 11.300 | 11.816 | 0,12 |
| 5,882 % fällig am 08.07.2031 | $ | 39.900 | 36.285 | 0,36 |
| **Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide** | | | | |
| 1,625 % fällig am 09.07.2024 | € | 18.400 | 18.638 | 0,19 |
| 1,875 % fällig am 31.03.2028 | | 20.600 | 18.903 | 0,19 |
| 2,125 % fällig am 09.07.2027 | | 1.700 | 1.623 | 0,02 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK)** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2025 (d) | | 6.900 | 6.308 | 0,06 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.09.2026 (d) | | 31.550 | 27.437 | 0,27 |
| **INEOS Styrolution Group GmbH** | | | | |
| 2,250 % fällig am 16.01.2027 (l) | | 20.200 | 16.395 | 0,16 |
| **Schaeffler AG** | | | | |
| 2,750 % fällig am 12.10.2025 | | 4.900 | 4.714 | 0,05 |
| 3,375 % fällig am 12.10.2028 | | 5.500 | 4.677 | 0,05 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 2,500 % fällig am 31.07.2026 | | 16.900 | 17.138 | 0,17 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | | |
| 0,875 % fällig am 31.01.2028 | | 8.900 | 8.028 | 0,08 |
| **ZF Finance GmbH** | | | | |
| 2,750 % fällig am 25.05.2027 | | 17.300 | 14.324 | 0,14 |
| 3,750 % fällig am 21.09.2028 | | 53.900 | 44.434 | 0,44 |
| Summe Deutschland | | | 417.769 | 4,15 |
| **GHANA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ghana Government International Bond** | | | | |
| 7,875 % fällig am 26.03.2027 (l) | $ | 5.100 | 2.977 | 0,03 |
| 8,125 % fällig am 26.03.2032 | | 4.400 | 2.142 | 0,02 |
| 8,750 % fällig am 11.03.2061 | | 5.100 | 2.421 | 0,02 |
| 8,950 % fällig am 26.03.2051 | | 5.600 | 2.666 | 0,03 |
| Summe Ghana | | | 10.206 | 0,10 |
| **GUERNSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Doric Nimrod Air Alpha Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,250 % fällig am 30.05.2025 | | 289 | 285 | 0,00 |
| **Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.11.2024 | | 1.843 | 1.827 | 0,02 |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 29.07.2026 | € | 7.800 | 6.563 | 0,07 |
| 3,000 % fällig am 29.03.2025 | | 46.439 | 42.813 | 0,42 |
| Summe Guernsey, Kanalinseln | | | 51.488 | 0,51 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Fortune Star BVI Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 02.10.2026 | | 67.700 | 42.202 | 0,42 |
| **Huarong Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 30.09.2023 | $ | 56.700 | 54.035 | 0,53 |
| 2,631 % fällig am 24.02.2023 | | 11.100 | 10.850 | 0,11 |
| **Yanlord Land HK Co. Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 20.05.2026 | | 14.700 | 11.195 | 0,11 |
| Summe Hongkong | | | 118.282 | 1,17 |
| **INDIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Adani Electricity Mumbai Ltd.** | | | | |
| 3,949 % fällig am 12.02.2030 | | 3.800 | 3.107 | 0,03 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **LLPL Capital Pte. Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 04.02.2039 | | 174 | 163 | 0,00 |
| **Pertamina Persero PT** | | | | |
| 6,500 % fällig am 07.11.2048 | | 35.700 | 36.323 | 0,36 |
| **Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara** | | | | |
| 3,000 % fällig am 30.06.2030 | | 18.800 | 15.445 | 0,16 |
| Summe Indonesien | | | 51.931 | 0,52 |
| **IRLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Accunia European CLO DAC** | | | | |
| 0,930 % fällig am 15.10.2030 | € | 1.134 | $ 1.174 | 0,01 |
| **Adagio CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.10.2031 | | 5.800 | 5.945 | 0,06 |
| **Ares European CLO** | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.10.2030 | | 299 | 307 | 0,00 |
| **Ares European CLO DAC** | | | | |
| 0,610 % fällig am 15.04.2030 | | 1.683 | 1.724 | 0,02 |
| 0,660 % fällig am 15.10.2030 | | 1.697 | 1.742 | 0,02 |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | | 14.900 | 15.232 | 0,15 |
| 0,850 % fällig am 20.04.2032 | | 500 | 509 | 0,01 |
| **Armada Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.07.2031 | | 11.100 | 11.306 | 0,11 |
| **Aurium CLO DAC** | | | | |
| 0,730 % fällig am 16.01.2031 | | 4.800 | 4.930 | 0,05 |
| 1,050 % fällig am 23.03.2032 | | 10.400 | 10.665 | 0,11 |
| **Avoca CLO DAC** | | | | |
| 0,820 % fällig am 15.10.2032 | | 2.900 | 2.957 | 0,03 |
| **Bain Capital Euro DAC** | | | | |
| 0,740 % fällig am 20.01.2032 | | 5.500 | 5.580 | 0,06 |
| **Black Diamond CLO DAC** | | | | |
| 0,860 % fällig am 20.01.2032 | | 2.496 | 2.576 | 0,03 |
| 0,980 % fällig am 15.05.2032 | | 4.400 | 4.495 | 0,04 |
| **Blackrock European CLO DAC** | | | | |
| 0,620 % fällig am 15.10.2031 | | 10.900 | 11.020 | 0,11 |
| **BlueMountain Fuji EUR CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.01.2031 | | 7.800 | 7.945 | 0,08 |
| 1,050 % fällig am 15.01.2031 | | 1.000 | 1.010 | 0,01 |
| **BNPP AM Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,600 % fällig am 15.04.2031 | | 1.000 | 1.016 | 0,01 |
| **Bridgepoint CLO DAC** | | | | |
| 1,210 % fällig am 15.01.2034 | | 1.300 | 1.336 | 0,01 |
| **Cairn CLO DAC** | | | | |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | | 8.600 | 8.762 | 0,09 |
| **Carlyle Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 15.08.2030 | | 4.838 | 4.960 | 0,05 |
| 0,700 % fällig am 15.01.2031 | | 11.600 | 11.849 | 0,12 |
| 0,890 % fällig am 15.08.2032 | | 4.400 | 4.463 | 0,04 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.11.2031 | | 7.450 | 7.651 | 0,08 |
| **CVC Cordatus Loan Fund DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 15.10.2031 | | 18.200 | 18.571 | 0,18 |
| 0,720 % fällig am 27.01.2031 | | 1.399 | 1.436 | 0,01 |
| 0,760 % fällig am 15.04.2032 | | 1.400 | 1.434 | 0,01 |
| 0,780 % fällig am 15.08.2032 | | 2.400 | 2.457 | 0,02 |
| **Dryden Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.04.2033 | | 12.800 | 12.983 | 0,13 |
| 0,860 % fällig am 15.05.2034 | | 14.700 | 14.869 | 0,15 |
| **Euro-Galaxy CLO DAC** | | | | |
| 0,620 % fällig am 24.04.2034 | | 9.600 | 9.783 | 0,10 |
| 0,710 % fällig am 11.04.2031 | | 1.300 | 1.323 | 0,01 |
| **GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC** | | | | |
| 0,900 % fällig am 20.01.2032 | | 1.700 | 1.727 | 0,02 |
| **Griffith Park CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 21.11.2031 | | 41.400 | 42.374 | 0,42 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 26.06.2030 | | 2.673 | 2.746 | 0,03 |
| 0,680 % fällig am 20.10.2031 | | 18.800 | 19.182 | 0,19 |
| 0,760 % fällig am 15.07.2031 | | 10.400 | 10.470 | 0,10 |
| 0,850 % fällig am 15.01.2032 | | 27.600 | 28.086 | 0,28 |
| 1,040 % fällig am 15.07.2031 | | 1.600 | 1.586 | 0,02 |
| **Invesco Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 15.07.2031 | | 850 | 863 | 0,01 |
| **Jubilee CLO DAC** | | | | |
| 0,600 % fällig am 15.04.2030 | | 4.200 | 4.330 | 0,04 |
| 0,610 % fällig am 15.04.2030 | | 1.900 | 1.962 | 0,02 |
| 0,650 % fällig am 15.04.2031 | | 5.850 | 5.960 | 0,06 |
| **Laurelin DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 20.10.2031 | | 10.900 | 11.167 | 0,11 |
| **Madison Park Euro Funding DAC** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.01.2032 | | 45.500 | 46.060 | 0,46 |
| 0,800 % fällig am 15.07.2032 | | 5.600 | 5.675 | 0,06 |
| **Man GLG Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,690 % fällig am 15.12.2031 | | 10.700 | 10.947 | 0,11 |
| 0,810 % fällig am 15.10.2032 | | 5.200 | 5.332 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Oak Hill European Credit Partners DAC** | | | | |
| 0,730 % fällig am 20.01.2032 | € | 2.198 | $ 2.259 | 0,02 |
| 0,740 % fällig am 20.10.2031 | | 20.200 | 20.558 | 0,20 |
| **OCP Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,820 % fällig am 15.01.2032 | | 3.000 | 3.094 | 0,03 |
| 0,880 % fällig am 22.09.2034 | | 12.700 | 12.853 | 0,13 |
| **OZLME DAC** | | | | |
| 0,820 % fällig am 27.07.2032 | | 2.000 | 2.036 | 0,02 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** | | | | |
| 0,780 % fällig am 15.04.2031 | | 6.645 | 6.862 | 0,07 |
| 1,050 % fällig am 15.10.2031 | | 5.050 | 5.199 | 0,05 |
| **Palmerston Park CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 18.04.2030 | | 1.281 | 1.319 | 0,01 |
| **Sculptor European CLO DAC** | | | | |
| 0,790 % fällig am 14.01.2032 | | 6.700 | 6.763 | 0,07 |
| **Segovia European CLO DAC** | | | | |
| 0,880 % fällig am 20.07.2032 | | 10.100 | 10.263 | 0,10 |
| **Tikehau CLO BV** | | | | |
| 0,870 % fällig am 04.08.2034 | | 9.400 | 9.580 | 0,09 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | |
| 0,810 % fällig am 15.02.2034 | | 7.650 | 7.730 | 0,08 |
| 0,920 % fällig am 15.07.2030 | | 485 | 501 | 0,00 |
| 0,920 % fällig am 12.01.2032 | | 2.500 | 2.539 | 0,03 |
| | | | 482.033 | 4,79 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC** | | | | |
| 2,700 % fällig am 11.06.2023 | | 26.550 | 1.943 | 0,02 |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 3,150 % fällig am 15.02.2024 | $ | 13.900 | 13.461 | 0,13 |
| 3,500 % fällig am 15.01.2025 | | 200 | 191 | 0,00 |
| 3,650 % fällig am 21.07.2027 | | 400 | 363 | 0,00 |
| 4,450 % fällig am 01.10.2025 | | 400 | 387 | 0,01 |
| 4,450 % fällig am 03.04.2026 | | 5.550 | 5.307 | 0,05 |
| 4,625 % fällig am 15.10.2027 | | 37.250 | 35.102 | 0,35 |
| **James Hardie International Finance DAC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.10.2026 | € | 4.500 | 4.363 | 0,04 |
| **SMBC Aviation Capital Finance DAC** | | | | |
| 2,300 % fällig am 15.06.2028 | $ | 900 | 732 | 0,01 |
| | | | 61.849 | 0,61 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Setanta Aircraft Leasing DAC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 05.11.2028 | | 51.000 | 48.667 | 0,48 |
| Summe Irland | | | 592.549 | 5,88 |
| **ISRAEL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Energean Israel Finance Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 30.03.2024 | | 10.600 | 10.004 | 0,10 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aeroporti di Roma SpA** | | | | |
| 1,750 % fällig am 30.07.2031 | € | 3.700 | 2.966 | 0,03 |
| **Atlantia SpA** | | | | |
| 1,625 % fällig am 03.02.2025 | | 7.600 | 7.265 | 0,07 |
| 1,875 % fällig am 13.07.2027 | | 3.200 | 2.729 | 0,03 |
| 1,875 % fällig am 12.02.2028 | | 86.400 | 70.547 | 0,70 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 2,625 % fällig am 28.04.2025 | | 36.635 | 34.025 | 0,34 |
| 3,625 % fällig am 24.09.2024 | | 17.756 | 17.177 | 0,17 |
| 4,000 % fällig am 10.07.2022 (l) | | 24.300 | 25.339 | 0,25 |
| 8,000 % fällig am 22.01.2030 | | 36.412 | 24.382 | 0,24 |
| 8,500 % fällig am 10.09.2030 | | 33.980 | 23.521 | 0,23 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 3,250 % fällig am 23.09.2024 | $ | 8.400 | 8.139 | 0,08 |
| 4,000 % fällig am 23.09.2029 | | 10.876 | 9.703 | 0,10 |
| 5,017 % fällig am 26.06.2024 | | 16.437 | 15.699 | 0,16 |
| 5,148 % fällig am 10.06.2030 | £ | 6.400 | 6.743 | 0,07 |
| 5,500 % fällig am 01.03.2028 (h)(j) | € | 33.129 | 27.838 | 0,28 |
| 5,875 % fällig am 01.09.2031 (h)(j) | | 11.000 | 8.988 | 0,09 |
| 7,750 % fällig am 11.01.2027 (h)(j) | | 800 | 796 | 0,01 |
| **Nexi SpA** | | | | |
| 2,125 % fällig am 30.04.2029 | | 43.300 | 31.744 | 0,31 |
| **Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA** | | | | |
| 3,500 % fällig am 09.10.2025 | € | 100 | $ 105 | 0,00 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 1,200 % fällig am 20.01.2026 | | 9.500 | 9.248 | 0,09 |
| 1,982 % fällig am 03.06.2027 | $ | 11.200 | 9.690 | 0,10 |
| 2,200 % fällig am 22.07.2027 | € | 23.600 | 22.547 | 0,22 |
| 2,569 % fällig am 22.09.2026 | $ | 17.050 | 15.270 | 0,15 |
| 5,459 % fällig am 30.06.2035 | | 400 | 324 | 0,00 |
| 7,296 % fällig am 02.04.2034 | | 17.101 | 15.731 | 0,16 |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | | 86.050 | 89.140 | 0,88 |
| Summe Italien | | | 479.656 | 4,76 |
| **ELFENBEINKÜSTE** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ivory Coast Government International Bond** | | | | |
| 5,875 % fällig am 17.10.2031 | € | 3.450 | 2.835 | 0,03 |
| 6,625 % fällig am 22.03.2048 | | 11.100 | 7.815 | 0,08 |
| 6,875 % fällig am 17.10.2040 | | 3.500 | 2.614 | 0,02 |
| Summe Elfenbeinküste | | | 13.264 | 0,13 |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Nissan Motor Co. Ltd.** | | | | |
| 2,652 % fällig am 17.03.2026 | | 3.500 | 3.422 | 0,04 |
| 3,201 % fällig am 17.09.2028 | | 9.000 | 8.384 | 0,08 |
| 4,345 % fällig am 17.09.2027 | $ | 83.700 | 76.898 | 0,76 |
| 4,810 % fällig am 17.09.2030 | | 5.300 | 4.714 | 0,05 |
| Summe Japan | | | 93.418 | 0,93 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.07.2043 | £ | 14.223 | 16.933 | 0,17 |
| 4,875 % fällig am 31.07.2043 | | 7.443 | 8.995 | 0,09 |
| 5,500 % fällig am 31.07.2050 | | 24.990 | 29.670 | 0,30 |
| 7,375 % fällig am 31.07.2050 (c) | | 7.800 | 9.472 | 0,09 |
| **Adient Global Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.08.2024 | € | 5.300 | 5.025 | 0,05 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 11.09.2025 | | 20.720 | 19.854 | 0,20 |
| 3,625 % fällig am 17.10.2022 | | 2.970 | 3.088 | 0,03 |
| **Corsair International Ltd.** | | | | |
| 4,850 % fällig am 28.01.2027 | | 18.800 | 18.554 | 0,18 |
| 5,200 % fällig am 28.01.2029 | | 8.200 | 8.007 | 0,08 |
| **Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.11.2025 | | 900 | 874 | 0,01 |
| Summe Jersey, Kanalinseln | | | 120.472 | 1,20 |
| **LIBERIA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Royal Caribbean Cruises Ltd.** | | | | |
| 9,125 % fällig am 15.06.2023 | $ | 1.800 | 1.784 | 0,02 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **Intelsat Emergence S.A. (e)(k)** | | 184.122 | 5.155 | 0,05 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **WANDELANLEIHEN & WECHSEL** | | | | |
| **Corestate Capital Holding S.A.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 28.11.2022 | € | 14.700 | 3.998 | 0,04 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ADLER Group S.A.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 14.01.2026 | | 14.300 | 7.774 | 0,08 |
| 2,250 % fällig am 27.04.2027 | | 6.300 | 3.201 | 0,03 |
| 2,750 % fällig am 13.11.2026 | | 13.300 | 7.108 | 0,07 |
| **Albion Financing SARL** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.10.2026 | | 16.700 | 14.634 | 0,14 |
| 6,125 % fällig am 15.10.2026 | $ | 5.800 | 4.974 | 0,05 |
| **Altice Financing S.A.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.01.2028 | € | 8.400 | 6.581 | 0,06 |
| 4,250 % fällig am 15.08.2029 | | 21.300 | 16.868 | 0,17 |
| 5,750 % fällig am 15.08.2029 | $ | 69.100 | 55.649 | 0,55 |
| **Altice France Holding S.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.02.2028 | $ | 24.900 | $ 17.720 | 0,18 |
| 8,000 % fällig am 15.05.2027 | € | 8.100 | 6.986 | 0,07 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | $ | 19.100 | 17.703 | 0,18 |
| **Constellation Oil Services Holding S.A. (3.000% Cash or 4.000% PIK)** | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.12.2026 (d) | | 743 | 549 | 0,01 |
| **Corestate Capital Holding S.A.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.04.2023 (l) | € | 33.100 | 7.798 | 0,08 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 27.01.2031 | | 9.300 | 6.465 | 0,06 |
| 1,625 % fällig am 23.04.2027 | | 8.900 | 7.444 | 0,07 |
| 1,750 % fällig am 14.01.2030 | | 10.700 | 7.929 | 0,08 |
| 2,750 % fällig am 12.05.2026 | | 21.650 | 20.168 | 0,20 |
| 2,750 % fällig am 22.01.2028 | £ | 4.300 | 4.038 | 0,04 |
| **FEL Energy SARL** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.12.2040 | $ | 50.014 | 36.390 | 0,36 |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 2,949 % fällig am 24.01.2024 | € | 300 | 102 | 0,00 |
| 4,250 % fällig am 06.04.2024 | £ | 16.400 | 6.722 | 0,07 |
| 5,150 % fällig am 11.02.2026 | $ | 10.600 | 3.445 | 0,03 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.03.2030 | | 13.710 | 11.345 | 0,11 |
| **Lincoln Financing SARL** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.04.2024 | € | 71.075 | 72.121 | 0,72 |
| 3,875 % fällig am 01.04.2024 | | 1.575 | 1.607 | 0,02 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 3,250 % fällig am 13.11.2028 | | 16.000 | 15.116 | 0,15 |
| **NE Property BV** | | | | |
| 3,375 % fällig am 14.07.2027 | | 27.050 | 24.387 | 0,24 |
| **Petrorio Luxembourg Trading SARL** | | | | |
| 6,125 % fällig am 09.06.2026 | $ | 3.900 | 3.594 | 0,04 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 29.10.2022 ^ | | 3.900 | 273 | 0,00 |
| **SELP Finance SARL** | | | | |
| 1,500 % fällig am 20.12.2026 | € | 600 | 564 | 0,01 |
| **Summer BC Holdco SARL** | | | | |
| 5,750 % fällig am 31.10.2026 | | 18.900 | 17.295 | 0,17 |
| | | | 406.550 | 4,04 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Albion Financing SARL** | | | | |
| 5,250 % fällig am 17.08.2026 | | 6.946 | 6.866 | 0,07 |
| **Altice Financing S.A.** | | | | |
| 3,794 % fällig am 15.07.2025 | $ | 0 | 0 | 0,00 |
| 3,794 % fällig am 31.01.2026 | | 9.397 | 8.583 | 0,08 |
| **Connect Finco SARL** | | | | |
| 5,170 % fällig am 11.12.2026 | | 3.188 | 2.950 | 0,03 |
| **Delos Finance SARL** | | | | |
| 4,000 % fällig am 06.10.2023 | | 420 | 416 | 0,00 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | |
| 4,920 % fällig am 01.02.2029 | | 3.867 | 3.548 | 0,04 |
| | | | 22.363 | 0,22 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **RECHTE** | | | | |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp 05/12/2025** | | 38.562 | 188 | 0,00 |
| Summe Luxemburg | | | 438.254 | 4,35 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **MAZEDONIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **North Macedonia Government International Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 18.01.2025 | € | 1.600 | 1.517 | 0,02 |
| 3,675 % fällig am 03.06.2026 | | 5.500 | 5.133 | 0,05 |
| Summe Mazedonien | | | 6.650 | 0,07 |
| **MAURITIUS** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Greenko Solar Mauritius Ltd.** | | | | |
| 5,550 % fällig am 29.01.2025 | $ | 8.200 | 7.708 | 0,08 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **MEXIKO** | | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **Hipotecaria Su Casita S.A.** | | | | |
| (e) | | 28.925 | $ 0 | 0,00 |
| **Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V. (e)** | | 477 | 0 | 0,00 |
| Total Common Stocks | | | $ 0 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 2,750 % fällig am 21.04.2027 | € | 15.750 | 12.390 | 0,12 |
| 4,750 % fällig am 26.02.2029 | | 23.450 | 18.353 | 0,18 |
| 4,875 % fällig am 21.02.2028 | | 16.200 | 13.452 | 0,13 |
| 5,625 % fällig am 23.01.2046 | $ | 11.342 | 6.456 | 0,06 |
| 6,350 % fällig am 12.02.2048 | | 3.900 | 2.303 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 02.06.2041 | | 5.700 | 3.567 | 0,04 |
| 6,625 % fällig am 15.06.2035 | | 78.600 | 53.847 | 0,54 |
| 6,625 % fällig am 15.06.2038 | | 4.000 | 2.643 | 0,03 |
| 6,700 % fällig am 16.02.2032 | | 81.387 | 62.229 | 0,62 |
| 6,750 % fällig am 21.09.2047 | | 21.200 | 13.164 | 0,13 |
| | | | 188.404 | 1,87 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 6,050 % fällig am 11.01.2040 | | 146 | 144 | 0,00 |
| Summe Mexiko | | | 188.548 | 1,87 |
| **MULTINATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Allied Universal Holdco LLC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.06.2028 | € | 19.600 | 15.578 | 0,15 |
| **Connect Finco SARL** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.10.2026 | $ | 14.400 | 12.989 | 0,13 |
| **Delta Air Lines, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 20.10.2025 | | 4.100 | 3.988 | 0,04 |
| **NXP BV** | | | | |
| 3,150 % fällig am 01.05.2027 | | 800 | 742 | 0,01 |
| Summe multinational | | | 33.297 | 0,33 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Athora Netherlands NV** | | | | |
| 7,000 % fällig am 19.06.2025 (h)(j) | € | 4.500 | 4.453 | 0,04 |
| **Atrium Finance Issuer BV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.09.2027 | | 20.700 | 17.518 | 0,17 |
| **Citycon Treasury BV** | | | | |
| 1,625 % fällig am 12.03.2028 | | 3.600 | 2.774 | 0,03 |
| **Imperial Brands Finance Netherlands BV** | | | | |
| 1,750 % fällig am 18.03.2033 | | 30.800 | 23.404 | 0,23 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 5,750 % fällig am 16.11.2026 (h)(j) | $ | 9.600 | 8.792 | 0,09 |
| 6,500 % fällig am 16.04.2025 (h)(j) | | 19.902 | 18.792 | 0,19 |
| 6,750 % fällig am 16.04.2024 (h)(j) | | 15.280 | 14.802 | 0,15 |
| **Kazakhstan Temir Zholy Finance BV** | | | | |
| 6,950 % fällig am 10.07.2042 | | 300 | 273 | 0,00 |
| **NN Group NV** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2026 (h) | € | 20.700 | 20.918 | 0,21 |
| **Prosus NV** | | | | |
| 3,257 % fällig am 19.01.2027 | $ | 5.600 | 4.871 | 0,05 |
| 3,680 % fällig am 21.01.2030 | | 20.200 | 16.111 | 0,16 |
| **Q-Park Holding BV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.03.2027 | € | 1.500 | 1.254 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 01.02.2025 | | 34.850 | 33.066 | 0,33 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 3,375 % fällig am 16.04.2026 | | 24.200 | 25.000 | 0,25 |
| 4,441 % fällig am 24.04.2023 | $ | 8.550 | 8.622 | 0,09 |
| 4,892 % fällig am 24.04.2025 | | 43.100 | 43.250 | 0,43 |
| 5,182 % fällig am 24.04.2028 | | 11.354 | 11.505 | 0,11 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2025 | € | 11.700 | 11.467 | 0,11 |
| **United Group BV** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.02.2028 | | 1.600 | 1.248 | 0,01 |
| 4,875 % fällig am 01.07.2024 | | 230 | 219 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Volkswagen International Finance NV** | | | | |
| 3,500 % fällig am 17.06.2025 (h) | € | 10.800 | $ 10.256 | 0,10 |
| 3,875 % fällig am 17.06.2029 (h) | | 20.500 | 17.840 | 0,18 |
| **ZF Europe Finance BV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 23.02.2026 | | 15.700 | 13.623 | 0,14 |
| | | | 317.352 | 3,15 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Sigma Bidco BV** | | | | |
| 3,500 % fällig am 02.07.2025 | | 44.400 | 35.220 | 0,35 |
| **T-Mobile Netherlands** | | | | |
| 4,000 % fällig am 30.03.2029 | | 69.400 | 67.143 | 0,67 |
| **Ziggo BV** | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.01.2029 | | 20.560 | 19.237 | 0,19 |
| | | | 121.600 | 1,21 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **EMF-NL Prime BV** | | | | |
| 0,352 % fällig am 17.04.2041 | | 31 | 31 | 0,00 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 1,052 % fällig am 17.10.2040 | | 215 | 225 | 0,00 |
| | | | 256 | 0,00 |
| Summe Niederlande | | | 439.208 | 4,36 |
| **NIGERIA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Nigeria Government International Bond** | | | | |
| 7,143 % fällig am 23.02.2030 | $ | 10.700 | 7.592 | 0,07 |
| 7,625 % fällig am 28.11.2047 | | 18.100 | 10.882 | 0,11 |
| 7,875 % fällig am 16.02.2032 | | 24.200 | 16.922 | 0,17 |
| Summe Nigeria | | | 35.396 | 0,35 |
| **OMAN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Oman Government International Bond** | | | | |
| 6,750 % fällig am 17.01.2048 | | 50.000 | 43.277 | 0,43 |
| **PANAMA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Panama Government International Bond** | | | | |
| 6,700 % fällig am 26.01.2036 | | 22.000 | 23.845 | 0,24 |
| **PORTUGAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Espirito Santo S.A.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.01.2018 ^ | € | 200 | 37 | 0,00 |
| **Galp Energia SGPS S.A.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 | | 13.200 | 13.111 | 0,13 |
| Summe Portugal | | | 13.148 | 0,13 |
| **KATAR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Nakilat, Inc.** | | | | |
| 6,067 % fällig am 31.12.2033 | $ | 11.323 | 12.097 | 0,12 |
| **RUMÄNIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Romania Government International Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 14.04.2033 | € | 1.500 | 1.021 | 0,01 |
| 2,875 % fällig am 13.04.2042 | | 8.600 | 5.278 | 0,05 |
| Summe Rumänien | | | 6.299 | 0,06 |
| **RUSSLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ALROSA Finance S.A.** | | | | |
| 3,100 % fällig am 25.06.2027 ^ | $ | 22.400 | 2.240 | 0,02 |
| 4,650 % fällig am 09.04.2024 ^ | | 3.200 | 320 | 0,00 |
| **MMK International Capital DAC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 13.06.2024 | | 8.600 | 3.096 | 0,03 |
| | | | 5.656 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Russia Government International Bond** | | | | |
| 2,875 % fällig am 04.12.2025 | € | 29.200 | $ 8.090 | 0,08 |
| 4,750 % fällig am 27.05.2026 | $ | 10.200 | 2.759 | 0,03 |
| | | | 10.849 | 0,11 |
| Summe Russland | | | 16.505 | 0,16 |
| **SERBIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Serbia Government International Bond** | | | | |
| 1,650 % fällig am 03.03.2033 | € | 9.500 | 6.253 | 0,06 |
| 3,125 % fällig am 15.05.2027 | | 1.400 | 1.284 | 0,01 |
| Summe Serbien | | | 7.537 | 0,07 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Flex Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.02.2026 | $ | 15.000 | 14.371 | 0,14 |
| **SLOWENIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Nova Kreditna Banka Maribor d.d.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 27.01.2025 | € | 8.500 | 8.394 | 0,08 |
| **Nova Ljubljanska Banka d.d.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 05.02.2030 | | 7.400 | 6.808 | 0,07 |
| Summe Slowenien | | | 15.202 | 0,15 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AngloGold Ashanti Holdings PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.10.2030 | $ | 2.000 | 1.650 | 0,02 |
| **Growthpoint Properties International Pty. Ltd.** | | | | |
| 5,872 % fällig am 02.05.2023 | | 2.000 | 1.999 | 0,02 |
| **Sasol Financing USA LLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 27.03.2024 | | 4.300 | 4.216 | 0,04 |
| Summe Südafrika | | | 7.865 | 0,08 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 17.06.2025 (l) | € | 8.800 | 8.603 | 0,09 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (h)(j) | | 2.000 | 2.013 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 29.03.2024 (h)(j) | | 3.000 | 2.950 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 15.01.2026 (h)(j) | | 10.000 | 9.535 | 0,09 |
| **Banco de Sabadell S.A.** | | | | |
| 0,875 % fällig am 22.07.2025 | | 700 | 680 | 0,01 |
| 1,125 % fällig am 27.03.2025 | | 5.200 | 5.008 | 0,05 |
| 1,750 % fällig am 10.05.2024 | | 2.000 | 2.025 | 0,02 |
| 5,625 % fällig am 06.05.2026 | | 100 | 102 | 0,00 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 3,490 % fällig am 28.05.2030 | $ | 1.400 | 1.240 | 0,01 |
| 4,375 % fällig am 14.01.2026 (h)(j) | € | 4.200 | 3.707 | 0,04 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 09.10.2027 (h)(j) | | 6.600 | 6.085 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 18.07.2022 (h)(j) | | 400 | 419 | 0,00 |
| **Cellnex Finance Co. S.A.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 15.09.2032 | | 25.400 | 18.077 | 0,18 |
| | | | 60.444 | 0,60 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Grifols S.A.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.11.2027 | | 1.296 | 1.263 | 0,01 |
| Summe Spanien | | | 61.707 | 0,61 |
| **SRI LANKA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Sri Lanka Government International Bond** | | | | |
| 7,550 % fällig am 28.03.2030 ^ | $ | 18.000 | 5.829 | 0,06 |
| 7,850 % fällig am 14.03.2029 ^ | | 6.000 | 1.970 | 0,02 |
| Summe Sri Lanka | | | 7.799 | 0,08 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **SUPRANATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banque Ouest Africaine de Developpement** | | | | |
| 2,750 % fällig am 22.01.2033 | € | 7.300 | $ 6.129 | 0,06 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Sagax AB** | | | | |
| 2,250 % fällig am 13.03.2025 | | 300 | 298 | 0,01 |
| **Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB** | | | | |
| 1,750 % fällig am 14.01.2025 | | 1.600 | 1.228 | 0,01 |
| **Volvo Car AB** | | | | |
| 4,250 % fällig am 31.05.2028 | | 31.900 | 31.223 | 0,31 |
| Summe Schweden | | | 32.749 | 0,33 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (j) | $ | 75.950 | 76.139 | 0,76 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 3,869 % fällig am 12.01.2029 | | 300 | 270 | 0,00 |
| 4,194 % fällig am 01.04.2031 | | 1.400 | 1.240 | 0,01 |
| 6,375 % fällig am 21.08.2026 (h)(j) | | 4.400 | 3.646 | 0,04 |
| 7,125 % fällig am 29.07.2022 (h)(j) | | 1.600 | 1.599 | 0,01 |
| 7,250 % fällig am 12.09.2025 (h)(j) | | 400 | 348 | 0,00 |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (h)(j) | | 6.000 | 5.551 | 0,05 |
| 7,500 % fällig am 11.12.2023 (h)(j) | | 9.200 | 8.787 | 0,09 |
| **UBS AG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (j) | | 37.100 | 37.093 | 0,37 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (j) | | 15.018 | 15.063 | 0,15 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 4,125 % fällig am 24.09.2025 | | 1.900 | 1.888 | 0,02 |
| 4,125 % fällig am 15.04.2026 | | 16.200 | 15.971 | 0,16 |
| 5,125 % fällig am 29.07.2026 (h)(j) | | 5.300 | 4.766 | 0,05 |
| Summe Schweiz | | | 172.361 | 1,71 |
| **TÜRKEI** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Turkey Government International Bond** | | | | |
| 4,875 % fällig am 16.04.2043 | | 33.867 | 20.119 | 0,20 |
| 5,750 % fällig am 11.05.2047 | | 66.200 | 40.934 | 0,41 |
| 6,875 % fällig am 17.03.2036 | | 600 | 441 | 0,00 |
| Summe Türkei | | | 61.494 | 0,61 |
| **UKRAINE** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ukraine Government International Bond** | | | | |
| 4,375 % fällig am 27.01.2030 | € | 51.000 | 13.330 | 0,13 |
| 6,750 % fällig am 20.06.2026 | | 6.300 | 1.712 | 0,02 |
| 6,876 % fällig am 21.05.2029 | $ | 6.400 | 1.584 | 0,02 |
| 7,375 % fällig am 25.09.2032 | | 5.300 | 1.338 | 0,01 |
| 8,994 % fällig am 01.02.2024 | | 8.500 | 2.189 | 0,02 |
| Summe Ukraine | | | 20.153 | 0,20 |
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **DAE Sukuk Difc Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.02.2026 | | 12.300 | 11.646 | 0,12 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (j) | | 8.435 | 8.520 | 0,08 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 0,577 % fällig am 09.08.2029 | € | 2.600 | 2.216 | 0,02 |
| 2,279 % fällig am 24.11.2027 | $ | 1.300 | 1.153 | 0,01 |
| 6,125 % fällig am 15.12.2025 (h)(j) | | 11.900 | 11.064 | 0,11 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (h)(j) | £ | 9.900 | 11.852 | 0,12 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (h)(j) | $ | 3.700 | 3.644 | 0,04 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2022 (h)(j) | £ | 14.500 | 17.576 | 0,17 |
| **BAT International Finance PLC** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.06.2025 | $ | 1.700 | 1.669 | 0,02 |
| **Bellis Acquisition Co. PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 16.02.2026 | £ | 59.500 | 56.363 | 0,56 |
| **FCE Bank PLC** | | | | |
| 1,615 % fällig am 11.05.2023 | € | 300 | $ 311 | 0,00 |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC** | | | | |
| 2,950 % fällig am 27.01.2029 | $ | 34.100 | 10.230 | 0,10 |
| 3,000 % fällig am 29.06.2027 | | 77.600 | 23.280 | 0,23 |
| 3,250 % fällig am 25.02.2030 | | 3.200 | 960 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 14.07.2031 | | 13.000 | 3.900 | 0,04 |
| **Greene King Finance PLC** | | | | |
| 5,106 % fällig am 15.03.2034 | £ | 380 | 472 | 0,00 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 1,645 % fällig am 18.04.2026 | $ | 5.000 | 4.587 | 0,05 |
| 2,099 % fällig am 04.06.2026 | | 3.400 | 3.145 | 0,03 |
| 2,848 % fällig am 04.06.2031 | | 4.400 | 3.722 | 0,04 |
| 3,900 % fällig am 25.05.2026 | | 31.700 | 31.040 | 0,31 |
| 3,973 % fällig am 22.05.2030 | | 9.900 | 9.102 | 0,09 |
| 4,300 % fällig am 08.03.2026 | | 36.900 | 36.581 | 0,36 |
| 4,750 % fällig am 04.07.2029 (h)(j) | € | 1.000 | 878 | 0,01 |
| 4,950 % fällig am 31.03.2030 | $ | 2.700 | 2.670 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 29.09.2023 (h)(j) | € | 200 | 207 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 23.03.2023 (h)(j) | $ | 700 | 687 | 0,01 |
| **INEOS Finance PLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 01.05.2026 | € | 17.800 | 16.296 | 0,16 |
| **Informa PLC** | | | | |
| 1,250 % fällig am 22.04.2028 | | 7.900 | 7.241 | 0,07 |
| **Jaguar Land Rover Automotive PLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.03.2023 | £ | 1.200 | 1.404 | 0,01 |
| 5,875 % fällig am 15.11.2024 | € | 35.000 | 33.744 | 0,33 |
| **John Lewis PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 18.12.2034 | £ | 6.710 | 6.199 | 0,06 |
| 6,125 % fällig am 21.01.2025 | | 6.000 | 7.533 | 0,07 |
| **Legal & General Group PLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 24.03.2031 (h)(j) | | 2.200 | 2.263 | 0,02 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 2,438 % fällig am 05.02.2026 | $ | 6.400 | 6.061 | 0,06 |
| 3,511 % fällig am 18.03.2026 | | 1.600 | 1.559 | 0,02 |
| 3,750 % fällig am 18.03.2028 | | 4.800 | 4.572 | 0,05 |
| 4,450 % fällig am 08.05.2025 | | 32.400 | 32.472 | 0,32 |
| **Market Bidco Finco PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 04.11.2027 | € | 21.200 | 17.664 | 0,18 |
| **Marks & Spencer PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 19.05.2026 | £ | 6.000 | 6.415 | 0,06 |
| 4,500 % fällig am 10.07.2027 | | 13.538 | 14.065 | 0,14 |
| 6,000 % fällig am 12.06.2025 | | 11.714 | 13.892 | 0,14 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | |
| 1,738 % fällig am 15.12.2030 | | 3.977 | 4.576 | 0,05 |
| 2,279 % fällig am 15.12.2030 | $ | 1.550 | 1.433 | 0,01 |
| 6,013 % fällig am 15.12.2030 | £ | 371 | 459 | 0,00 |
| 6,469 % fällig am 15.09.2032 | | 1.700 | 2.142 | 0,02 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 4,363 % fällig am 01.08.2024 | $ | 32.600 | 32.650 | 0,32 |
| 5,750 % fällig am 20.06.2027 (h)(j) | £ | 4.500 | 4.899 | 0,05 |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 1,750 % fällig am 02.03.2026 | € | 6.000 | 6.023 | 0,06 |
| 2,000 % fällig am 04.03.2025 | | 500 | 517 | 0,01 |
| 4,800 % fällig am 05.04.2026 | $ | 43.075 | 42.987 | 0,43 |
| 4,892 % fällig am 18.05.2029 | | 18.400 | 17.849 | 0,18 |
| 6,000 % fällig am 29.12.2025 (h)(j) | | 19.000 | 17.630 | 0,18 |
| **Pinnacle Bidco PLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.02.2025 | € | 900 | 852 | 0,01 |
| 6,375 % fällig am 15.02.2025 | £ | 2.500 | 2.725 | 0,03 |
| **Rolls-Royce PLC** | | | | |
| 0,875 % fällig am 09.05.2024 | € | 17.100 | 16.570 | 0,16 |
| 4,625 % fällig am 16.02.2026 | | 4.500 | 4.431 | 0,04 |
| 5,750 % fällig am 15.10.2027 | $ | 2.800 | 2.531 | 0,03 |
| 5,750 % fällig am 15.10.2027 | £ | 3.500 | 4.012 | 0,04 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 3,823 % fällig am 03.11.2028 | $ | 19.324 | 17.954 | 0,18 |
| 6,750 % fällig am 24.06.2024 (h)(j) | £ | 25.535 | 29.924 | 0,30 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 7,750 % fällig am 02.04.2023 (h)(j) | $ | 400 | 396 | 0,00 |
| **Swiss Re Finance UK PLC** | | | | |
| 2,714 % fällig am 04.06.2052 | € | 1.900 | 1.620 | 0,02 |
| **Tesco Property Finance PLC** | | | | |
| 5,411 % fällig am 13.07.2044 | £ | 20.697 | 25.494 | 0,25 |
| 5,661 % fällig am 13.10.2041 | | 97 | 122 | 0,00 |
| 5,744 % fällig am 13.04.2040 | | 2.326 | 2.981 | 0,03 |
| 5,801 % fällig am 13.10.2040 | | 283 | 364 | 0,00 |
| **TP ICAP Finance PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 26.01.2024 | £ | 4.091 | $ 4.921 | 0,05 |
| 5,250 % fällig am 29.05.2026 | | 5.482 | 6.512 | 0,06 |
| **Travis Perkins PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 07.09.2023 | | 2.200 | 2.563 | 0,03 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.08.2030 | | 29.600 | 28.723 | 0,29 |
| 4,250 % fällig am 15.01.2030 | | 26.300 | 25.816 | 0,26 |
| **Virgin Money UK PLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 24.06.2025 | € | 23.000 | 23.816 | 0,24 |
| 3,125 % fällig am 22.06.2025 | £ | 500 | 590 | 0,01 |
| 3,375 % fällig am 24.04.2026 | | 1.500 | 1.734 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 25.09.2026 | | 4.500 | 5.287 | 0,05 |
| 4,000 % fällig am 03.09.2027 | | 6.500 | 7.539 | 0,07 |
| **Vmed O2 UK Financing PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 31.01.2031 | € | 12.900 | 10.434 | 0,10 |
| 4,000 % fällig am 31.01.2029 | £ | 41.400 | 40.115 | 0,40 |
| 4,500 % fällig am 15.07.2031 | | 9.700 | 9.341 | 0,09 |
| | | | 825.741 | 8,20 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **INEOS Finance PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 08.11.2028 | € | 28.300 | 27.204 | 0,27 |
| **INEOS Quattro Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.01.2026 | | 4.900 | 4.692 | 0,05 |
| | | | 31.896 | 0,32 |
| Summe Großbritannien | | | 857.637 | 8,52 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,014 % fällig am 25.04.2036 | $ | 327 | 325 | 0,00 |
| 1,884 % fällig am 25.09.2036 | | 859 | 842 | 0,01 |
| 2,344 % fällig am 25.09.2035 | | 2.697 | 2.671 | 0,03 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,779 % fällig am 25.08.2036 | | 629 | 602 | 0,01 |
| 1,784 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 2.385 | 675 | 0,01 |
| 1,924 % fällig am 25.04.2036 | | 312 | 302 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 11.546 | 3.483 | 0,04 |
| 2,224 % fällig am 25.02.2036 | | 759 | 750 | 0,01 |
| 2,284 % fällig am 25.11.2035 | | 316 | 317 | 0,00 |
| 2,419 % fällig am 25.01.2035 | | 661 | 618 | 0,01 |
| 2,524 % fällig am 25.12.2034 | | 1.130 | 1.044 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 79 | 75 | 0,00 |
| 2,599 % fällig am 25.06.2034 | | 475 | 451 | 0,01 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,269 % fällig am 25.12.2035 | | 200 | 193 | 0,00 |
| 2,624 % fällig am 25.03.2035 | | 275 | 263 | 0,00 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,299 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 25 | 25 | 0,00 |
| **Ameriquest Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,209 % fällig am 25.03.2036 | | 16 | 16 | 0,00 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,494 % fällig am 25.07.2034 | | 166 | 164 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.05.2035 | | 784 | 780 | 0,01 |
| 2,614 % fällig am 25.11.2034 | | 440 | 438 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.09.2034 | | 1.156 | 1.145 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.10.2034 | | 156 | 154 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.11.2034 | | 385 | 378 | 0,00 |
| 2,734 % fällig am 25.03.2035 | | 200 | 196 | 0,00 |
| **Amortizing Residential Collateral Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.10.2034 | | 94 | 91 | 0,00 |
| **Argent Securities Trust** | | | | |
| 2,164 % fällig am 25.05.2036 | | 813 | 222 | 0,00 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | |
| 1,734 % fällig am 25.01.2037 | | 190 | 117 | 0,00 |
| 1,784 % fällig am 25.01.2037 | | 659 | 406 | 0,00 |
| 1,844 % fällig am 25.01.2037 | | 220 | 136 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.03.2034 ^ | | 271 | 261 | 0,00 |
| 2,874 % fällig am 25.06.2037 | | 2.398 | 1.822 | 0,02 |
| **Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,584 % fällig am 25.07.2035 | | 256 | 255 | 0,00 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,824 % fällig am 25.12.2036 | | 18 | 18 | 0,00 |
| 1,964 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 7 | 7 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| 2,164 % fällig am 25.06.2036 | $ 63 | $ 63 | 0,00 |
| 2,269 % fällig am 25.12.2035 | 57 | 57 | 0,00 |
| 2,449 % fällig am 25.06.2036 | 36 | 36 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.04.2035 | 4 | 4 | 0,00 |
| 2,624 % fällig am 25.10.2037 | 20 | 20 | 0,00 |
| 2,629 % fällig am 25.06.2035 | 528 | 521 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.11.2035 ^ | 32 | 30 | 0,00 |
| 2,824 % fällig am 25.01.2045 | 84 | 84 | 0,00 |
| 2,874 % fällig am 25.08.2037 | 426 | 422 | 0,01 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,784 % fällig am 25.10.2036 | 779 | 650 | 0,01 |
| 1,844 % fällig am 25.01.2037 | 1.200 | 909 | 0,01 |
| 1,864 % fällig am 25.06.2036 | 2.338 | 2.258 | 0,02 |
| 1,874 % fällig am 25.10.2036 | 779 | 652 | 0,01 |
| 1,884 % fällig am 25.02.2037 | 2.370 | 2.217 | 0,02 |
| **Chase Funding Trust** | | | |
| 6,333 % fällig am 25.04.2032 | 155 | 154 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,784 % fällig am 25.01.2037 | 758 | 370 | 0,00 |
| 1,824 % fällig am 25.05.2037 | 851 | 630 | 0,01 |
| 1,944 % fällig am 25.09.2036 | 651 | 499 | 0,01 |
| 2,014 % fällig am 25.01.2037 | 13 | 13 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.11.2046 | 734 | 716 | 0,01 |
| 2,044 % fällig am 25.12.2036 | 1.600 | 1.573 | 0,02 |
| 2,299 % fällig am 25.11.2045 | 23 | 23 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | |
| 1,884 % fällig am 25.03.2037 | 1.079 | 981 | 0,01 |
| 2,359 % fällig am 25.09.2035 ^ | 199 | 198 | 0,00 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | |
| 2,124 % fällig am 25.01.2046 ^ | 8.033 | 7.578 | 0,08 |
| 2,174 % fällig am 25.05.2047 ^ | 923 | 725 | 0,01 |
| 2,524 % fällig am 25.03.2047 ^ | 59 | 51 | 0,00 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | |
| 1,764 % fällig am 25.07.2037 ^ | 860 | 842 | 0,01 |
| 1,774 % fällig am 25.06.2047 ^ | 37 | 37 | 0,00 |
| 1,844 % fällig am 25.06.2037 | 1.119 | 1.079 | 0,01 |
| 1,844 % fällig am 25.09.2037 ^ | 86 | 88 | 0,00 |
| 1,854 % fällig am 25.10.2047 | 1.426 | 1.408 | 0,01 |
| 1,924 % fällig am 25.03.2047 ^ | 919 | 902 | 0,01 |
| 1,934 % fällig am 25.09.2037 ^ | 651 | 580 | 0,01 |
| 1,944 % fällig am 25.05.2036 | 63 | 71 | 0,00 |
| 2,104 % fällig am 25.02.2037 ^ | 4.100 | 3.496 | 0,04 |
| 2,149 % fällig am 25.08.2036 | 4.600 | 4.434 | 0,04 |
| 2,224 % fällig am 25.06.2036 | 144 | 143 | 0,00 |
| 2,314 % fällig am 25.05.2036 | 454 | 451 | 0,01 |
| 2,324 % fällig am 25.03.2036 ^ | 1.564 | 1.404 | 0,01 |
| 2,419 % fällig am 25.02.2036 | 21 | 21 | 0,00 |
| 2,464 % fällig am 25.10.2047 | 4.431 | 4.275 | 0,04 |
| 2,614 % fällig am 25.02.2036 ^ | 10.608 | 9.834 | 0,10 |
| 2,719 % fällig am 25.07.2035 | 193 | 192 | 0,00 |
| 3,124 % fällig am 25.02.2035 | 194 | 193 | 0,00 |
| 3,199 % fällig am 25.11.2034 | 1.060 | 1.039 | 0,01 |
| 4,444 % fällig am 25.07.2036 | 1.574 | 1.435 | 0,02 |
| 4,444 % fällig am 25.07.2036 | 50 | 48 | 0,00 |
| 4,550 % fällig am 25.04.2047 ^ | 700 | 0 | 0,00 |
| 4,740 % fällig am 25.10.2035 | 0 | 0 | 0,00 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.** | | | |
| 2,344 % fällig am 25.07.2034 | 51 | 50 | 0,00 |
| 2,479 % fällig am 25.08.2034 | 94 | 92 | 0,00 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc.** | | | |
| 2,184 % fällig am 25.04.2034 | 16 | 14 | 0,00 |
| 2,374 % fällig am 25.03.2034 | 23 | 23 | 0,00 |
| 2,424 % fällig am 25.08.2047 | 100 | 99 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | |
| 2,244 % fällig am 25.01.2032 | 24 | 23 | 0,00 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC** | | | |
| 1,844 % fällig am 25.07.2037 | 191 | 135 | 0,00 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | |
| 2,124 % fällig am 25.07.2036 | 4.303 | 4.085 | 0,04 |
| **Ellington Loan Acquisition Trust** | | | |
| 2,674 % fällig am 25.05.2037 | 2.316 | 2.261 | 0,02 |
| **EMC Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,724 % fällig am 25.11.2041 | 3 | 3 | 0,00 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,000 % fällig am 25.04.2036 (b)(f) | 182 | 181 | 0,00 |
| 1,944 % fällig am 25.04.2036 | 141 | 136 | 0,00 |
| 2,104 % fällig am 25.04.2036 | 400 | 367 | 0,00 |
| 2,104 % fällig am 25.08.2036 | 163 | 153 | 0,00 |
| 2,344 % fällig am 25.10.2035 | 107 | 107 | 0,00 |
| 2,569 % fällig am 25.03.2035 | 66 | 65 | 0,00 |
| 2,824 % fällig am 25.01.2035 | $ 105 | $ 104 | 0,00 |
| 3,049 % fällig am 25.10.2034 | 222 | 218 | 0,00 |
| 3,499 % fällig am 25.07.2034 | 904 | 881 | 0,01 |
| **First NLC Trust** | | | |
| 2,084 % fällig am 25.05.2035 | 197 | 179 | 0,00 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | |
| 1,964 % fällig am 25.02.2036 | 2.143 | 2.070 | 0,02 |
| 1,964 % fällig am 25.02.2037 | 1.132 | 439 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.06.2035 ^ | 3.077 | 2.827 | 0,03 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | |
| 1,744 % fällig am 25.11.2036 | 423 | 134 | 0,00 |
| 1,864 % fällig am 25.04.2047 | 85 | 80 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.08.2037 | 71 | 71 | 0,00 |
| **GSAMP Trust** | | | |
| 1,674 % fällig am 25.12.2046 | 247 | 131 | 0,00 |
| 1,714 % fällig am 25.01.2037 | 286 | 184 | 0,00 |
| 1,764 % fällig am 25.12.2036 | 6.033 | 3.455 | 0,04 |
| 2,164 % fällig am 25.04.2036 | 1.547 | 1.107 | 0,01 |
| 2,209 % fällig am 25.01.2036 | 227 | 227 | 0,00 |
| 2,494 % fällig am 25.11.2034 | 406 | 396 | 0,00 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | |
| 2,719 % fällig am 25.07.2035 | 222 | 221 | 0,00 |
| **Home Equity Loan Trust** | | | |
| 1,964 % fällig am 25.04.2037 | 2.000 | 1.779 | 0,02 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | |
| 1,764 % fällig am 25.11.2036 | 328 | 298 | 0,00 |
| 1,864 % fällig am 25.04.2037 | 847 | 588 | 0,01 |
| 2,004 % fällig am 25.06.2036 | 96 | 95 | 0,00 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | |
| 1,844 % fällig am 25.12.2036 | 505 | 163 | 0,00 |
| 1,904 % fällig am 25.01.2037 | 3.161 | 2.387 | 0,02 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | |
| 1,814 % fällig am 25.03.2047 | 867 | 859 | 0,01 |
| 1,864 % fällig am 25.08.2036 | 49 | 49 | 0,00 |
| 1,884 % fällig am 25.03.2037 | 143 | 141 | 0,00 |
| 1,884 % fällig am 25.06.2037 | 252 | 252 | 0,00 |
| 1,904 % fällig am 25.01.2037 | 180 | 179 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.03.2037 | 4.349 | 4.099 | 0,04 |
| 2,029 % fällig am 25.05.2036 | 36 | 37 | 0,00 |
| 2,029 % fällig am 25.07.2036 | 180 | 175 | 0,00 |
| 4,436 % fällig am 25.01.2037 ^ | 512 | 316 | 0,00 |
| **Lehman ABS Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,714 % fällig am 25.06.2037 | 264 | 189 | 0,00 |
| 1,824 % fällig am 25.06.2037 | 135 | 98 | 0,00 |
| **Lehman XS Trust** | | | |
| 2,424 % fällig am 25.10.2035 | 58 | 58 | 0,00 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,804 % fällig am 25.09.2036 | 14.571 | 4.736 | 0,05 |
| 2,164 % fällig am 25.05.2046 | 2.525 | 905 | 0,01 |
| 2,224 % fällig am 25.02.2036 | 11.734 | 10.067 | 0,10 |
| 2,269 % fällig am 25.11.2035 | 79 | 78 | 0,00 |
| 2,359 % fällig am 25.08.2035 | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.06.2035 | 318 | 312 | 0,00 |
| 2,899 % fällig am 25.02.2035 | 2.259 | 2.219 | 0,02 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 1,759 % fällig am 25.08.2036 | 3.430 | 1.473 | 0,02 |
| 1,794 % fällig am 25.10.2036 | 53 | 53 | 0,00 |
| 1,824 % fällig am 25.08.2036 | 5.095 | 1.697 | 0,02 |
| 1,844 % fällig am 25.08.2036 | 2.015 | 862 | 0,01 |
| 1,924 % fällig am 25.03.2036 | 1.096 | 986 | 0,01 |
| 1,984 % fällig am 25.02.2036 | 348 | 152 | 0,00 |
| 2,104 % fällig am 25.03.2036 | 1.099 | 812 | 0,01 |
| 2,314 % fällig am 25.03.2035 | 24 | 24 | 0,00 |
| 2,374 % fällig am 25.10.2035 ^ | 314 | 299 | 0,00 |
| 2,404 % fällig am 25.02.2034 | 510 | 482 | 0,01 |
| 2,524 % fällig am 25.04.2034 | 353 | 338 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.10.2035 | 2.625 | 2.425 | 0,03 |
| **MASTR Specialized Loan Trust** | | | |
| 2,749 % fällig am 25.11.2035 | 156 | 150 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | |
| 1,924 % fällig am 25.08.2037 | 2.895 | 1.627 | 0,02 |
| 2,074 % fällig am 25.02.2047 | 116 | 75 | 0,00 |
| 2,344 % fällig am 25.05.2036 | 85 | 83 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.04.2035 | 140 | 137 | 0,00 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | |
| 1,694 % fällig am 25.10.2036 | 69 | 35 | 0,00 |
| 1,754 % fällig am 25.11.2036 | 318 | 156 | 0,00 |
| 1,754 % fällig am 25.01.2037 | 925 | 492 | 0,01 |
| 1,764 % fällig am 25.10.2036 | 2.015 | 1.026 | 0,01 |
| 1,764 % fällig am 25.11.2036 | 200 | 107 | 0,00 |
| 1,764 % fällig am 25.05.2037 | $ 3.657 | $ 2.808 | 0,03 |
| 1,774 % fällig am 25.10.2036 | 180 | 101 | 0,00 |
| 1,774 % fällig am 25.11.2036 | 3.118 | 1.982 | 0,02 |
| 1,784 % fällig am 25.09.2036 | 1.224 | 576 | 0,01 |
| 1,824 % fällig am 25.09.2036 | 4 | 1 | 0,00 |
| 1,844 % fällig am 25.11.2036 | 250 | 134 | 0,00 |
| 1,874 % fällig am 25.03.2037 | 952 | 457 | 0,01 |
| 2,204 % fällig am 25.01.2035 | 686 | 674 | 0,01 |
| 2,244 % fällig am 25.12.2035 | 165 | 161 | 0,00 |
| 2,269 % fällig am 25.09.2035 | 51 | 51 | 0,00 |
| 2,329 % fällig am 25.12.2034 | 92 | 88 | 0,00 |
| 2,329 % fällig am 25.01.2035 | 1.380 | 1.296 | 0,01 |
| 2,479 % fällig am 25.03.2034 | 507 | 494 | 0,01 |
| 2,494 % fällig am 25.09.2035 | 4.223 | 3.524 | 0,04 |
| 2,614 % fällig am 25.06.2035 | 1.431 | 1.415 | 0,02 |
| 2,874 % fällig am 25.07.2037 | 400 | 364 | 0,00 |
| 3,524 % fällig am 25.02.2047 | 839 | 770 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Capital, Inc. Trust** | | | |
| 1,984 % fällig am 25.03.2036 | 104 | 86 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust** | | | |
| 2,974 % fällig am 25.02.2033 | 281 | 274 | 0,00 |
| 3,199 % fällig am 25.11.2032 | 136 | 135 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | |
| 1,724 % fällig am 25.12.2036 | 1.504 | 816 | 0,01 |
| 1,854 % fällig am 25.04.2037 | 2.536 | 1.479 | 0,02 |
| 1,944 % fällig am 25.04.2036 | 72 | 54 | 0,00 |
| 1,974 % fällig am 25.04.2037 | 17.317 | 10.145 | 0,10 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,336 % fällig am 25.11.2036 ^ | 232 | 102 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | 61 | 44 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Structured Trust** | | | |
| 1,854 % fällig am 25.06.2037 | 961 | 959 | 0,01 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | |
| 1,984 % fällig am 25.05.2036 | 9 | 9 | 0,00 |
| 2,344 % fällig am 25.03.2035 | 167 | 163 | 0,00 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,239 % fällig am 25.02.2036 | 16 | 16 | 0,00 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | |
| 1,724 % fällig am 25.01.2037 | 1.057 | 395 | 0,00 |
| 1,724 % fällig am 25.03.2037 | 906 | 367 | 0,00 |
| 1,774 % fällig am 25.03.2037 | 1.134 | 459 | 0,01 |
| 1,784 % fällig am 25.09.2037 | 1.534 | 1.512 | 0,02 |
| 1,834 % fällig am 25.01.2037 | 1.261 | 471 | 0,01 |
| 3,499 % fällig am 25.03.2035 | 809 | 798 | 0,01 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,764 % fällig am 25.01.2037 | 161 | 101 | 0,00 |
| 1,794 % fällig am 25.05.2037 | 137 | 79 | 0,00 |
| 1,804 % fällig am 25.04.2037 | 469 | 242 | 0,00 |
| 1,874 % fällig am 25.07.2037 | 2.435 | 1.876 | 0,02 |
| 2,164 % fällig am 25.01.2036 | 400 | 374 | 0,00 |
| 2,194 % fällig am 25.01.2036 | 5.043 | 3.870 | 0,04 |
| 2,389 % fällig am 25.08.2035 | 400 | 385 | 0,00 |
| **Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates** | | | |
| 2,314 % fällig am 25.11.2035 | 515 | 501 | 0,01 |
| **Ownit Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,524 % fällig am 25.10.2036 ^ | 138 | 131 | 0,00 |
| **Park Place Securities, Inc.** | | | |
| 2,359 % fällig am 25.09.2035 | 200 | 196 | 0,00 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,359 % fällig am 25.08.2035 | 410 | 402 | 0,00 |
| 2,359 % fällig am 25.09.2035 | 7.569 | 7.381 | 0,07 |
| 2,419 % fällig am 25.07.2035 | 149 | 148 | 0,00 |
| 2,449 % fällig am 25.07.2035 | 400 | 385 | 0,00 |
| 2,569 % fällig am 25.06.2035 | 54 | 54 | 0,00 |
| 2,614 % fällig am 25.09.2034 | 69 | 69 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.10.2034 | 365 | 359 | 0,00 |
| 2,749 % fällig am 25.03.2035 | 353 | 347 | 0,00 |
| 2,869 % fällig am 25.01.2036 | 111 | 110 | 0,00 |
| 3,424 % fällig am 25.12.2034 | 406 | 397 | 0,00 |
| **People's Choice Home Loan Securities Trust** | | | |
| 2,974 % fällig am 25.01.2035 | 647 | 629 | 0,01 |
| **People's Financial Realty Mortgage Securities Trust** | | | |
| 1,764 % fällig am 25.09.2036 | 1.021 | 325 | 0,00 |
| **Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 1,834 % fällig am 25.01.2037 | 493 | 476 | 0,01 |
| 1,884 % fällig am 25.11.2036 | 51 | 50 | 0,00 |
| 2,209 % fällig am 25.02.2036 | 105 | 104 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **RAAC Trust** | | | | |
| 1,974 % fällig am 25.11.2046 | $ | 182 | $ 172 | 0,00 |
| 2,134 % fällig am 25.08.2036 | | 12 | 12 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.06.2044 | | 61 | 53 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.09.2045 | | 100 | 99 | 0,00 |
| 2,824 % fällig am 25.10.2045 | | 71 | 71 | 0,00 |
| 3,124 % fällig am 25.09.2047 | | 429 | 417 | 0,00 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 5,340 % fällig am 25.01.2037 | | 1.251 | 490 | 0,01 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | | |
| 2,264 % fällig am 25.01.2036 | | 467 | 440 | 0,01 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 1 | 2 | 0,00 |
| 1,864 % fällig am 25.09.2036 | | 64 | 63 | 0,00 |
| 1,884 % fällig am 25.11.2036 | | 289 | 263 | 0,00 |
| 1,964 % fällig am 25.11.2036 | | 76 | 71 | 0,00 |
| 2,184 % fällig am 25.04.2036 | | 36 | 35 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.02.2036 | | 165 | 161 | 0,00 |
| 2,254 % fällig am 25.12.2035 | | 134 | 134 | 0,00 |
| 2,284 % fällig am 25.11.2035 | | 71 | 71 | 0,00 |
| 2,284 % fällig am 25.12.2035 | | 170 | 153 | 0,00 |
| 2,464 % fällig am 25.12.2034 | | 9 | 9 | 0,00 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.05.2047 | | 6.798 | 5.042 | 0,05 |
| 2,089 % fällig am 25.03.2036 | | 1.879 | 1.818 | 0,02 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 1,804 % fällig am 25.07.2036 | | 252 | 100 | 0,00 |
| 1,904 % fällig am 25.07.2036 | | 793 | 703 | 0,01 |
| 2,124 % fällig am 25.03.2036 | | 1.296 | 850 | 0,01 |
| 2,124 % fällig am 25.05.2036 | | 269 | 158 | 0,00 |
| 2,164 % fällig am 25.03.2036 | | 123 | 111 | 0,00 |
| 2,284 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 119 | 90 | 0,00 |
| **SG Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 1,834 % fällig am 25.10.2036 | | 1.500 | 1.155 | 0,01 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 1,684 % fällig am 25.11.2036 | | 35 | 12 | 0,00 |
| 1,864 % fällig am 25.07.2036 | | 200 | 179 | 0,00 |
| 2,089 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 16.652 | 13.804 | 0,14 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.11.2037 | | 683 | 434 | 0,01 |
| 1,894 % fällig am 25.04.2037 | | 135 | 101 | 0,00 |
| 3,455 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 511 | 219 | 0,00 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.06.2036 | | 31 | 30 | 0,00 |
| 1,774 % fällig am 25.09.2036 | | 167 | 162 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.01.2036 | | 123 | 120 | 0,00 |
| 2,299 % fällig am 25.11.2035 | | 2.708 | 2.481 | 0,03 |
| 2,389 % fällig am 25.08.2035 | | 5.285 | 5.122 | 0,05 |
| 2,524 % fällig am 25.09.2034 | | 50 | 49 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.01.2035 | | 318 | 312 | 0,00 |
| 2,599 % fällig am 25.10.2033 | | 66 | 65 | 0,00 |
| 2,749 % fällig am 25.07.2033 | | 27 | 27 | 0,00 |
| 3,004 % fällig am 25.04.2033 | | 11 | 10 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,754 % fällig am 25.02.2037 | | 78 | 77 | 0,00 |
| 1,854 % fällig am 25.01.2037 | | 2.192 | 1.482 | 0,02 |
| 1,874 % fällig am 25.09.2036 | | 45 | 45 | 0,00 |
| 1,964 % fällig am 25.12.2036 | | 265 | 259 | 0,00 |
| 2,044 % fällig am 25.02.2037 | | 169 | 160 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.08.2037 | | 51 | 51 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 2,314 % fällig am 25.09.2035 | | 189 | 182 | 0,00 |
| **Truman Capital Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,884 % fällig am 25.03.2036 | | 751 | 744 | 0,01 |
| **WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust** | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.01.2037 | | 982 | 868 | 0,01 |
| **Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 2,104 % fällig am 25.05.2036 | | 733 | 605 | 0,01 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,119 % fällig am 25.05.2036 | | 3.308 | 3.277 | 0,03 |
| 3,199 % fällig am 25.02.2035 | | 44 | 44 | 0,00 |
| **Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,364 % fällig am 25.04.2034 | | 170 | 164 | 0,00 |
| | | | 232.736 | 2,31 |

| STAMMAKTIEN | | | |
|---|---|---|---|
| **ENERGIE** | | | |
| **Constellation Oil Services Holding S.A. (e)(k)** | 844.339 | $ 91 | 0,00 |
| **Noble Corp. (e)(k)** | 161.718 | 4.100 | 0,04 |
| **Valaris Ltd. (e)** | 65.990 | 2.787 | 0,03 |
| Summe Stammaktien | | 6.978 | 0,07 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Alaska Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,800 % fällig am 15.02.2029 | $ | 2.912 | 2.879 | 0,03 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.11.2031 | | 13.475 | 14.969 | 0,15 |
| **American Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.04.2030 | | 224 | 204 | 0,00 |
| 3,150 % fällig am 15.08.2033 | | 2.775 | 2.461 | 0,02 |
| 3,200 % fällig am 15.12.2029 | | 3.933 | 3.604 | 0,04 |
| 3,350 % fällig am 15.04.2031 | | 4.153 | 3.825 | 0,04 |
| 3,375 % fällig am 01.11.2028 | | 4.102 | 3.684 | 0,04 |
| 3,575 % fällig am 15.07.2029 | | 2.362 | 2.198 | 0,02 |
| 3,650 % fällig am 15.12.2029 | | 4.452 | 3.695 | 0,04 |
| 3,650 % fällig am 15.08.2030 | | 4.545 | 4.247 | 0,04 |
| 3,700 % fällig am 01.04.2028 | | 4.382 | 3.804 | 0,04 |
| **Antares Holdings LP** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.01.2027 | | 2.700 | 2.159 | 0,02 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.05.2023 | | 700 | 694 | 0,01 |
| 4,375 % fällig am 30.01.2024 | | 800 | 786 | 0,01 |
| 4,875 % fällig am 01.10.2025 | | 600 | 582 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 15.12.2024 | | 9.500 | 9.425 | 0,09 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,808 % fällig am 09.05.2026 | € | 300 | 297 | 0,00 |
| 1,776 % fällig am 04.05.2027 | | 200 | 200 | 0,00 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | |
| 3,557 % fällig am 15.08.2027 | $ | 1.300 | 1.190 | 0,01 |
| **BGC Partners, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 24.07.2023 | | 100 | 101 | 0,00 |
| **British Airways Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,900 % fällig am 15.09.2036 | | 1.296 | 1.145 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 15.05.2034 | | 2.723 | 2.626 | 0,03 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 15.02.2031 | | 9.400 | 7.562 | 0,07 |
| 3,187 % fällig am 15.11.2036 | | 2.700 | 2.056 | 0,02 |
| **Buckeye Partners LP** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.03.2025 | | 9.000 | 8.345 | 0,08 |
| **Centene Corp.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.12.2029 | | 3.800 | 3.555 | 0,04 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.03.2028 | | 4.600 | 4.302 | 0,04 |
| 5,375 % fällig am 01.04.2038 | | 4.100 | 3.651 | 0,04 |
| **Chesapeake Energy Corp.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.02.2026 | | 1.600 | 1.527 | 0,02 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 2,572 % fällig am 03.06.2031 (k) | | 7.300 | 6.143 | 0,06 |
| 3,106 % fällig am 08.04.2026 | | 3.900 | 3.749 | 0,04 |
| **CommScope, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.09.2029 | | 79.800 | 64.598 | 0,65 |
| **Coty, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.04.2026 | € | 28.900 | 26.805 | 0,27 |
| **DAE Funding LLC** | | | | |
| 1,550 % fällig am 01.08.2024 | $ | 16.500 | 15.467 | 0,15 |
| 1,625 % fällig am 15.02.2024 | | 14.100 | 13.362 | 0,13 |
| 2,625 % fällig am 20.03.2025 | | 8.000 | 7.451 | 0,07 |
| 3,375 % fällig am 20.03.2028 | | 9.100 | 8.017 | 0,08 |
| Dell International LLC | | | | |
| 8,100 % fällig am 15.07.2036 | | 2.537 | 2.966 | 0,03 |
| **Delta Air Lines, Inc.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 01.05.2025 | | 12.260 | 12.426 | 0,12 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.12.2028 | | 34.800 | 25.831 | 0,26 |
| **Edison International** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.06.2027 | | 100 | 102 | 0,00 |
| **El Paso Natural Gas Co. LLC** | | | | |
| 8,375 % fällig am 15.06.2032 | | 1.000 | 1.170 | 0,01 |
| **Energy Transfer LP** | | | | |
| 4,950 % fällig am 15.05.2028 | $ | 15.863 | $ 15.522 | 0,15 |
| 5,950 % fällig am 01.10.2043 | | 200 | 187 | 0,00 |
| 6,050 % fällig am 01.06.2041 | | 4.111 | 3.955 | 0,04 |
| 6,100 % fällig am 15.02.2042 | | 800 | 747 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 01.02.2042 | | 7.540 | 7.529 | 0,07 |
| 6,625 % fällig am 15.10.2036 | | 800 | 804 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 7,500 % fällig am 01.07.2038 | | 14.565 | 15.628 | 0,16 |
| **EQT Corp.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 01.10.2027 | | 3.200 | 2.983 | 0,03 |
| 6,625 % fällig am 01.02.2025 | | 66.035 | 68.065 | 0,68 |
| **Fidelity National Financial, Inc.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 15.06.2030 | | 200 | 175 | 0,00 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 0,092 % fällig am 07.12.2022 | € | 3.600 | 3.736 | 0,04 |
| 0,324 % fällig am 15.11.2023 | | 1.100 | 1.112 | 0,01 |
| 0,346 % fällig am 01.12.2024 | | 23.100 | 22.539 | 0,22 |
| 1,514 % fällig am 17.02.2023 | | 4.100 | 4.232 | 0,04 |
| 1,744 % fällig am 19.07.2024 | | 4.200 | 4.067 | 0,04 |
| 2,330 % fällig am 25.11.2025 | | 14.300 | 13.277 | 0,13 |
| 2,366 % fällig am 03.08.2022 | $ | 300 | 299 | 0,00 |
| 2,386 % fällig am 17.02.2026 | € | 4.500 | 4.126 | 0,04 |
| 2,700 % fällig am 10.08.2026 | $ | 14.500 | 12.374 | 0,12 |
| 2,748 % fällig am 14.06.2024 | £ | 10.400 | 11.682 | 0,12 |
| 3,021 % fällig am 06.03.2024 | € | 14.400 | 14.469 | 0,14 |
| 3,250 % fällig am 15.09.2025 | | 4.300 | 4.130 | 0,04 |
| 3,350 % fällig am 01.11.2022 | $ | 19.300 | 19.198 | 0,19 |
| 3,625 % fällig am 17.06.2031 | | 28.100 | 21.868 | 0,22 |
| 3,664 % fällig am 08.09.2024 | | 1.300 | 1.232 | 0,01 |
| 3,815 % fällig am 02.11.2027 | | 1.200 | 1.022 | 0,01 |
| 4,063 % fällig am 01.11.2024 | | 35.300 | 33.589 | 0,33 |
| 4,125 % fällig am 17.08.2027 | | 6.400 | 5.654 | 0,06 |
| 4,134 % fällig am 04.08.2025 | | 600 | 570 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 20.09.2022 | | 400 | 400 | 0,00 |
| 4,271 % fällig am 09.01.2027 | | 1.700 | 1.528 | 0,02 |
| 4,389 % fällig am 08.01.2026 | | 1.800 | 1.663 | 0,02 |
| 4,535 % fällig am 06.03.2025 | £ | 3.000 | 3.418 | 0,03 |
| 4,542 % fällig am 01.08.2026 | $ | 1.900 | 1.742 | 0,02 |
| 4,950 % fällig am 28.05.2027 | | 5.800 | 5.400 | 0,05 |
| 5,125 % fällig am 16.06.2025 | | 1.825 | 1.747 | 0,02 |
| 5,584 % fällig am 18.03.2024 | | 8.500 | 8.473 | 0,08 |
| **Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.05.2028 | | 19.800 | 16.400 | 0,16 |
| 6,500 % fällig am 01.10.2025 | | 18.910 | 17.877 | 0,18 |
| **Freedom Mortgage Corp.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.01.2027 | | 14.100 | 10.469 | 0,10 |
| 7,625 % fällig am 01.05.2026 | | 36.800 | 28.753 | 0,29 |
| 8,250 % fällig am 15.04.2025 | | 12.670 | 10.682 | 0,11 |
| **General Motors Co.** | | | | |
| 6,800 % fällig am 01.10.2027 (k) | | 1.800 | 1.897 | 0,02 |
| **Global Atlantic Fin Co.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 15.10.2029 | | 12.420 | 11.272 | 0,11 |
| **GLP Capital LP** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.06.2028 | | 3.400 | 3.327 | 0,03 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 27.03.2025 | € | 600 | 637 | 0,01 |
| **Gray Oak Pipeline LLC** | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.10.2027 | $ | 7.300 | 6.685 | 0,07 |
| **Hartford HealthCare Corp.** | | | | |
| 5,746 % fällig am 01.04.2044 | | 3.200 | 3.532 | 0,04 |
| **JetBlue Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.11.2033 | | 890 | 773 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 15.05.2034 | | 10.912 | 10.172 | 0,10 |
| **Kennedy-Wilson, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.02.2030 | | 26.100 | 20.467 | 0,20 |
| **Kinder Morgan Energy Partners LP** | | | | |
| 6,950 % fällig am 15.01.2038 | | 10.690 | 11.530 | 0,11 |
| **Kinder Morgan, Inc.** | | | | |
| 7,800 % fällig am 01.08.2031 | | 8.825 | 10.278 | 0,10 |
| **Las Vegas Sands Corp.** | | | | |
| 3,200 % fällig am 08.08.2024 | | 6.900 | 6.525 | 0,06 |
| 3,500 % fällig am 18.08.2026 | | 7.000 | 6.093 | 0,06 |
| 3,900 % fällig am 08.08.2029 | | 3.300 | 2.699 | 0,03 |
| **Lumen Technologies, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.02.2027 | | 1.300 | 1.103 | 0,01 |
| **Marriott International, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.06.2030 | | 900 | 864 | 0,01 |
| **Mattel, Inc.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 01.04.2026 | | 1.900 | 1.746 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Midwest Connector Capital Co. LLC** | | | | | |
| 3,900 % fällig am 01.04.2024 | $ | 1.300 | $ | 1.277 | 0,01 |
| **MPT Operating Partnership LP** | | | | | |
| 3,692 % fällig am 05.06.2028 | £ | 2.900 | | 3.056 | 0,03 |
| **Newell Brands, Inc.** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.06.2025 | $ | 2.000 | | 1.973 | 0,02 |
| **NGPL PipeCo LLC** | | | | | |
| 7,768 % fällig am 15.12.2037 | | 24.356 | | 26.547 | 0,26 |
| **Nissan Motor Acceptance Co. LLC** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 09.03.2026 | | 400 | | 346 | 0,00 |
| 2,650 % fällig am 13.07.2022 | | 600 | | 600 | 0,01 |
| **NuStar Logistics LP** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 28.04.2027 | | 21.800 | | 19.546 | 0,19 |
| **Omega Healthcare Investors, Inc.** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.01.2028 | | 200 | | 190 | 0,00 |
| **OneMain Finance Corp.** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.03.2023 | | 600 | | 593 | 0,01 |
| 6,125 % fällig am 15.03.2024 | | 10.200 | | 9.766 | 0,10 |
| 6,875 % fällig am 15.03.2025 | | 12.600 | | 11.967 | 0,12 |
| 7,125 % fällig am 15.03.2026 | | 3.758 | | 3.482 | 0,03 |
| **Organon & Co.** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 30.04.2028 | € | 44.200 | | 38.835 | 0,39 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | | | |
| 1,367 % fällig am 10.03.2023 | $ | 21.170 | | 20.853 | 0,21 |
| 2,100 % fällig am 01.08.2027 | | 300 | | 252 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.02.2031 | | 1.300 | | 996 | 0,01 |
| 2,950 % fällig am 01.03.2026 ^ | | 600 | | 546 | 0,01 |
| 3,150 % fällig am 01.01.2026 | | 9.000 | | 8.253 | 0,08 |
| 3,250 % fällig am 15.06.2023 ^ | | 700 | | 690 | 0,01 |
| 3,300 % fällig am 15.03.2027 | | 3.300 | | 2.959 | 0,03 |
| 3,300 % fällig am 01.12.2027 ^ | | 3.000 | | 2.622 | 0,03 |
| 3,300 % fällig am 01.08.2040 ^ | | 27.600 | | 19.070 | 0,19 |
| 3,400 % fällig am 15.08.2024 ^ | | 2.000 | | 1.924 | 0,02 |
| 3,450 % fällig am 01.07.2025 | | 2.350 | | 2.212 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 15.06.2025 ^ | | 2.100 | | 1.991 | 0,02 |
| 3,750 % fällig am 15.02.2024 ^ | | 1.000 | | 978 | 0,01 |
| 3,750 % fällig am 01.07.2028 | | 2.450 | | 2.165 | 0,02 |
| 3,950 % fällig am 01.12.2047 ^ | | 800 | | 555 | 0,01 |
| 4,200 % fällig am 01.06.2041 | | 1.100 | | 807 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 01.08.2023 | | 1.800 | | 1.791 | 0,02 |
| 4,250 % fällig am 15.03.2046 ^ | | 2.000 | | 1.464 | 0,01 |
| 4,450 % fällig am 15.04.2042 ^ | | 3.800 | | 2.860 | 0,03 |
| 4,500 % fällig am 01.07.2040 | | 10.096 | | 7.840 | 0,08 |
| 4,550 % fällig am 01.07.2030 | | 6.400 | | 5.693 | 0,06 |
| 4,600 % fällig am 15.06.2043 ^ | | 3.900 | | 2.982 | 0,03 |
| 4,650 % fällig am 01.08.2028 | | 100 | | 93 | 0,00 |
| **Piper Sandler Cos.** | | | | | |
| 5,200 % fällig am 15.10.2023 | | 4.300 | | 4.241 | 0,04 |
| **Plains All American Pipeline LP** | | | | | |
| 5,150 % fällig am 01.06.2042 | | 13.077 | | 11.007 | 0,11 |
| 6,650 % fällig am 15.01.2037 | | 7.190 | | 7.188 | 0,07 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | | | |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | | 15.402 | | 15.976 | 0,16 |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027 | | 1.819 | | 1.939 | 0,02 |
| **RLJ Lodging Trust LP** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.07.2026 | | 2.700 | | 2.345 | 0,02 |
| **Rockies Express Pipeline LLC** | | | | | |
| 3,600 % fällig am 15.05.2025 | | 100 | | 91 | 0,00 |
| 4,800 % fällig am 15.05.2030 | | 15.300 | | 12.764 | 0,13 |
| 4,950 % fällig am 15.07.2029 | | 5.300 | | 4.541 | 0,04 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.03.2025 | | 53.725 | | 54.859 | 0,54 |
| **San Diego Gas & Electric Co.** | | | | | |
| 3,320 % fällig am 15.04.2050 | | 1.100 | | 860 | 0,01 |
| **Santander Holdings USA, Inc.** | | | | | |
| 3,450 % fällig am 02.06.2025 | | 8.500 | | 8.182 | 0,08 |
| **Spirit Airlines Pass-Through Trust** | | | | | |
| 4,100 % fällig am 01.10.2029 | | 318 | | 305 | 0,00 |
| **Sprint Corp.** | | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.06.2024 | | 800 | | 823 | 0,01 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2023 | | 4.000 | | 4.136 | 0,04 |
| **Sprint Spectrum Co. LLC** | | | | | |
| 5,152 % fällig am 20.09.2029 | | 3.300 | | 3.329 | 0,03 |
| **Standard Industries, Inc.** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 21.11.2026 | € | 40.700 | | 33.417 | 0,33 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2028 | $ | 3.750 | | 3.217 | 0,03 |
| **Synchrony Financial** | | | | | |
| 5,150 % fällig am 19.03.2029 | | 300 | | 281 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Tallgrass Energy Partners LP** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2028 | $ | 3.700 | $ | 3.151 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 31.12.2030 | | 7.850 | | 6.526 | 0,06 |
| **Tennessee Gas Pipeline Co. LLC** | | | | | |
| 8,375 % fällig am 15.06.2032 | | 1.451 | | 1.708 | 0,02 |
| **Time Warner Cable LLC** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.09.2042 | | 1.200 | | 939 | 0,01 |
| 6,750 % fällig am 15.06.2039 | | 1.800 | | 1.793 | 0,02 |
| **Toll Brothers Finance Corp.** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.03.2027 | | 10.200 | | 9.661 | 0,10 |
| **U.S. Airways Pass-Through Trust** | | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.05.2027 | | 2.286 | | 2.084 | 0,02 |
| **United Airlines Pass-Through Trust** | | | | | |
| 2,700 % fällig am 01.11.2033 | | 1.001 | | 857 | 0,01 |
| 2,900 % fällig am 01.11.2029 | | 2.442 | | 2.150 | 0,02 |
| 3,100 % fällig am 07.01.2030 | | 763 | | 698 | 0,01 |
| 3,450 % fällig am 01.06.2029 | | 852 | | 795 | 0,01 |
| 3,450 % fällig am 07.01.2030 | | 1.525 | | 1.325 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 01.09.2031 | | 1.288 | | 1.180 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 11.10.2027 | | 616 | | 580 | 0,01 |
| 4,150 % fällig am 11.10.2025 | | 2.143 | | 2.105 | 0,02 |
| 4,150 % fällig am 25.02.2033 | | 319 | | 300 | 0,00 |
| 5,875 % fällig am 15.04.2029 | | 35.229 | | 34.675 | 0,34 |
| **VICI Properties LP** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.02.2025 | | 3.400 | | 3.186 | 0,03 |
| **VMware, Inc.** | | | | | |
| 4,700 % fällig am 15.05.2030 | | 4.200 | | 4.054 | 0,04 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | | |
| 1,741 % fällig am 04.05.2030 | € | 6.200 | | 5.770 | 0,06 |
| **Wynn Las Vegas LLC** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.05.2027 | $ | 700 | | 600 | 0,01 |
| **Wynn Resorts Finance LLC** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.10.2029 | | 10.000 | | 7.891 | 0,08 |
| | | | | 1.256.086 | 12,48 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | | |
| **Adient U.S. LLC** | | | | | |
| 4,916 % fällig am 10.04.2028 | | 5.346 | | 4.994 | 0,05 |
| **AmSurg Corp.** | | | | | |
| TBD % fällig am 30.04.2027 µ | | 215 | | 213 | 0,00 |
| TBD % fällig am 30.04.2027 | | 1.185 | | 1.170 | 0,01 |
| 13,000 % fällig am 30.04.2028 | | 2.812 | | 2.615 | 0,03 |
| **Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC** | | | | | |
| 3,845 % fällig am 01.12.2027 | | 30.338 | | 28.906 | 0,29 |
| **CenturyLink, Inc.** | | | | | |
| 3,916 % fällig am 15.03.2027 | | 37.492 | | 34.532 | 0,34 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | | |
| 3,420 % fällig am 01.02.2027 | | 51.081 | | 48.870 | 0,48 |
| **CommScope, Inc.** | | | | | |
| 4,916 % fällig am 06.04.2026 | | 778 | | 703 | 0,01 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | | |
| 3,374 % fällig am 22.06.2026 | | 28.723 | | 27.581 | 0,27 |
| **INEOS Finance PLC** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.04.2024 | € | 76.488 | | 76.541 | 0,76 |
| **INEOS Styrolution U.S. Holding LLC** | | | | | |
| 4,416 % fällig am 29.01.2026 | $ | 9.367 | | 8.860 | 0,09 |
| **Level 3 Financing, Inc.** | | | | | |
| 3,416 % fällig am 01.03.2027 | | 23.198 | | 21.555 | 0,21 |
| **Marriott Ownership Resorts, Inc.** | | | | | |
| 3,416 % fällig am 29.08.2025 | | 871 | | 832 | 0,01 |
| **Nielsen Finance LLC** | | | | | |
| 3,190 % fällig am 04.10.2023 | | 2.041 | | 2.032 | 0,02 |
| **Standard Industries, Inc.** | | | | | |
| 3,788 % fällig am 22.09.2028 | | 11.307 | | 10.962 | 0,11 |
| **Summer (BC) Holdco B SARL** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 04.12.2026 | € | 5.000 | | 4.822 | 0,05 |
| | | | | 275.188 | 2,73 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Los Angeles County, California Public Works Financing Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | | | |
| 7,618 % fällig am 01.08.2040 | $ | 1.500 | | 1.963 | 0,02 |
| **Massachusetts Port Authority Revenue Bonds, Series 2011** | | | | | |
| 6,202 % fällig am 01.07.2031 | | 500 | | 537 | 0,01 |
| | | | | 2.500 | 0,03 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | | |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | | |
| 2,683 % fällig am 25.01.2036 ^ | $ | 81 | $ | 74 | 0,00 |
| 3,182 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 88 | | 66 | 0,00 |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | | | |
| 2,004 % fällig am 25.09.2046 ^ | | 544 | | 489 | 0,01 |
| 6,750 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 119 | | 104 | 0,00 |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | | | |
| 3,562 % fällig am 25.09.2045 | | 0 | | 0 | 0,00 |
| 3,836 % fällig am 25.12.2035 | | 726 | | 341 | 0,01 |
| **Angel Oak Mortgage Trust** | | | | | |
| 1,469 % fällig am 25.06.2065 | | 254 | | 243 | 0,00 |
| **Banc of America Alternative Loan Trust** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2046 ^ | | 106 | | 96 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2046 ^ | | 114 | | 100 | 0,00 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | | |
| 1,914 % fällig am 25.07.2037 | | 267 | | 248 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 66 | | 62 | 0,00 |
| 2,032 % fällig am 20.04.2047 ^ | | 271 | | 253 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 20.09.2035 ^ | | 98 | | 87 | 0,00 |
| 2,883 % fällig am 20.09.2047 ^ | | 85 | | 72 | 0,00 |
| 3,461 % fällig am 20.01.2047 ^ | | 259 | | 244 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2036 | | 86 | | 76 | 0,00 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | | | |
| 2,562 % fällig am 25.01.2035 | | 38 | | 37 | 0,00 |
| 2,733 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 3 | | 2 | 0,00 |
| 3,066 % fällig am 25.07.2035 ^ | | 7 | | 7 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 29 | | 25 | 0,00 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | | |
| 2,064 % fällig am 25.05.2047 ^ | | 203 | | 198 | 0,00 |
| 2,184 % fällig am 26.05.2037 | | 4.945 | | 4.281 | 0,04 |
| 2,924 % fällig am 25.09.2047 | | 61 | | 57 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 26.08.2036 | | 1.965 | | 1.063 | 0,01 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | | |
| 2,116 % fällig am 25.12.2046 ^ | | 76 | | 65 | 0,00 |
| 2,706 % fällig am 25.05.2034 ^ | | 21 | | 19 | 0,00 |
| 2,769 % fällig am 25.06.2035 ^ | | 7 | | 7 | 0,00 |
| 2,833 % fällig am 25.01.2035 | | 118 | | 114 | 0,00 |
| 2,876 % fällig am 25.10.2035 | | 29 | | 29 | 0,00 |
| 2,951 % fällig am 25.03.2035 | | 33 | | 31 | 0,00 |
| 2,961 % fällig am 25.01.2035 | | 2 | | 2 | 0,00 |
| 3,333 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 35 | | 33 | 0,00 |
| 3,440 % fällig am 25.07.2036 | | 20 | | 19 | 0,00 |
| 3,615 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 102 | | 96 | 0,00 |
| 3,820 % fällig am 25.07.2034 | | 26 | | 26 | 0,00 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.01.2047 ^ | | 141 | | 125 | 0,00 |
| 2,064 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 83 | | 125 | 0,00 |
| 2,599 % fällig am 25.07.2035 | | 10.000 | | 9.345 | 0,09 |
| 2,899 % fällig am 25.03.2036 | | 361 | | 230 | 0,00 |
| 3,074 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 68 | | 45 | 0,00 |
| 3,128 % fällig am 25.11.2036 | | 251 | | 165 | 0,00 |
| 3,237 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 478 | | 305 | 0,01 |
| 3,497 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 261 | | 150 | 0,00 |
| **Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust** | | | | | |
| 3,490 % fällig am 26.01.2036 ^ | | 114 | | 95 | 0,00 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | | | |
| 2,224 % fällig am 25.02.2037 | | 46 | | 14 | 0,00 |
| 2,839 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 242 | | 211 | 0,00 |
| 3,057 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 219 | | 210 | 0,00 |
| 3,342 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 52 | | 50 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 58 | | 31 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 118 | | 69 | 0,00 |
| **ChaseFlex Trust** | | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.07.2037 | | 157 | | 148 | 0,00 |
| 6,300 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 62 | | 54 | 0,00 |
| **Citicorp Mortgage Securities Trust** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.09.2037 | | 29 | | 29 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,140 % fällig am 25.09.2037 | | 35 | | 35 | 0,00 |
| 2,360 % fällig am 25.03.2034 | | 3 | | 3 | 0,00 |
| 2,585 % fällig am 25.07.2046 ^ | | 173 | | 159 | 0,00 |
| 2,679 % fällig am 25.10.2046 ^ | | 69 | | 65 | 0,00 |
| 2,797 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 136 | | 125 | 0,00 |
| 3,207 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 2.903 | | 2.537 | 0,03 |
| 3,396 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 77 | | 70 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | | |
| 2,190 % fällig am 25.09.2035 | | 9 | | 9 | 0,00 |
| 2,192 % fällig am 25.02.2034 | | 17 | | 17 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 ^ | $ 48 | $ 43 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^ | 601 | 546 | 0,01 |
| **Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 ^ | 235 | 157 | 0,00 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | |
| 1,346 % fällig am 25.11.2036 | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,792 % fällig am 20.02.2047 ^ | 179 | 140 | 0,00 |
| 1,802 % fällig am 20.09.2046 | 165 | 158 | 0,00 |
| 1,822 % fällig am 20.07.2046 ^ | 69 | 53 | 0,00 |
| 1,904 % fällig am 25.08.2037 | 393 | 363 | 0,01 |
| 1,904 % fällig am 25.04.2047 | 4.482 | 3.929 | 0,04 |
| 1,956 % fällig am 25.01.2036 | 394 | 372 | 0,01 |
| 1,974 % fällig am 25.08.2036 ^ | 58 | 30 | 0,00 |
| 1,984 % fällig am 25.11.2036 | 37 | 41 | 0,00 |
| 2,004 % fällig am 25.07.2046 ^ | 48 | 46 | 0,00 |
| 2,004 % fällig am 25.09.2046 ^ | 220 | 210 | 0,00 |
| 2,032 % fällig am 20.03.2046 | 92 | 73 | 0,00 |
| 2,032 % fällig am 20.05.2046 ^ | 1.490 | 1.280 | 0,01 |
| 2,104 % fällig am 25.12.2046 ^ | 3.345 | 2.182 | 0,02 |
| 2,124 % fällig am 25.06.2035 | 79 | 69 | 0,00 |
| 2,124 % fällig am 25.04.2036 | 3.242 | 1.268 | 0,01 |
| 2,144 % fällig am 25.07.2035 | 60 | 54 | 0,00 |
| 2,244 % fällig am 25.08.2035 ^ | 93 | 81 | 0,00 |
| 2,272 % fällig am 20.11.2035 | 304 | 276 | 0,00 |
| 3,096 % fällig am 25.05.2036 | 199 | 181 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 25.06.2035 ^ | 258 | 215 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.02.2035 | 950 | 932 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | 1.795 | 1.192 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 ^ | 555 | 400 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.05.2036 ^ | 311 | 146 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.01.2035 | 215 | 207 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.07.2037 | 367 | 256 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2035 ^ | 4.348 | 2.437 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2036 ^ | 145 | 85 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2036 ^ | 366 | 197 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 ^ | 221 | 150 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 ^ | 561 | 510 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | 2.025 | 957 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 ^ | 496 | 229 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | 1.512 | 827 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | 197 | 104 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^ | 221 | 125 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | 41 | 25 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2047 ^ | 321 | 185 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.12.2036 ^ | 243 | 125 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2032 | 14 | 14 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2037 ^ | 9.174 | 4.392 | 0,05 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2037 ^ | 823 | 456 | 0,01 |
| 15,680 % fällig am 25.02.2036 | 310 | 285 | 0,00 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 1,436 % fällig am 25.04.2046 ^ | 752 | 265 | 0,00 |
| 2,124 % fällig am 25.03.2036 | 101 | 87 | 0,00 |
| 2,164 % fällig am 25.04.2046 | 7.110 | 2.268 | 0,02 |
| 2,177 % fällig am 20.10.2035 | 3 | 3 | 0,00 |
| 2,304 % fällig am 25.03.2035 ^ | 51 | 45 | 0,00 |
| 2,334 % fällig am 25.10.2035 ^ | 226 | 189 | 0,00 |
| 2,733 % fällig am 25.09.2037 ^ | 38 | 35 | 0,00 |
| 2,920 % fällig am 25.09.2047 ^ | 5 | 4 | 0,00 |
| 2,968 % fällig am 20.12.2035 | 31 | 28 | 0,00 |
| 3,044 % fällig am 25.03.2037 ^ | 58 | 51 | 0,00 |
| 3,059 % fällig am 20.11.2035 ^ | 89 | 74 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.10.2034 | 426 | 405 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 ^ | 129 | 124 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.10.2035 | 50 | 34 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 ^ | 120 | 66 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | 542 | 418 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 ^ | 33 | 18 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.09.2037 ^ | 27 | 17 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.09.2036 ^ | 625 | 301 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2036 ^ | 167 | 77 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | |
| 2,857 % fällig am 25.06.2033 | 10 | 10 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2036 ^ | 257 | 170 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.04.2033 | 0 | 0 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | |
| 3,281 % fällig am 28.04.2037 | 187 | 183 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | 785 | 472 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | 176 | 81 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.02.2022 ^ | 616 | 83 | 0,00 |
| 6,750 % fällig am 25.08.2036 ^ | 657 | 431 | 0,01 |
| 7,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | 625 | 385 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Credit Suisse Mortgage Capital Trust** | | | |
| 3,626 % fällig am 25.10.2043 | $ 1.021 | $ 1.001 | 0,01 |
| **Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,944 % fällig am 25.01.2047 | 0 | 4 | 0,00 |
| 2,004 % fällig am 25.08.2047 | 102 | 92 | 0,00 |
| **Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.** | | | |
| 1,396 % fällig am 27.11.2036 | 102 | 100 | 0,00 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | |
| 3,162 % fällig am 25.06.2036 ^ | 51 | 44 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.08.2037 ^ | 66 | 33 | 0,00 |
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 2,612 % fällig am 25.09.2035 | 298 | 287 | 0,00 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | |
| 2,024 % fällig am 25.10.2046 ^ | 191 | 180 | 0,00 |
| 2,164 % fällig am 25.04.2036 ^ | 91 | 86 | 0,00 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,964 % fällig am 25.12.2034 | 6 | 5 | 0,00 |
| 2,654 % fällig am 25.04.2035 | 17 | 16 | 0,00 |
| 2,736 % fällig am 25.03.2047 ^ | 277 | 194 | 0,00 |
| 2,867 % fällig am 25.01.2036 ^ | 12 | 12 | 0,00 |
| 2,933 % fällig am 25.09.2035 | 60 | 59 | 0,00 |
| 3,049 % fällig am 25.11.2035 | 50 | 50 | 0,00 |
| 3,760 % fällig am 25.04.2032 | 27 | 23 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 | 172 | 158 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2036 ^ | 42 | 40 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.01.2037 ^ | 99 | 73 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2036 ^ | 366 | 202 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2036 ^ | 256 | 140 | 0,00 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,092 % fällig am 19.06.2035 | 284 | 271 | 0,00 |
| 2,152 % fällig am 19.03.2035 | 23 | 23 | 0,00 |
| 2,232 % fällig am 19.11.2035 | 203 | 166 | 0,00 |
| 2,312 % fällig am 19.01.2035 | 244 | 217 | 0,00 |
| 2,739 % fällig am 19.07.2035 ^ | 3 | 3 | 0,00 |
| 3,154 % fällig am 19.08.2036 ^ | 53 | 48 | 0,00 |
| 3,401 % fällig am 19.08.2036 ^ | 1 | 1 | 0,00 |
| 3,913 % fällig am 19.06.2036 ^ | 184 | 95 | 0,00 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | |
| 1,984 % fällig am 25.12.2036 | 74 | 73 | 0,00 |
| 2,124 % fällig am 25.03.2035 | 115 | 99 | 0,00 |
| 2,144 % fällig am 25.01.2036 | 150 | 145 | 0,00 |
| 2,164 % fällig am 25.10.2035 | 18 | 18 | 0,00 |
| 2,284 % fällig am 25.10.2035 | 25 | 25 | 0,00 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | |
| 2,064 % fällig am 25.11.2035 | 1.314 | 1.223 | 0,01 |
| **Impac Secured Assets Trust** | | | |
| 1,734 % fällig am 25.05.2037 ^ | 47 | 42 | 0,00 |
| 1,944 % fällig am 25.03.2037 ^ | 14 | 14 | 0,00 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,984 % fällig am 25.07.2047 | 190 | 138 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.06.2046 | 606 | 533 | 0,01 |
| 2,044 % fällig am 25.07.2036 | 5.983 | 5.678 | 0,06 |
| 2,104 % fällig am 25.07.2035 | 6 | 6 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.07.2035 | 142 | 122 | 0,00 |
| 2,552 % fällig am 25.11.2035 ^ | 32 | 25 | 0,00 |
| 2,796 % fällig am 25.11.2035 ^ | 491 | 429 | 0,01 |
| 2,804 % fällig am 25.10.2034 | 251 | 244 | 0,00 |
| 2,810 % fällig am 25.06.2037 ^ | 46 | 39 | 0,00 |
| 2,938 % fällig am 25.12.2036 ^ | 64 | 57 | 0,00 |
| 2,941 % fällig am 25.05.2037 ^ | 148 | 133 | 0,00 |
| 2,985 % fällig am 25.08.2035 | 671 | 560 | 0,01 |
| 3,049 % fällig am 25.07.2037 | 49 | 34 | 0,00 |
| 3,080 % fällig am 25.06.2036 | 121 | 111 | 0,00 |
| 3,280 % fällig am 25.06.2035 ^ | 171 | 157 | 0,00 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | |
| 1,944 % fällig am 25.10.2036 | 960 | 897 | 0,01 |
| 3,048 % fällig am 25.05.2036 ^ | 179 | 117 | 0,00 |
| 3,330 % fällig am 25.05.2037 ^ | 203 | 179 | 0,00 |
| 5,843 % fällig am 26.05.2037 | 1.813 | 1.551 | 0,02 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | |
| 2,358 % fällig am 25.04.2035 | 8 | 9 | 0,00 |
| 2,680 % fällig am 25.11.2035 ^ | 115 | 105 | 0,00 |
| 2,749 % fällig am 25.10.2035 ^ | 151 | 131 | 0,00 |
| 2,991 % fällig am 25.10.2036 ^ | 305 | 246 | 0,00 |
| 3,045 % fällig am 25.08.2035 | 37 | 36 | 0,00 |
| 3,065 % fällig am 25.07.2035 | 13 | 13 | 0,00 |
| 3,084 % fällig am 25.06.2037 ^ | 230 | 180 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2036 ^ | 97 | 56 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.07.2036 ^ | 242 | 126 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Lehman XS Trust** | | | |
| 1,906 % fällig am 25.08.2047 ^ | $ 460 | $ 417 | 0,01 |
| 1,984 % fällig am 25.12.2036 | 2.338 | 2.316 | 0,03 |
| 2,084 % fällig am 25.04.2046 ^ | 9 | 11 | 0,00 |
| 2,104 % fällig am 25.09.2046 ^ | 11 | 13 | 0,00 |
| 2,144 % fällig am 25.02.2046 ^ | 209 | 179 | 0,00 |
| 3,324 % fällig am 25.10.2037 | 2.409 | 2.593 | 0,03 |
| **Luminent Mortgage Trust** | | | |
| 2,024 % fällig am 25.10.2046 | 969 | 883 | 0,01 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | |
| 2,224 % fällig am 25.05.2047 ^ | 5 | 5 | 0,00 |
| 3,052 % fällig am 21.11.2034 | 58 | 55 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust** | | | |
| 1,844 % fällig am 25.03.2037 | 232 | 73 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | |
| 2,079 % fällig am 25.02.2036 | 21 | 20 | 0,00 |
| 2,084 % fällig am 25.04.2029 | 16 | 15 | 0,00 |
| 2,284 % fällig am 25.11.2029 | 3 | 3 | 0,00 |
| 2,596 % fällig am 25.11.2035 | 105 | 102 | 0,00 |
| 2,606 % fällig am 25.03.2036 ^ | 353 | 206 | 0,00 |
| 3,235 % fällig am 25.05.2036 | 165 | 151 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,731 % fällig am 25.04.2037 ^ | 22 | 21 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust** | | | |
| 1,021 % fällig am 15.12.2048 (a) | 21.552 | 62 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,884 % fällig am 25.03.2036 | 58 | 40 | 0,00 |
| 1,944 % fällig am 25.01.2035 | 19 | 17 | 0,00 |
| 2,221 % fällig am 25.06.2036 | 30 | 30 | 0,00 |
| 2,535 % fällig am 25.06.2036 | 3 | 3 | 0,00 |
| 3,052 % fällig am 25.05.2036 ^ | 413 | 284 | 0,00 |
| 3,384 % fällig am 25.09.2035 ^ | 150 | 60 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2037 ^ | 1.122 | 738 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Re-REMIC Trust** | | | |
| 0,648 % fällig am 26.02.2037 | 111 | 106 | 0,00 |
| 1,781 % fällig am 26.03.2037 | 82 | 80 | 0,00 |
| **New Residential Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,500 % fällig am 25.12.2057 | 1.894 | 1.853 | 0,02 |
| **Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust** | | | |
| 3,058 % fällig am 25.08.2035 | 32 | 32 | 0,00 |
| **Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,184 % fällig am 25.12.2035 | 330 | 313 | 0,01 |
| 3,649 % fällig am 25.02.2035 | 516 | 519 | 0,01 |
| **Prime Mortgage Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 ^ | 32 | 30 | 0,00 |
| **RBSGC Structured Trust** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | 82 | 72 | 0,00 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | |
| 1,774 % fällig am 25.02.2047 | 740 | 311 | 0,01 |
| 1,824 % fällig am 25.05.2037 | 357 | 341 | 0,01 |
| 1,884 % fällig am 25.02.2037 | 80 | 100 | 0,00 |
| 1,904 % fällig am 25.01.2037 | 172 | 174 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.02.2037 | 259 | 238 | 0,00 |
| 1,974 % fällig am 25.08.2035 ^ | 457 | 385 | 0,01 |
| 2,004 % fällig am 25.08.2036 ^ | 133 | 129 | 0,00 |
| 2,004 % fällig am 25.09.2036 ^ | 508 | 484 | 0,01 |
| 2,024 % fällig am 25.11.2036 ^ | 158 | 117 | 0,00 |
| 2,054 % fällig am 25.05.2046 | 624 | 543 | 0,01 |
| 3,364 % fällig am 25.02.2035 ^ | 55 | 47 | 0,00 |
| 3,490 % fällig am 25.08.2035 | 1.132 | 1.066 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.03.2037 ^ | 80 | 68 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.09.2035 ^ | 79 | 33 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 ^ | 400 | 346 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 ^ | 909 | 770 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 25.03.2037 ^ | 182 | 151 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.07.2037 ^ | 253 | 219 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2037 ^ | 249 | 215 | 0,00 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 ^ | 85 | 49 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 ^ | 210 | 121 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.04.2037 ^ | 1.214 | 409 | 0,01 |
| **Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 ^ | 116 | 103 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^ | 72 | 64 | 0,00 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | |
| 2,224 % fällig am 20.01.2047 ^ | 4 | 3 | 0,00 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,944 % fällig am 25.10.2035 | 74 | 69 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| 2,064 % fällig am 25.06.2037 | $ 125 | $ 114 | 0,00 |
| 2,808 % fällig am 25.02.2035 | 191 | 184 | 0,00 |
| 2,853 % fällig am 25.09.2035 | 81 | 75 | 0,00 |
| 2,911 % fällig am 25.11.2035 ^ | 24 | 22 | 0,00 |
| 2,999 % fällig am 25.11.2036 ^ | 368 | 324 | 0,01 |
| 3,011 % fällig am 25.09.2035 | 22 | 18 | 0,00 |
| 3,051 % fällig am 25.04.2035 | 10 | 10 | 0,00 |
| 3,090 % fällig am 25.10.2036 ^ | 83 | 55 | 0,00 |
| 3,586 % fällig am 25.10.2037 ^ | 74 | 69 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | |
| 1,804 % fällig am 25.09.2047 | 41 | 39 | 0,00 |
| 1,814 % fällig am 25.09.2047 | 666 | 618 | 0,01 |
| 1,984 % fällig am 25.07.2046 | 151 | 130 | 0,00 |
| 2,004 % fällig am 25.06.2036 | 51 | 50 | 0,00 |
| 2,044 % fällig am 25.04.2036 | 43 | 38 | 0,00 |
| 2,044 % fällig am 25.05.2036 | 33 | 27 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.08.2036 ^ | 490 | 450 | 0,01 |
| 2,255 % fällig am 19.10.2034 | 31 | 30 | 0,00 |
| 2,295 % fällig am 19.03.2034 | 4 | 4 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates** | | | |
| 3,394 % fällig am 25.06.2033 | 5 | 5 | 0,00 |
| **SunTrust Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,274 % fällig am 25.12.2035 ^ | 172 | 148 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.12.2035 ^ | 198 | 177 | 0,00 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | |
| 2,140 % fällig am 25.09.2037 | 24 | 23 | 0,00 |
| **Towd Point Mortgage Trust** | | | |
| 2,750 % fällig am 25.06.2057 | 753 | 736 | 0,01 |
| **Wachovia Mortgage Loan Trust LLC** | | | |
| 2,289 % fällig am 20.10.2035 ^ | 40 | 39 | 0,00 |
| 2,774 % fällig am 20.03.2037 ^ | 17 | 16 | 0,00 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 1,134 % fällig am 25.12.2046 | 55 | 50 | 0,00 |
| 1,286 % fällig am 25.07.2047 | 469 | 395 | 0,01 |
| 1,372 % fällig am 25.05.2046 | 70 | 64 | 0,00 |
| 1,473 % fällig am 27.02.2034 | 146 | 142 | 0,00 |
| 1,476 % fällig am 25.08.2046 | 289 | 279 | 0,00 |
| 1,676 % fällig am 25.11.2042 | 5 | 4 | 0,00 |
| 1,723 % fällig am 25.10.2046 | 20 | 18 | 0,00 |
| 1,876 % fällig am 25.04.2044 | 2 | 2 | 0,00 |
| 2,204 % fällig am 25.10.2045 | 31 | 30 | 0,00 |
| 2,264 % fällig am 25.01.2045 | 330 | 314 | 0,01 |
| 2,364 % fällig am 25.11.2034 | 317 | 295 | 0,00 |
| 2,464 % fällig am 25.06.2044 | 276 | 260 | 0,00 |
| 2,550 % fällig am 25.01.2037 ^ | 14 | 13 | 0,00 |
| 2,614 % fällig am 25.02.2033 | 11 | 11 | 0,00 |
| 2,713 % fällig am 25.12.2036 ^ | 9 | 8 | 0,00 |
| 2,716 % fällig am 25.12.2035 | 72 | 70 | 0,00 |
| 2,742 % fällig am 25.04.2037 ^ | 9 | 9 | 0,00 |
| 2,781 % fällig am 25.08.2036 ^ | 51 | 49 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| 2,856 % fällig am 25.09.2036 ^ | 123 | 113 | 0,00 |
| 2,978 % fällig am 25.04.2035 | 13 | 12 | 0,00 |
| 3,087 % fällig am 25.03.2036 | $ 119 | $ 114 | 0,00 |
| 3,107 % fällig am 25.07.2037 ^ | 517 | 494 | 0,01 |
| 3,125 % fällig am 25.02.2037 ^ | 31 | 29 | 0,00 |
| 3,196 % fällig am 25.12.2036 ^ | 25 | 23 | 0,00 |
| 3,220 % fällig am 25.06.2033 | 33 | 32 | 0,00 |
| 3,331 % fällig am 25.10.2036 ^ | 295 | 271 | 0,00 |
| 3,340 % fällig am 25.05.2037 ^ | 15 | 13 | 0,00 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 1,944 % fällig am 25.02.2037 ^ | 619 | 534 | 0,01 |
| 2,074 % fällig am 25.05.2035 ^ | 234 | 200 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.07.2035 ^ | 472 | 441 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | 126 | 118 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^ | 501 | 480 | 0,01 |
| **Wells Fargo Alternative Loan Trust** | | | |
| 5,750 % fällig am 25.07.2037 ^ | 57 | 53 | 0,00 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,751 % fällig am 25.12.2036 ^ | 73 | 71 | 0,00 |
| 2,756 % fällig am 25.04.2036 ^ | 169 | 161 | 0,00 |
| 2,879 % fällig am 25.11.2037 ^ | 82 | 78 | 0,00 |
| 2,936 % fällig am 25.04.2036 ^ | 9 | 8 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^ | 2.276 | 2.038 | 0,02 |
| | | 101.142 | 1,01 |
| Summe USA | | 1.874.630 | 18,63 |
| **VENEZUELA** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Petroleos de Venezuela S.A.** | | | |
| 6,000 % fällig am 16.05.2024 ^ | 8.400 | 527 | 0,01 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Venezuela Government International Bond** | | | |
| 6,000 % fällig am 09.12.2020 ^ | 2.651 | 205 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 31.03.2038 ^ | 16.792 | 1.469 | 0,01 |
| 9,250 % fällig am 07.05.2028 ^ | 7.813 | 684 | 0,01 |
| | | 2.358 | 0,02 |
| Summe Venezuela | | 2.885 | 0,03 |
| **JUNGFERNINSELN (BRITISCH)** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Champion Path Holdings Ltd.** | | | |
| 4,500 % fällig am 27.01.2026 | 6.200 | 3.937 | 0,04 |
| 4,850 % fällig am 27.01.2028 | 200 | 118 | 0,00 |
| Summe Jungferninseln (Britisch) | | 4.055 | 0,04 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | |
| **Pacific Gas and Electric Co.** | | | |
| 2,370 % fällig am 14.11.2022 | 5.200 | 5.179 | 0,05 |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | |
| 51,049 % fällig am 30.09.2022 (f)(g) | ARS 7.700 | $ 26 | 0,00 |
| **U.S. TREASURY BILLS** | | | |
| 0,900 % fällig am 28.07.2022 (f)(g) | $ 7.600 | 7.594 | 0,07 |
| 1,416 % fällig am 04.10.2022 (f)(g)(l) | 196.200 | 195.268 | 1,94 |
| | | 202.862 | 2,01 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 208.067 | 2,06 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | **$ 7.621.324** | **75,69** |
| | **AKTIEN** | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (i)** | 3.488.745 | 29.619 | 0,30 |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (i)** | 7.821.400 | 66.795 | 0,66 |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (i)** | 3.637.652 | 35.558 | 0,35 |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (i)** | 32.153.590 | 319.928 | 3,17 |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (i)** | 7.203.954 | 71.665 | 0,71 |
| | | 523.565 | 5,19 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (i)** | 4.920.440 | 486.863 | 4,84 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$1.010.428** | **10,03** |

**PENSIONSGESCHÄFTE**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 1,470 % | 28.06.2022 | 05.07.2022 | $ 350.000 | U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.08.2048 | $ (362.411) | $ 350.000 | $ 350.014 | 3,48 |
| BRC | 1,450 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 250.000 | Fannie Mae 3,000 % fällig am 01.02.2050 | (56.734) | 250.000 | 250.010 | 2,48 |
| | | | | | Ginnie Mae 2,500 % fällig am 20.04.2050 | (203.338) | | | |
| FICC | 0,400 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 79.537 | U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | (81.129) | 79.537 | 79.537 | 0,79 |
| JPM | 1,420 | 27.06.2022 | 06.07.2022 | CAD 100.000 | Canada Government Bond 1,500 % - 2,750 % fällig am 01.04.2025 -01.12.2051 | (78.129) | 77.522 | 77.554 | 0,77 |
| MEI | 1,400 | 27.06.2022 | 06.07.2022 | 200.000 | Canada Treasury Bills 0,000 % fällig am 29.09.2022 | (158.253) | 155.045 | 155.114 | 1,54 |
| NOM | 1,480 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 33.000 | U.S. Treasury Bonds 4,375 % fällig am 15.05.2040 | (33.787) | 33.000 | 33.001 | 0,33 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (973.781)** | **$ 945.104** | **$ 945.230** | **9,39** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

### FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 156 | $ (48) | 0,00 |
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09.2022 | 173 | 356 | 0,00 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 3.746 | (3.073) | (0,03) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 16.214 | (20.567) | (0,20) |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Long | 09.2022 | 3.184 | (4.987) | (0,05) |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09.2022 | 4.361 | (19.695) | (0,20) |
| | | | | $ (48.014) | (0,48) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ (48.014)** | **(0,48)** |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 20.200 | $ 54 | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.06.2026 | 17.200 | (347) | 0,00 |
| Auchan Holding S.A. | 1,000 | 20.12.2027 | € 2.400 | (192) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.06.2023 | $ 700 | (9) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.12.2023 | 1.300 | (25) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.12.2026 | 500 | (26) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.06.2027 | 200 | (9) | 0,00 |
| Casino Guichard Perrachon S.A. | 5,000 | 20.12.2022 | € 16.300 | 126 | 0,00 |
| Casino Guichard Perrachon S.A. | 5,000 | 20.06.2023 | 9.900 | (1.931) | (0,02) |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20.12.2023 | $ 3.700 | (584) | (0,01) |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.06.2025 | 800 | 0 | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.06.2026 | 800 | (7) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.06.2027 | 1.600 | (75) | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2024 | 14.300 | 358 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2026 | 37.500 | (915) | (0,01) |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2026 | 4.300 | (171) | 0,00 |
| General Motors Co. | 5,000 | 20.06.2026 | 4.200 | (403) | 0,00 |
| Glencore Finance Europe Ltd. | 5,000 | 20.12.2025 | € 38.900 | (4.505) | (0,04) |
| Glencore Finance Europe Ltd. | 5,000 | 20.12.2027 | 26.000 | (4.044) | (0,04) |
| Marks & Spencer PLC | 1,000 | 20.12.2024 | 20.600 | 201 | 0,00 |
| Marks & Spencer PLC | 1,000 | 20.06.2027 | 2.862 | (144) | 0,00 |
| Marks & Spencer PLC | 1,000 | 20.12.2028 | 14.000 | (1.561) | (0,02) |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.12.2024 | 40.600 | (2.130) | (0,02) |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 | 20.12.2026 | 20.800 | (1.116) | (0,01) |
| | | | | $ (17.455) | (0,17) |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-34 5-Year Index | 1,000 % | 20.12.2025 | $ 446.725 | $ (41.268) | (0,41) |
| CDX.EM-35 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2026 | 4.050 | (317) | 0,00 |
| CDX.EM-36 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 768.125 | (70.241) | (0,70) |
| CDX.IG-37 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 40.400 | (572) | (0,01) |
| CDX.IG-38 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 1.002.400 | (12.108) | (0,12) |
| iTraxx Crossover 37 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2027 | € 517.400 | (43.575) | (0,43) |
| iTraxx Europe Main 36 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 35.100 | (241) | 0,00 |
| iTraxx Europe Main 37 10-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 61.100 | (772) | (0,01) |
| | | | | $ (169.094) | (1,68) |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 % | 16.09.2025 | £ 21.100 | $ 1.676 | 0,01 |
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 | 21.09.2027 | 48.900 | 1.696 | 0,02 |
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2032 | 6.500 | 512 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,050 | 15.12.2031 | ¥ 73.000 | 4 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,400 | 15.06.2032 | 20.350.000 | 685 | 0,01 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,040 | 25.05.2032 | $ 65.700 | (3.663) | (0,04) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,153 | 18.05.2032 | 68.200 | (3.109) | (0,03) |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 0,880 % | 03.03.2024 | CAD 273.400 | $ (9.233) | (0,09) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,500 | 19.06.2029 | 91.700 | (7.913) | (0,08) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2052 | € 68.900 | 15.734 | 0,15 |
| | | | | | $ (3.611) | (0,04) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (190.160)** | **(1,89)** |

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

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

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

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

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

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 % | 20.07.2022 | 20.100 | $ (30) | $ (15) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Crossover 36 5-Year Index | Verkauf | 5,250 | 20.07.2022 | 12.800 | (133) | (254) | (0,01) |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 67.100 | (338) | (145) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 59.000 | (168) | (193) | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 18.500 | (34) | (8) | 0,00 |
| | Call - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Kauf | 0,700 | 17.08.2022 | 22.200 | (29) | (3) | 0,00 |
| BRC | Put - OTC CDX.IG-37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 30.300 | (71) | (12) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 9.000 | (82) | (101) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 74.500 | (355) | (161) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,600 | 17.08.2022 | 12.900 | (31) | (23) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 8.600 | (13) | (6) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 18.100 | (35) | (21) | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,300 | 17.08.2022 | 22.600 | (51) | (36) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 95,000 | 17.08.2022 | 5.300 | (64) | (81) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 20.600 | (183) | (230) | (0,01) |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,100 | 20.07.2022 | 37.000 | (140) | (141) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 18.400 | (56) | (69) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,250 | 20.07.2022 | 13.500 | (22) | (7) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,350 | 17.08.2022 | 18.700 | (43) | (25) | 0,00 |
| | | | | | | $ (1.878) | $ (1.531) | (0,02) |

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,000 % | 01.07.2022 | 141.100 | $ (639) | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,800 | 01.07.2022 | 141.100 | (638) | (189) | 0,00 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,840 | 05.07.2022 | 126.300 | (487) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 1,520 | 05.07.2022 | 126.300 | (487) | (1.895) | (0,02) |
| | | | | | | | $ (2.251) | $ (2.084) | (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 | Nenn-betrag[2] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2031 | $ 61.600 | $ (2.646) | $ (1.627) | $ (4.273) | (0,04) |
| | Intrum AB | 5,000 | 20.12.2024 | € 1.200 | 113 | (110) | 3 | 0,00 |
| FBF | Intrum AB | 5,000 | 20.12.2024 | 6.400 | 599 | (581) | 18 | 0,00 |
| GST | ADLER Real Estate AG | 5,000 | 20.12.2026 | 7.400 | (47) | (2.439) | (2.486) | (0,02) |
| | Intrum AB | 5,000 | 20.12.2024 | 41.200 | 4.386 | (4.273) | 113 | 0,00 |
| JPM | Casino Guichard Perrachon S.A. | 5,000 | 20.12.2022 | 2.900 | 120 | (287) | (167) | 0,00 |
| | Hochtief AG | 5,000 | 20.12.2026 | 36.200 | 8.616 | (5.277) | 3.339 | 0,03 |
| | Intrum AB | 5,000 | 20.12.2024 | 1.000 | 92 | (89) | 3 | 0,00 |
| MYC | Intrum AB | 5,000 | 20.12.2024 | 6.400 | 650 | (632) | 18 | 0,00 |
| MYI | Intrum AB | 5,000 | 20.12.2024 | 8.200 | 893 | (871) | 22 | 0,00 |
| | | | | | $ 12.776 | $ (16.186) | $ (3.410) | (0,03) |

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

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

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | $ | 1.946 | € | 1.840 | $ 0 | $ (23) | $ (23) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.857 | £ | 1.521 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 16.505 | ZAR | 253.247 | 0 | (1.059) | (1.059) | (0,01) |
| | 08.2022 | IDR | 2.291.866 | $ | 156 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | SGD | 520 | | 373 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 6.044 | | 381 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | AUD | 628 | | 434 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | BRL | 21.665 | | 4.521 | 378 | 0 | 378 | 0,00 |
| | 07.2022 | CAD | 7.054 | | 5.544 | 80 | (5) | 75 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 451.400 | | 3.493 | 171 | 0 | 171 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 14.360 | BRL | 69.591 | 0 | (1.052) | (1.052) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 2.469 | CAD | 3.199 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 152.083 | € | 144.046 | 0 | (1.491) | (1.491) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 2.475 | £ | 2.007 | 0 | (38) | (38) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.328 | ¥ | 312.700 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.004 | ZAR | 15.720 | 0 | (45) | (45) | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 936.870.627 | $ | 64.416 | 1.845 | 0 | 1.845 | 0,02 |
| | 08.2022 | INR | 19.085 | | 245 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | MXN | 208.771 | | 9.504 | 0 | (778) | (778) | (0,01) |
| | 08.2022 | ZAR | 24.173 | | 1.518 | 49 | 0 | 49 | 0,00 |
| | 09.2022 | TWD | 1.207 | | 43 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 23.705 | | 1.474 | 46 | 0 | 46 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | NOK | 1.066.241 | | 108.763 | 841 | 0 | 841 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 3.574 | £ | 2.850 | 0 | (113) | (113) | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 6.731.880 | $ | 455 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 108.763 | NOK | 1.065.773 | 0 | (833) | (833) | (0,01) |
| CBK | 07.2022 | € | 46.025 | $ | 49.416 | 1.299 | 0 | 1.299 | 0,01 |
| | 07.2022 | MXN | 55.187 | | 2.669 | 0 | (66) | (66) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 46.394 | BRL | 225.195 | 0 | (3.331) | (3.331) | (0,03) |
| | 07.2022 | | 1.179 | £ | 939 | 0 | (38) | (38) | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | | 721 | PLN | 3.147 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 12.2022 | | 22.255 | ZAR | 349.673 | 0 | (1.252) | (1.252) | (0,01) |
| GLM | 07.2022 | BRL | 273.121 | $ | 52.696 | 468 | 0 | 468 | 0,00 |
| | 07.2022 | CAD | 150.000 | | 116.081 | 0 | (203) | (203) | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 75.112 | | 3.678 | 0 | (39) | (39) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2.670 | MXN | 55.198 | 66 | 0 | 66 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 52.278 | BRL | 273.121 | 0 | (501) | (501) | (0,01) |
| | 10.2022 | | 7.102 | MXN | 145.374 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 6.400 | $ | 399 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | CAD | 150.000 | | 116.048 | 0 | (236) | (236) | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 75.398 | | 11.212 | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| | 08.2022 | KRW | 311.544 | | 245 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08.2022 | SGD | 480 | | 349 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 515 | | 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 44.819 | IDR | 659.279.739 | 0 | (787) | (787) | (0,01) |
| | 09.2022 | TWD | 1.430 | $ | 51 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | AUD | 169.280 | | 117.050 | 645 | 0 | 645 | 0,01 |
| | 07.2022 | CAD | 4.611 | | 3.652 | 78 | 0 | 78 | 0,00 |
| | 07.2022 | NOK | 62.515 | | 6.683 | 355 | 0 | 355 | 0,00 |
| | 07.2022 | SEK | 2.195 | | 225 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 46.931 | € | 45.101 | 220 | 0 | 220 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 29.505 | £ | 23.416 | 0 | (1.067) | (1.067) | (0,01) |
| | 08.2022 | CNH | 171.511 | $ | 25.541 | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 106.818 | AUD | 155.081 | 0 | (155) | (155) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 6.361 | CNH | 42.586 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 19.781 | IDR | 290.025.459 | 0 | (411) | (411) | 0,00 |
| | 05.2023 | CNH | 189.447 | $ | 28.229 | 0 | (79) | (79) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | AUD | 3 | | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 806 | | 977 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | SGD | 64 | | 46 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2.491 | € | 2.373 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 7.744 | £ | 6.388 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 41 | SGD | 57 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 7.573.093 | $ | 513 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 08.2022 | INR | 32.053 | | 410 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08.2022 | KRW | 403.234 | | 317 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 219 | | 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 584 | | 21 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| RBC | 07.2022 | CAD | 1.296 | | 1.024 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | ¥ | 205.500 | | 1.522 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 6.889 | £ | 5.609 | 0 | (77) | (77) | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 304.238 | $ | 45.417 | 57 | 0 | 57 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08.2022 | $ | 1.564 | ZAR | 24.173 | $ 0 | $ (95) | $ (95) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 20.626 | | 318.869 | 0 | (1.298) | (1.298) | (0,01) |
| SOG | 07.2022 | | 501.069 | £ | 411.725 | 0 | (1.050) | (1.050) | (0,01) |
| | 08.2022 | £ | 411.725 | $ | 501.302 | 1.042 | 0 | 1.042 | 0,01 |
| TOR | 07.2022 | AUD | 212 | | 154 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 07.2022 | CAD | 3.661 | | 2.854 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 448.879 | | 565.911 | 20.770 | 0 | 20.770 | 0,21 |
| | 07.2022 | $ | 6.696 | CAD | 8.614 | 1 | (19) | (18) | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 8.615 | $ | 6.696 | 19 | (1) | 18 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | € | 3.196.358 | | 3.434.810 | 93.176 | 0 | 93.176 | 0,93 |
| | 07.2022 | $ | 121.514 | AUD | 170.120 | 0 | (4.532) | (4.532) | (0,05) |
| | 07.2022 | | 1.000 | £ | 819 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 119.742 | NOK | 1.129.098 | 0 | (5.458) | (5.458) | (0,05) |
| | 09.2022 | | 7.557 | MXN | 150.585 | 0 | (182) | (182) | 0,00 |
| | 11.2022 | | 3.001 | ZAR | 46.830 | 0 | (179) | (179) | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 14.150 | $ | 902 | 49 | 0 | 49 | 0,00 |
| | | | | | | $ 121.824 | $ (26.660) | $ 95.164 | 0,95 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Administrative AUD (Hedged) ausschüttend und M Retail AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | AUD | 12.223 | $ | 8.498 | $ 92 | $ 0 | $ 92 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 8.500 | AUD | 12.223 | 0 | (93) | (93) | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | AUD | 14.391 | $ | 9.992 | 96 | 0 | 96 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 13.886 | AUD | 19.287 | 0 | (623) | (623) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 9.980 | | 14.371 | 0 | (96) | (96) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | AUD | 767 | $ | 532 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | | 538 | | 370 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | | 5.119 | | 3.522 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 3.523 | AUD | 5.119 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | AUD | 520 | $ | 365 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 14.961 | AUD | 20.819 | 0 | (645) | (645) | (0,01) |
| SCX | 07.2022 | AUD | 12.481 | $ | 8.583 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2 | AUD | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 8.585 | | 12.481 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | AUD | 9.687 | $ | 6.666 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2 | AUD | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 6.668 | | 9.687 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | | 14.013 | | 19.618 | 0 | (522) | (522) | (0,01) |
| | | | | | | $ 208 | $ (1.987) | $ (1.779) | (0,02) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional CAD (Hedged) thesaurierend und Class W CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | CAD | 2.702 | $ | 2.154 | $ 59 | $ 0 | $ 59 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 129.905 | CAD | 164.860 | 0 | (2.102) | (2.102) | (0,02) |
| BPS | 07.2022 | CAD | 9.334 | $ | 7.221 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 10.783 | CAD | 13.674 | 0 | (183) | (183) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | | 147 | | 186 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| RBC | 07.2022 | CAD | 96.451 | $ | 75.018 | 247 | 0 | 247 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 75.018 | CAD | 96.458 | 0 | (245) | (245) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 130.948 | | 165.655 | 0 | (2.528) | (2.528) | (0,03) |
| TOR | 07.2022 | CAD | 127.089 | $ | 98.858 | 349 | (14) | 335 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 119.453 | CAD | 152.585 | 0 | (1.166) | (1.166) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 98.858 | | 127.097 | 15 | (347) | (332) | 0,00 |
| | | | | | | $ 670 | $ (6.603) | $ (5.933) | (0,06) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend, Class W CHF (Hedged) thesaurierend und Class W CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | CHF | 569 | $ | 571 | $ 0 | $ (23) | $ (23) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 16.265 | CHF | 15.543 | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CHF | 539 | $ | 557 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 230 | CHF | 221 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | | 16.239 | | 15.543 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | CHF | 14.358 | $ | 15.115 | 118 | 0 | 118 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 16.239 | CHF | 15.576 | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 15.115 | | 14.334 | 0 | (117) | (117) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | | 60 | | 57 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SCX | 07.2022 | CHF | 599 | $ | 620 | $ 0 | $ (5) | $ (5) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 25 | CHF | 25 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | CHF | 20 | $ | 20 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 150 | $ (184) | $ (34) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend, Class T EUR (Hedged) ausschüttend, Class W EUR (Hedged) thesaurierend und Class W EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | € | 6.659 | $ | 7.149 | $ 187 | $ 0 | $ 187 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 10.804 | € | 10.214 | 0 | (126) | (126) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | € | 1.614.634 | $ | 1.698.244 | 10.226 | 0 | 10.226 | 0,10 |
| | 07.2022 | $ | 16.534 | € | 15.565 | 0 | (261) | (261) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.458.663 | | 1.384.302 | 0 | (8.771) | (8.771) | (0,09) |
| CBK | 07.2022 | € | 4.312 | $ | 4.622 | 114 | 0 | 114 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | | 1.537.203 | | 1.616.678 | 9.924 | (314) | 9.610 | 0,09 |
| | 07.2022 | $ | 1.689.676 | € | 1.566.842 | 0 | (51.622) | (51.622) | (0,51) |
| | 08.2022 | | 1.458.934 | | 1.384.302 | 0 | (9.042) | (9.042) | (0,09) |
| SOG | 07.2022 | | 1.680.882 | | 1.563.890 | 0 | (45.914) | (45.914) | (0,46) |
| UAG | 07.2022 | | 1.461.824 | | 1.360.341 | 0 | (39.655) | (39.655) | (0,39) |
| | | | | | | $ 20.451 | $ (155.705) | $ (135.254) | (1,35) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Administrative GBP (Hedged) ausschüttend, Class W GBP (Hedged) thesaurierend und Class W GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | £ | 1.010 | $ | 1.234 | $ 7 | $ 0 | $ 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 676.678 | £ | 535.274 | 0 | (26.614) | (26.614) | (0,26) |
| BPS | 07.2022 | £ | 91.859 | $ | 112.102 | 629 | (85) | 544 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 2.342 | £ | 1.859 | 0 | (84) | (84) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | £ | 2.452 | $ | 3.013 | 36 | 0 | 36 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 662.837 | £ | 525.460 | 0 | (24.692) | (24.692) | (0,25) |
| CBK | 07.2022 | £ | 60 | $ | 75 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | | 436 | | 534 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 360 | £ | 288 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | | 40 | | 33 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | £ | 6.228 | $ | 7.649 | 85 | 0 | 85 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | | 474.230 | | 577.138 | 1.210 | 0 | 1.210 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 577.406 | £ | 474.230 | 0 | (1.201) | (1.201) | (0,01) |
| TOR | 07.2022 | | 656.196 | | 520.493 | 0 | (24.083 ) | (24.083) | (0,24) |
| | | | | | | $ 1.974 | $ (76.770) | $ (74.796) | (0,74) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Administrative 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | $ | 117 | ¥ | 14.907 | $ 0 | $ (7) | $ (7) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | ¥ | 191 | $ | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 118 | ¥ | 15.114 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | ¥ | 66.515 | $ | 490 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 487 | ¥ | 65.941 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | ¥ | 13.265 | $ | 97 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2.255 | ¥ | 306.491 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 97 | | 13.244 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | ¥ | 68.267 | $ | 501 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 118 | ¥ | 15.118 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 499 | | 67.883 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | | | $ 3 | $ (22) | $ (19) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional MXN (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | $ | 7.875 | MXN | 157.228 | $ 0 | $ (82) | $ (82) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | MXN | 131.821 | $ | 6.518 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 11.014 | MXN | 220.738 | 0 | (73) | (73) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 6.481 | | 131.821 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 09.2022 | MXN | 62.562 | $ | 3.067 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | $ | 7.877 | MXN | 157.228 | 0 | (84) | (84) | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | MXN | 194.383 | $ | 9.547 | 0 | (88) | (88) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 31.967 | | 1.597 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 6.484 | MXN | 131.821 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MBC | 07.2022 | MXN | 2.301 | $ | 117 | $ 3 | $ 0 | $ 3 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 82.775 | | 4.088 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 4.065 | MXN | 82.775 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | MXN | 135.325 | $ | 6.689 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 394 | MXN | 7.906 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 6.483 | | 131.821 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | | | | | | $ 100 | $ (378) | $ (278) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | SEK | 1.161 | $ | 113 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | | 56.015 | | 5.513 | 46 | 0 | 46 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 5.513 | SEK | 55.969 | 0 | (46) | (46) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | SEK | 197 | $ | 20 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | | 1.940 | | 191 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | $ | 6.333 | SEK | 61.886 | 0 | (294) | (294) | (0,01) |
| SOG | 07.2022 | | 5.753 | | 56.476 | 0 | (241) | (241) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | | 6.095 | | 59.667 | 0 | (272) | (272) | 0,00 |
| | | | | | | $ 49 | $ (853) | $ (804) | (0,01) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend,E Class SGD (Hedged) aussschüttend, M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II und W 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 | 07.2022 | SGD | 26.120 | $ | 18.795 | $ 27 | $ 0 | $ 27 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 42.384 | SGD | 58.071 | 0 | (657) | (657) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 18.795 | | 26.119 | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | SGD | 52.573 | $ | 37.842 | 66 | 0 | 66 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 37.706 | SGD | 52.386 | 0 | (63) | (63) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | SGD | 2.747 | $ | 1.981 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 58 | SGD | 80 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | SGD | 116 | $ | 84 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 46 | SGD | 64 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | | 61 | | 84 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 43.290 | | 59.162 | 0 | (779) | (779) | (0,01) |
| UAG | 07.2022 | SGD | 1.692 | $ | 1.217 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 45.052 | SGD | 61.693 | 0 | (722) | (722) | (0,01) |
| | | | | | | $ 102 | $ (2.250) | $ (2.148) | (0,02) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (132.906)** | **(1,32)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 9.205.776** | **91,42** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ 864.226** | **8,58** |
| **Nettovermögen** | **$ 10.070.002** | **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.**

**µ** **Bei diesem Betrag handelt es sich ganz oder teilweise um ungedeckte Darlehenszusagen. Der Zinssatz für den ungedeckten Teil wird zum Zeitpunkt der Finanzierung festgelegt.**

**(a)** **Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

**(b)** **Reines Kapitalwertpapier.**

**(c)** **Wertpapier per Emissionstermin.**

**(d)** **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

**(e)** **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

**(f)** **Nullkuponwertpapier.**

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

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

**(i)** **Mit dem Fonds verbunden.**

**(j) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(k) Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|
| Citigroup. Inc, 2,572 % fällig am 03.06.2031 | 26.05.2020 | $ 7.300 | $ 6.143 | 0,06 |
| Constellation Oil Services Holding S.A. | 10. Juni 2022 | 92 | 91 | 0,00 |
| Deutsche Bank AG 3,035 % fällig am 28.05.2032 | 25.05.2021 - 29.07.2021 | 1.124 | 872 | 0,01 |
| General Motors Co, 6,800 % fällig am 01.10.2027 | 07.05.2020 | 1.797 | 1.897 | 0,02 |
| Intelsat Emergence S.A. | 24.02.2020 - 29.10.2021 | 16.083 | 5.155 | 0,05 |
| Noble Corp. | 05.02.2021 - 25.02.2021 | 1.765 | 4.100 | 0,04 |
| | | $ 28.161 | $ 18.258 | 0,18 |

**(l) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 32.586 und Barmittel in Höhe von USD 7.930 als Sicherheiten verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 1.280 als Sicherheiten erhalten.**

**Barmittel in Höhe von USD 373.307 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 173.185 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 6.887 | $ 7.605.838 | $ 8.599 | $ 7.621.324 |
| Investmentfonds | 523.566 | 486.862 | 0 | 1.010.428 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 945.104 | 0 | 945.104 |
| Finanzderivate[3] | 308 | (371.388) | 0 | (371.080) |
| **Summen** | **$ 530.761** | **$ 8.666.416** | **$ 8.599** | **$ 9.205.776** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 5.994 | $ 14.253.100 | $ 14.925 | $ 14.274.019 |
| Investmentfonds | 1.614.943 | 0 | 0 | 1.614.943 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 157.316 | 0 | 157.316 |
| Finanzderivate[3] | 2.739 | 113.040 | 0 | 115.779 |
| **Summen** | **$ 1.623.676** | **$ 14.523.456** | **$ 14.925** | **$ 16.162.057** |

(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 2022:**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | (5,000) % | 23.05.2022 | TBD[1] | € (11.327) | $ (11.759) | (0,12) |
| | (1,250) | 30.03.2022 | TBD[1] | (3.920) | (4.085) | (0,04) |
| | (0,950) | 23.05.2022 | TBD[1] | (680) | (711) | (0,01) |
| | (0,250) | 25.04.2022 | TBD[1] | $ (1.557) | (1.555) | (0,01) |
| | (0,250) | 10.06.2022 | TBD[1] | (976) | (975) | (0,01) |
| JML | (10,000) | 24.06.2022 | TBD[1] | € (1.806) | (1.885) | (0,02) |
| | (6,500) | 19.05.2022 | TBD[1] | (10.305) | (10.689) | (0,11) |
| | (1,500) | 08.04.2022 | TBD[1] | (816) | (850) | (0,01) |
| MEI | 0,000 | 24.06.2022 | 23.06.2024 | $ (475) | (474) | 0,00 |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (32.983)** | **(0,33)** |

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ (1) | $ 0 | $ (1) |
| BOA | (31.691) | 32.120 | 429 |

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BPS | $ 530 | $ 30 | $ 560 |
| BRC | (29.323) | 27.187 | (2.136) |
| CBK | (4.196) | 5.937 | 1.741 |
| DUB | (1.263) | 1.010 | (253) |
| FBF | 18 | (280) | (262) |
| GLM | (267) | 440 | 173 |
| GST | (2.409) | 2.010 | (399) |
| JPM | 1.614 | (2.590) | (976) |
| MBC | (52.134) | 47.500 | (4.634) |
| MYC | (14) | (260) | (274) |
| MYI | 46 | 1 | 47 |
| RBC | 22 | 0 | 22 |
| RYL | 2 | 0 | 2 |
| SCX | (4.931) | 4.430 | (501) |
| SOG | (46.154) | 47.710 | 1.556 |
| TOR | (4.724) | 4.810 | 86 |
| UAG | 41.969 | (36.540) | 5.429 |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 52,91 | 61,10 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 19,78 | 23,45 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 3,00 | 2,22 |
| Investmentfonds | 10,03 | 9,82 |
| Pensionsgeschäfte | 9,39 | 0,96 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,48) | 0,16 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (1,89) | 0,06 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (1,32) | 0,49 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (0,33) | (0,50) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Albanien | 0,16 | 0,13 |
| Argentinien | 0,52 | 0,53 |
| Australien | 0,07 | 0,05 |
| Österreich | k. A. | 0,25 |
| Weissrussland | 0,01 | 0,04 |
| Bermuda | 0,68 | 0,48 |
| Brasilien | 0,25 | 0,60 |
| Kanada | 0,28 | 0,24 |
| Cayman-Inseln | 2,45 | 3,12 |
| Chile | 0,07 | 0,12 |
| China | 0,06 | 0,51 |
| Kolumbien | 0,39 | 0,40 |
| Dänemark | 0,12 | k. A. |
| Dominikanische Republik | 0,46 | 0,66 |
| Ecuador | 0,15 | 0,24 |
| Ägypten | 0,47 | 0,61 |
| Finnland | 0,02 | k. A. |
| Frankreich | 4,04 | 3,68 |
| Deutschland | 4,15 | 4,25 |
| Ghana | 0,10 | 0,10 |
| Guernsey, Kanalinseln | 0,51 | 0,45 |
| Hongkong | 1,17 | 1,06 |
| Indien | 0,03 | 0,04 |
| Indonesien | 0,52 | 1,86 |
| Irland | 5,88 | 4,26 |
| Insel Man | k. A. | 0,24 |
| Israel | 0,10 | 0,06 |
| Italien | 4,76 | 3,93 |
| Elfenbeinküste | 0,13 | 0,27 |
| Japan | 0,93 | 0,71 |
| Jersey, Kanalinseln | 1,20 | 0,65 |
| Jordanien | k. A. | 0,07 |
| Kasachstan | k. A. | 0,01 |
| Liberia | 0,02 | 0,09 |
| Luxemburg | 4,35 | 4,24 |
| Mazedonien | 0,07 | 0,05 |
| Malaysia | k. A. | 0,01 |
| Mauritius | 0,08 | 0,05 |
| Mexiko | 1,87 | 2,39 |
| Marokko | k. A. | 0,07 |
| Multinational | 0,33 | 0,50 |
| Niederlande | 4,36 | 3,83 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Nigeria | 0,35 | 0,31 |
| Norwegen | k. A. | 0,08 |
| Oman | 0,43 | 0,74 |
| Panama | 0,24 | 0,19 |
| Paraguay | k. A. | 0,09 |
| Peru | k. A. | 0,26 |
| Portugal | 0,13 | 0,14 |
| Katar | 0,12 | 0,83 |
| Rumänien | 0,06 | 0,22 |
| Russland | 0,16 | 0,53 |
| Saudi-Arabien | k. A. | 1,21 |
| Serbien | 0,07 | 0,07 |
| Singapur | 0,14 | 0,20 |
| Slowenien | 0,15 | 0,05 |
| Südafrika | 0,08 | 0,47 |
| Spanien | 0,61 | 1,01 |
| Sri Lanka | 0,08 | 0,07 |
| Supranational | 0,06 | 0,05 |
| Schweden | 0,33 | 0,01 |
| Schweiz | 1,71 | 1,16 |
| Tunesien | k. A. | 0,02 |
| Türkei | 0,61 | 1,27 |
| Ukraine | 0,20 | 0,57 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 0,12 | 0,59 |
| Großbritannien | 8,52 | 8,41 |
| USA | 18,63 | 19,08 |
| Venezuela | 0,03 | 0,01 |
| Jungferninseln (Britisch) | 0,04 | 0,04 |
| Kurzfristige Instrumente | 2,06 | 8,24 |
| Investmentfonds | 10,03 | 9,82 |
| Pensionsgeschäfte | 9,39 | 0,96 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,48) | 0,16 |
| Centrally Cleared Financial Derivative Instruments | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,17) | 0,03 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (1,68) | (0,01) |
| Zinsswaps | (0,04) | 0,04 |
| OTC Financial Derivative Instruments | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,02) | 0,00 |
| Zinsswapoptionen | (0,02) | k. A. |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,03) | 0,08 |
| Devisenterminkontrakte | 0,95 | (0,26) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (2,20) | 0,67 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 8,58 | 1,74 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **ARGENTINIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 1,125 % fällig am 09.07.2035 | $ | 2.252 | $ 476 | 0,06 |
| 2,500 % fällig am 09.07.2041 | | 17.622 | 4.582 | 0,56 |
| **Provincia de Buenos Aires** | | | | |
| 49,102 % fällig am 12.04.2025 | ARS | 610 | 2 | 0,00 |
| Summe Argentinien | | | 5.060 | 0,62 |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Pacific National Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 22.03.2028 | $ | 200 | 191 | 0,02 |
| **WEISSRUSSLAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Belarus Government International Bond** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.02.2026 | | 700 | 109 | 0,01 |
| **BERMUDA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aircastle Ltd.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 26.01.2028 | | 1.000 | 827 | 0,10 |
| 5,250 % fällig am 11.08.2025 | | 3.450 | 3.335 | 0,41 |
| **Bacardi Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 03.07.2023 | € | 1.000 | 1.053 | 0,13 |
| Summe Bermuda | | | 5.215 | 0,64 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.08.2022 (d)(f) | $ | 2.332 | 9 | 0,00 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.10.2029 | £ | 500 | 538 | 0,07 |
| 6,250 % fällig am 14.12.2026 | | 769 | 908 | 0,11 |
| Summe Brasilien | | | 1.455 | 0,18 |
| **KANADA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Air Canada Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.10.2030 | $ | 811 | 812 | 0,10 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028 | € | 2.400 | 2.325 | 0,29 |
| Summe Kanada | | | 3.137 | 0,39 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Vibrant CLO Ltd.** | | | | |
| 2,103 % fällig am 15.09.2030 | $ | 300 | 294 | 0,04 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | |
| 2,528 % fällig am 18.11.2027 | | 2.127 | 1.736 | 0,21 |
| 3,250 % fällig am 15.02.2027 | | 400 | 349 | 0,04 |
| 4,250 % fällig am 15.04.2026 | | 100 | 93 | 0,01 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 22.10.2025 | | 4.500 | 2.216 | 0,27 |
| 4,750 % fällig am 17.01.2023 | | 200 | 177 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 08.04.2024 | | 1.300 | 782 | 0,10 |
| 7,250 % fällig am 08.04.2026 | | 1.300 | 712 | 0,09 |
| **Kaisa Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 9,375 % fällig am 30.06.2024 ^ | | 1.100 | 154 | 0,02 |
| 9,750 % fällig am 28.09.2023 ^ | | 3.000 | 416 | 0,05 |
| 10,500 % fällig am 15.01.2025 ^ | | 2.200 | 302 | 0,04 |
| 10,875 % fällig am 23.07.2023 ^ | | 400 | 55 | 0,01 |
| 11,250 % fällig am 16.04.2025 ^ | | 1.500 | 206 | 0,02 |
| 11,650 % fällig am 01.06.2026 ^ | | 1.000 | 137 | 0,02 |
| 11,700 % fällig am 11.11.2025 ^ | | 400 | 56 | 0,01 |
| **Lima Metro Line Finance Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 05.07.2034 | | 633 | 626 | 0,08 |
| **Melco Resorts Finance Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 06.06.2025 | | 700 | 524 | 0,06 |
| 5,375 % fällig am 04.12.2029 | | 700 | 423 | 0,05 |
| **MGM China Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 18.06.2025 | $ | 200 | $ 154 | 0,02 |
| **Noble Finance Co. (11,000 % bar oder 15,000 % PIK)** | | | | |
| 11,000 % fällig am 15.02.2028 (b) | | 117 | 128 | 0,02 |
| **Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar und 1,000 % PIK)** | | | | |
| 7,350 % fällig am 01.12.2026 ^(b) | | 3.493 | 2.155 | 0,27 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | | |
| 6,720 % fällig am 01.12.2022 ^ | | 21 | 20 | 0,00 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd. (6,720 % bar und 1,000 % PIK)** | | | | |
| 7,720 % fällig am 01.12.2026 ^(b) | | 850 | 213 | 0,03 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2023 | | 4.000 | 3.987 | 0,49 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2024 | | 140 | 139 | 0,02 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 08.08.2031 | | 900 | 596 | 0,07 |
| 3,800 % fällig am 08.01.2026 | | 4.300 | 3.452 | 0,43 |
| 4,875 % fällig am 18.06.2030 | | 300 | 220 | 0,03 |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028 | | 400 | 309 | 0,04 |
| **Seazen Group Ltd.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 13.07.2025 | | 1.000 | 587 | 0,07 |
| 6,000 % fällig am 12.08.2024 | | 200 | 120 | 0,01 |
| **Sitka Holdings LLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 06.07.2026 | | 800 | 774 | 0,09 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 26.04.2024 ^ | | 900 | 137 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 09.07.2023 ^ | | 700 | 107 | 0,01 |
| 6,650 % fällig am 03.08.2024 ^ | | 800 | 118 | 0,01 |
| 7,000 % fällig am 09.07.2025 ^ | | 1.000 | 150 | 0,02 |
| 7,250 % fällig am 14.06.2022 ^ | | 3.300 | 502 | 0,06 |
| 7,500 % fällig am 01.02.2024 ^ | | 900 | 137 | 0,02 |
| 7,950 % fällig am 11.10.2023 ^ | | 300 | 46 | 0,01 |
| 8,350 % fällig am 19.04.2023 ^ | | 200 | 30 | 0,00 |
| **Trafford Centre Finance Ltd.** | | | | |
| 2,033 % fällig am 28.07.2038 | £ | 300 | 319 | 0,04 |
| **Transocean Guardian Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.01.2024 | $ | 243 | 225 | 0,03 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.12.2029 | | 1.200 | 747 | 0,09 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2026 | | 900 | 625 | 0,08 |
| 5,500 % fällig am 01.10.2027 | | 900 | 584 | 0,07 |
| 5,625 % fällig am 26.08.2028 | | 400 | 247 | 0,03 |
| | | | 25.792 | 3,18 |
| Summe Cayman Inseln | | | 26.086 | 3,22 |
| **CHILE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **GNL Quintero S.A.** | | | | |
| 4,634 % fällig am 31.07.2029 | | 529 | 509 | 0,06 |
| **CHINA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **New Metro Global Ltd.** | | | | |
| 4,800 % fällig am 15.12.2024 | | 300 | 165 | 0,02 |
| **Yango Justice International Ltd.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.04.2024 ^ | | 2.600 | 210 | 0,03 |
| 7,500 % fällig am 17.02.2025 ^ | | 1.900 | 166 | 0,02 |
| 7,875 % fällig am 04.09.2024 ^ | | 1.900 | 166 | 0,02 |
| Summe China | | | 707 | 0,09 |
| **KOLUMBIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Colombia Government International Bond** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.06.2045 | | 5.500 | 3.696 | 0,46 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **TDC Net A/S** | | | | |
| 5,056 % fällig am 31.05.2028 | € | 1.100 | 1.078 | 0,13 |
| **DOMINIKANISCHE REPUBLIK** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Dominican Republic Government International Bond** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.02.2048 | $ | 5.400 | 4.104 | 0,51 |
| **ECUADOR** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ecuador Government International Bond** | | | | |
| 0,000 % fällig am 31.07.2030 (d) | $ | 1.816 | $ 782 | 0,10 |
| 0,500 % fällig am 31.07.2040 | | 1.226 | 527 | 0,06 |
| Summe Ecuador | | | 1.309 | 0,16 |
| **ÄGYPTEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Egypt Government International Bond** | | | | |
| 5,625 % fällig am 16.04.2030 | € | 100 | 65 | 0,01 |
| 6,375 % fällig am 11.04.2031 | | 1.800 | 1.189 | 0,15 |
| 7,500 % fällig am 16.02.2061 | $ | 3.600 | 2.014 | 0,25 |
| 8,500 % fällig am 31.01.2047 | | 900 | 536 | 0,06 |
| Summe Ägypten | | | 3.804 | 0,47 |
| **FINNLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Balder Finland Oyj** | | | | |
| 1,375 % fällig am 24.05.2030 | € | 300 | 185 | 0,02 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Altice France S.A.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.01.2028 | | 100 | 79 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 15.07.2029 | | 1.800 | 1.382 | 0,17 |
| 4,250 % fällig am 15.10.2029 | | 2.000 | 1.567 | 0,19 |
| 5,500 % fällig am 15.10.2029 | $ | 2.000 | 1.534 | 0,19 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 2,819 % fällig am 19.11.2025 | | 500 | 478 | 0,06 |
| 3,500 % fällig am 16.11.2027 | | 600 | 560 | 0,07 |
| 5,198 % fällig am 10.01.2030 | | 700 | 700 | 0,09 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 14.01.2025 | | 300 | 285 | 0,04 |
| 3,500 % fällig am 23.10.2027 | | 400 | 371 | 0,05 |
| **CGG S.A.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.04.2027 | € | 200 | 179 | 0,02 |
| 8,750 % fällig am 01.04.2027 | $ | 4.300 | 3.664 | 0,45 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 1,907 % fällig am 16.06.2026 | | 1.600 | 1.474 | 0,18 |
| **Loxam S.A.S.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.04.2026 | € | 200 | 178 | 0,02 |
| 3,250 % fällig am 14.01.2025 | | 800 | 757 | 0,09 |
| **Renault S.A.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 25.05.2026 | | 6.500 | 5.842 | 0,72 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 18.12.2023 (f)(h) | $ | 200 | 196 | 0,02 |
| **TDF Infrastructure SASU** | | | | |
| 1,750 % fällig am 01.12.2029 | € | 5.000 | 4.328 | 0,54 |
| | | | 23.574 | 2,91 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Altice France S.A.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 02.02.2026 | | 2.935 | 2.784 | 0,34 |
| **Casino Guichard Perrachon S.A.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 31.08.2025 | | 3.700 | 3.486 | 0,43 |
| | | | 6.270 | 0,77 |
| Summe Frankreich | | | 29.844 | 3,68 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ADLER Real Estate AG** | | | | |
| 1,875 % fällig am 27.04.2023 | | 200 | 165 | 0,02 |
| 2,125 % fällig am 06.02.2024 | | 100 | 76 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 27.04.2026 | | 400 | 279 | 0,04 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 3,035 % fällig am 28.05.2032 (i) | $ | 300 | 238 | 0,03 |
| 3,742 % fällig am 07.01.2033 | | 700 | 510 | 0,06 |
| 4,500 % fällig am 01.04.2025 | | 800 | 763 | 0,10 |
| 5,882 % fällig am 08.07.2031 | | 4.200 | 3.819 | 0,47 |
| **Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide** | | | | |
| 1,875 % fällig am 31.03.2028 | € | 1.800 | 1.652 | 0,21 |
| 2,125 % fällig am 09.07.2027 | | 200 | 191 | 0,02 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK)** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2025 (b) | | 1.000 | 914 | 0,11 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.09.2026 (b) | € | 3.450 $ | 3.000 | 0,37 |
| **INEOS Styrolution Group GmbH** | | | | |
| 2,250 % fällig am 16.01.2027 | | 3.300 | 2.678 | 0,33 |
| **ZF Finance GmbH** | | | | |
| 2,750 % fällig am 25.05.2027 | | 1.500 | 1.242 | 0,15 |
| 3,750 % fällig am 21.09.2028 | | 6.100 | 5.029 | 0,62 |
| Summe Deutschland | | | 20.556 | 2,54 |
| **GHANA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ghana Government International Bond** | | | | |
| 8,125 % fällig am 26.03.2032 | $ | 600 | 292 | 0,04 |
| 8,750 % fällig am 11.03.2061 | | 300 | 143 | 0,02 |
| 8,950 % fällig am 26.03.2051 | | 200 | 95 | 0,01 |
| Summe Ghana | | | 530 | 0,07 |
| **GUERNSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Doric Nimrod Air Alpha Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,250 % fällig am 30.05.2025 | | 25 | 25 | 0,00 |
| **Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.11.2024 | | 204 | 202 | 0,03 |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 29.03.2025 | € | 4.600 | 4.241 | 0,52 |
| Summe Guernsey, Kanalinseln | | | 4.468 | 0,55 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Fortune Star BVI Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 02.10.2026 | | 4.100 | 2.556 | 0,32 |
| 5,950 % fällig am 19.10.2025 | $ | 1.600 | 1.026 | 0,13 |
| **Huarong Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 30.09.2023 | | 5.200 | 4.956 | 0,61 |
| 2,500 % fällig am 24.02.2023 | | 700 | 684 | 0,08 |
| 2,631 % fällig am 24.02.2023 | | 1.200 | 1.173 | 0,14 |
| Summe Hongkong | | | 10.395 | 1,28 |
| **INDIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Adani Electricity Mumbai Ltd.** | | | | |
| 3,949 % fällig am 12.02.2030 | | 400 | 327 | 0,04 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara** | | | | |
| 1,875 % fällig am 05.11.2031 | € | 300 | 236 | 0,03 |
| **IRLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Aurium CLO DAC** | | | | |
| 0,730 % fällig am 16.01.2031 | | 300 | 308 | 0,04 |
| **Bain Capital Euro DAC** | | | | |
| 0,740 % fällig am 20.01.2032 | | 2.000 | 2.029 | 0,25 |
| **GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC** | | | | |
| 0,900 % fällig am 20.01.2032 | | 200 | 203 | 0,03 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 26.06.2030 | | 6.830 | 7.018 | 0,87 |
| 0,850 % fällig am 15.01.2032 | | 2.500 | 2.544 | 0,31 |
| **Laurelin DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 20.10.2031 | | 1.100 | 1.127 | 0,14 |
| **Madison Park Euro Funding DAC** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.01.2032 | | 7.000 | 7.086 | 0,87 |
| **Palmerston Park CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 18.04.2030 | | 342 | 352 | 0,04 |
| **Sculptor European CLO DAC** | | | | |
| 0,790 % fällig am 14.01.2032 | | 800 | 808 | 0,10 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | |
| 0,810 % fällig am 15.02.2034 | | 750 | 758 | 0,09 |
| 0,920 % fällig am 12.01.2032 | | 300 | 305 | 0,04 |
| | | | 22.538 | 2,78 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC** | | | | |
| 2,700 % fällig am 11.06.2023 | € | 2.800 $ | 205 | 0,03 |
| **James Hardie International Finance DAC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.10.2026 | | 900 | 872 | 0,11 |
| **Perrigo Finance Unlimited Co.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 15.06.2030 | $ | 200 | 179 | 0,02 |
| | | | 1.256 | 0,16 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Setanta Aircraft Leasing DAC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 05.11.2028 | | 5.000 | 4.771 | 0,59 |
| Summe Irland | | | 28.565 | 3,53 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Atlantia SpA** | | | | |
| 1,625 % fällig am 03.02.2025 | € | 300 | 287 | 0,03 |
| 1,875 % fällig am 13.07.2027 | | 300 | 256 | 0,03 |
| 1,875 % fällig am 12.02.2028 | | 8.700 | 7.104 | 0,88 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 2,625 % fällig am 28.04.2025 | | 4.100 | 3.808 | 0,47 |
| 4,000 % fällig am 10.07.2022 | | 2.900 | 3.024 | 0,37 |
| 8,000 % fällig am 22.01.2030 | | 3.400 | 2.277 | 0,28 |
| 8,500 % fällig am 10.09.2030 | | 3.000 | 2.076 | 0,26 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 4,198 % fällig am 01.06.2032 | $ | 200 | 147 | 0,02 |
| 5,017 % fällig am 26.06.2024 | | 1.800 | 1.719 | 0,21 |
| 5,148 % fällig am 10.06.2030 | £ | 100 | 105 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 01.03.2028 (f)(h) | € | 5.100 | 4.285 | 0,53 |
| **Nexi SpA** | | | | |
| 2,125 % fällig am 30.04.2029 | | 3.600 | 2.639 | 0,33 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | $ | 9.600 | 9.945 | 1,23 |
| Summe Italien | | | 37.672 | 4,65 |
| **ELFENBEINKÜSTE** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ivory Coast Government International Bond** | | | | |
| 5,250 % fällig am 22.03.2030 | € | 100 | 82 | 0,01 |
| 5,875 % fällig am 17.10.2031 | | 250 | 206 | 0,03 |
| 6,875 % fällig am 17.10.2040 | | 750 | 560 | 0,07 |
| Summe Elfenbeinküste | | | 848 | 0,11 |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Nissan Motor Co. Ltd.** | | | | |
| 4,345 % fällig am 17.09.2027 | $ | 8.500 | 7.809 | 0,97 |
| 4,810 % fällig am 17.09.2030 | | 400 | 356 | 0,04 |
| Summe Japan | | | 8.165 | 1,01 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Adient Global Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.08.2024 | € | 500 | 474 | 0,06 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 11.09.2025 | | 1.800 | 1.725 | 0,21 |
| **Corsair International Ltd.** | | | | |
| 4,850 % fällig am 28.01.2027 | | 1.600 | 1.579 | 0,20 |
| 5,200 % fällig am 28.01.2029 | | 600 | 586 | 0,07 |
| Summe Jersey, Kanalinseln | | | 4.364 | 0,54 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| Intelsat Emergence S.A. (c)(i) | | 14.398 | 403 | 0,05 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **WANDELANLEIHEN & WECHSEL** | | | | |
| **Corestate Capital Holding S.A.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 28.11.2022 | € | 2.000 | 544 | 0,07 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ADLER Group S.A.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 14.01.2026 | € | 1.400 $ | 761 | 0,09 |
| 2,250 % fällig am 27.04.2027 | | 600 | 305 | 0,04 |
| 2,750 % fällig am 13.11.2026 | | 1.200 | 641 | 0,08 |
| **Albion Financing SARL** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.10.2026 | | 1.600 | 1.402 | 0,17 |
| 6,125 % fällig am 15.10.2026 | $ | 500 | 429 | 0,05 |
| **Altice Financing S.A.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.01.2028 | € | 2.000 | 1.567 | 0,19 |
| 4,250 % fällig am 15.08.2029 | | 600 | 475 | 0,06 |
| 5,750 % fällig am 15.08.2029 | $ | 8.100 | 6.523 | 0,81 |
| **Altice France Holding S.A.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.02.2028 (j) | € | 1.700 | 1.212 | 0,15 |
| 6,000 % fällig am 15.02.2028 | $ | 700 | 498 | 0,06 |
| 8,000 % fällig am 15.05.2027 | € | 400 | 345 | 0,04 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | $ | 1.800 | 1.668 | 0,21 |
| **Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar oder 4,000 % PIK)** | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.12.2026 (b) | | 142 | 105 | 0,01 |
| **Corestate Capital Holding S.A.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.04.2023 | € | 3.500 | 825 | 0,10 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 27.01.2031 | | 500 | 348 | 0,04 |
| 1,750 % fällig am 14.01.2030 | | 1.800 | 1.334 | 0,16 |
| 4,875 % fällig am 18.08.2026 (f) | | 800 | 486 | 0,06 |
| **FEL Energy SARL** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.12.2040 | $ | 4.615 | 3.358 | 0,41 |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 06.04.2024 | £ | 2.900 | 1.189 | 0,15 |
| 5,150 % fällig am 11.02.2026 | $ | 200 | 65 | 0,01 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.03.2030 | | 1.072 | 887 | 0,11 |
| **Lincoln Financing SARL** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.04.2024 | € | 4.600 | 4.668 | 0,58 |
| 3,875 % fällig am 01.04.2024 | | 1.800 | 1.836 | 0,23 |
| **NE Property BV** | | | | |
| 3,375 % fällig am 14.07.2027 | | 2.400 | 2.164 | 0,27 |
| **SIG Combibloc Purchase Co. SARL** | | | | |
| 1,875 % fällig am 18.06.2023 | | 3.900 | 4.028 | 0,50 |
| | | | 37.119 | 4,58 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Albion Financing SARL** | | | | |
| 5,250 % fällig am 17.08.2026 | | 2.000 | 1.977 | 0,24 |
| **Altice Financing S.A.** | | | | |
| 3,794 % fällig am 31.01.2026 | $ | 1.361 | 1.243 | 0,15 |
| **Connect Finco SARL** | | | | |
| 5,170 % fällig am 11.12.2026 | | 1.564 | 1.448 | 0,18 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | |
| 4,920 % fällig am 01.02.2029 | | 302 | 277 | 0,04 |
| | | | 4.945 | 0,61 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **RECHTE** | | | | |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp 05/12/2025** | | 3.012 | 15 | 0,00 |
| Summe Luxemburg | | | 43.026 | 5,31 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **MAZEDONIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **North Macedonia Government International Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 18.01.2025 | € | 300 | 284 | 0,04 |
| **MAURITIUS** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Greenko Solar Mauritius Ltd.** | | | | |
| 5,550 % fällig am 29.01.2025 | $ | 1.400 | 1.316 | 0,16 |
| **MEXIKO** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 5,625 % fällig am 23.01.2046 | | 1.616 | 920 | 0,11 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 5,950 % fällig am 28.01.2031 | $ | 3.300 | $ 2.424 | 0,30 |
| 6,350 % fällig am 12.02.2048 | | 200 | 118 | 0,02 |
| 6,625 % fällig am 15.06.2035 | | 7.500 | 5.138 | 0,63 |
| 6,625 % fällig am 15.06.2038 | | 400 | 264 | 0,03 |
| 6,750 % fällig am 21.09.2047 | | 4.400 | 2.732 | 0,34 |
| 7,690 % fällig am 23.01.2050 | | 2.084 | 1.424 | 0,18 |
| **Trust Fibra Uno** | | | | |
| 6,390 % fällig am 15.01.2050 | | 300 | 239 | 0,03 |
| Summe Mexiko | | | 13.259 | 1,64 |
| **MULTINATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Allied Universal Holdco LLC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.06.2028 | € | 1.900 | 1.510 | 0,18 |
| **Connect Finco SARL** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.10.2026 | $ | 1.600 | 1.443 | 0,18 |
| **Delta Air Lines, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 20.10.2025 | | 400 | 389 | 0,05 |
| Summe multinational | | | 3.342 | 0,41 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Athora Netherlands NV** | | | | |
| 7,000 % fällig am 19.06.2025 (f)(h) | € | 400 | 396 | 0,05 |
| **Atrium Finance Issuer BV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.09.2027 | | 1.300 | 1.100 | 0,13 |
| **Citycon Treasury BV** | | | | |
| 1,625 % fällig am 12.03.2028 | | 200 | 154 | 0,02 |
| **Imperial Brands Finance Netherlands BV** | | | | |
| 1,750 % fällig am 18.03.2033 | | 2.600 | 1.976 | 0,24 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 5,750 % fällig am 16.11.2026 (f)(h) | $ | 500 | 458 | 0,06 |
| 6,500 % fällig am 16.04.2025 (f)(h) | | 1.700 | 1.605 | 0,20 |
| 6,750 % fällig am 16.04.2024 (f)(h) | | 1.500 | 1.453 | 0,18 |
| **NN Group NV** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2026 (f) | € | 1.500 | 1.516 | 0,19 |
| **Prosus NV** | | | | |
| 2,778 % fällig am 19.01.2034 | | 400 | 292 | 0,03 |
| 3,680 % fällig am 21.01.2030 | $ | 1.700 | 1.356 | 0,17 |
| 4,193 % fällig am 19.01.2032 | | 700 | 560 | 0,07 |
| **Q-Park Holding BV** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.03.2025 | € | 900 | 819 | 0,10 |
| 3,500 % fällig am 01.02.2025 | | 3.100 | 2.941 | 0,36 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 4,441 % fällig am 24.04.2023 | $ | 2.000 | 2.017 | 0,25 |
| 4,892 % fällig am 24.04.2025 | | 2.100 | 2.107 | 0,26 |
| 5,182 % fällig am 24.04.2028 | | 2.000 | 2.027 | 0,25 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2025 | € | 1.800 | 1.764 | 0,22 |
| **United Group BV** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.02.2030 | | 900 | 698 | 0,09 |
| **Volkswagen International Finance NV** | | | | |
| 3,500 % fällig am 17.06.2025 (f) | | 1.100 | 1.045 | 0,13 |
| 3,875 % fällig am 17.06.2029 (f) | | 1.600 | 1.392 | 0,17 |
| **ZF Europe Finance BV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 23.02.2026 | | 1.100 | 954 | 0,12 |
| | | | 26.630 | 3,29 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Sigma Bidco BV** | | | | |
| 3,500 % fällig am 02.07.2025 | | 2.500 | 1.983 | 0,24 |
| **T-Mobile Netherlands** | | | | |
| 4,000 % fällig am 30.03.2029 | | 6.700 | 6.482 | 0,80 |
| **Ziggo BV** | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.01.2029 | | 1.700 | 1.591 | 0,20 |
| | | | 10.056 | 1,24 |
| Summe Niederlande | | | 36.686 | 4,53 |
| **NIGERIA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Nigeria Government International Bond** | | | | |
| 7,625 % fällig am 28.11.2047 | $ | 1.700 | 1.022 | 0,12 |
| 7,696 % fällig am 23.02.2038 | | 400 | 248 | 0,03 |
| 7,875 % fällig am 16.02.2032 | | 2.400 | 1.678 | 0,21 |
| Summe Nigeria | | | 2.948 | 0,36 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **OMAN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Oman Government International Bond** | | | | |
| 6,750 % fällig am 17.01.2048 | $ | 3.000 | $ 2.597 | 0,32 |
| **KATAR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Nakilat, Inc.** | | | | |
| 6,067 % fällig am 31.12.2033 | | 1.516 | 1.620 | 0,20 |
| **RUMÄNIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Romania Government International Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 14.04.2033 | € | 900 | 613 | 0,07 |
| 2,875 % fällig am 13.04.2042 | | 900 | 552 | 0,07 |
| Summe Rumänien | | | 1.165 | 0,14 |
| **SLOWENIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Nova Kreditna Banka Maribor d.d.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 27.01.2025 | | 1.200 | 1.185 | 0,15 |
| **Nova Ljubljanska Banka d.d.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 05.02.2030 | | 700 | 644 | 0,08 |
| Summe Slowenien | | | 1.829 | 0,23 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AngloGold Ashanti Holdings PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.10.2030 | $ | 200 | 165 | 0,02 |
| **Growthpoint Properties International Pty. Ltd.** | | | | |
| 5,872 % fällig am 02.05.2023 | | 400 | 400 | 0,05 |
| **Sasol Financing USA LLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 27.03.2024 | | 500 | 490 | 0,06 |
| Summe Südafrika | | | 1.055 | 0,13 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (f)(h) | € | 200 | 201 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 29.03.2024 (f)(h) | | 200 | 197 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 15.01.2026 (f)(h) | | 1.000 | 954 | 0,12 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 14.01.2026 (f)(h) | | 400 | 353 | 0,04 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 09.10.2027 (f)(h) | | 600 | 553 | 0,07 |
| Summe Spanien | | | 2.258 | 0,28 |
| **SRI LANKA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Sri Lanka Government International Bond** | | | | |
| 7,550 % fällig am 28.03.2030 ^ | $ | 1.600 | 518 | 0,06 |
| 7,850 % fällig am 14.03.2029 ^ | | 600 | 197 | 0,03 |
| Summe Sri Lanka | | | 715 | 0,09 |
| **SUPRANATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banque Ouest Africaine de Developpement** | | | | |
| 2,750 % fällig am 22.01.2033 | € | 600 | 504 | 0,06 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Volvo Car AB** | | | | |
| 4,250 % fällig am 31.05.2028 | | 2.600 | 2.545 | 0,31 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (h) | $ | 7.600 | 7.619 | 0,94 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 3,750 % fällig am 26.03.2025 | | 300 | 291 | 0,04 |
| 7,125 % fällig am 29.07.2022 (f)(h) | | 900 | 899 | 0,11 |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (f)(h) | | 200 | 185 | 0,02 |
| 7,500 % fällig am 11.12.2023 (f)(h) | | 700 | 669 | 0,08 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **UBS AG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (h) | $ | 200 | $ 200 | 0,02 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (h) | | 2.650 | 2.658 | 0,33 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 29.07.2026 (f)(h) | | 500 | 450 | 0,06 |
| Summe Schweiz | | | 12.971 | 1,60 |
| **TÜRKEI** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Turkey Government International Bond** | | | | |
| 4,875 % fällig am 16.04.2043 | | 2.800 | 1.663 | 0,21 |
| 5,750 % fällig am 11.05.2047 | | 6.600 | 4.081 | 0,50 |
| Summe Türkei | | | 5.744 | 0,71 |
| **UKRAINE** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ukraine Government International Bond** | | | | |
| 4,375 % fällig am 27.01.2030 | € | 5.000 | 1.307 | 0,16 |
| 6,750 % fällig am 20.06.2026 | | 200 | 54 | 0,01 |
| 8,994 % fällig am 01.02.2024 | $ | 300 | 77 | 0,01 |
| Summe Ukraine | | | 1.438 | 0,18 |
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **DAE Sukuk Difc Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.02.2026 | | 1.100 | 1.042 | 0,13 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.09.2024 (f)(h) | £ | 400 | 450 | 0,06 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (f)(h) | | 300 | 359 | 0,04 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (f)(h) | $ | 800 | 788 | 0,10 |
| **Bellis Acquisition Co. PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 16.02.2026 | £ | 5.100 | 4.831 | 0,60 |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC** | | | | |
| 2,950 % fällig am 27.01.2029 | $ | 3.200 | 960 | 0,12 |
| 3,000 % fällig am 29.06.2027 | | 7.800 | 2.340 | 0,29 |
| 3,250 % fällig am 25.02.2030 | | 200 | 60 | 0,01 |
| **Greene King Finance PLC** | | | | |
| 5,106 % fällig am 15.03.2034 | £ | 285 | 354 | 0,04 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 2,099 % fällig am 04.06.2026 | $ | 300 | 277 | 0,03 |
| 2,804 % fällig am 24.05.2032 | | 500 | 411 | 0,05 |
| 2,848 % fällig am 04.06.2031 | | 400 | 338 | 0,04 |
| 3,973 % fällig am 22.05.2030 | | 800 | 736 | 0,09 |
| 4,000 % fällig am 09.03.2026 (f)(h) | | 200 | 168 | 0,02 |
| 4,041 % fällig am 13.03.2028 | | 500 | 475 | 0,06 |
| **Jaguar Land Rover Automotive PLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.11.2024 | € | 3.200 | 3.085 | 0,38 |
| **John Lewis PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 18.12.2034 | £ | 800 | 739 | 0,09 |
| 6,125 % fällig am 21.01.2025 | | 700 | 879 | 0,11 |
| **Legal & General Group PLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 24.03.2031 (f)(h) | | 200 | 206 | 0,03 |
| **Market Bidco Finco PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 04.11.2027 | € | 1.700 | 1.416 | 0,18 |
| **Marks & Spencer PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 10.07.2027 | £ | 1.300 | 1.351 | 0,17 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | |
| 1,738 % fällig am 15.12.2030 | | 225 | 259 | 0,03 |
| 2,279 % fällig am 15.12.2030 | $ | 870 | 804 | 0,10 |
| 6,469 % fällig am 15.09.2032 | £ | 332 | 418 | 0,05 |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 29.12.2025 (f)(h) | $ | 2.300 | 2.134 | 0,26 |
| **Pinnacle Bidco PLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.02.2025 | € | 100 | 95 | 0,01 |
| 6,375 % fällig am 15.02.2025 | £ | 300 | 327 | 0,04 |
| **Rolls-Royce PLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.10.2027 | $ | 200 | 181 | 0,02 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 3,823 % fällig am 03.11.2028 | | 2.100 | 1.951 | 0,24 |
| 6,750 % fällig am 24.06.2024 (f)(h) | £ | 2.100 | 2.461 | 0,30 |
| **Swiss Re Finance UK PLC** | | | | |
| 2,714 % fällig am 04.06.2052 | € | 200 | 171 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Tesco Property Finance PLC** | | | | |
| 5,411 % fällig am 13.07.2044 | £ | 2.396 | $ 2.951 | 0,36 |
| 5,744 % fällig am 13.04.2040 | | 93 | 119 | 0,01 |
| **Travis Perkins PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 07.09.2023 | | 127 | 148 | 0,02 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.08.2030 | | 1.900 | 1.844 | 0,23 |
| 4,250 % fällig am 15.01.2030 | | 3.200 | 3.141 | 0,39 |
| **Vmed O2 UK Financing PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 31.01.2029 | | 3.400 | 3.295 | 0,41 |
| | | | 40.522 | 5,00 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **INEOS Finance PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 08.11.2028 | € | 3.000 | 2.884 | 0,36 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,605 % fällig am 20.10.2051 | £ | 2.305 | 2.790 | 0,34 |
| Summe Großbritannien | | | 46.196 | 5,70 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Aames Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 2,404 % fällig am 25.10.2035 | $ | 135 | 133 | 0,02 |
| 2,824 % fällig am 25.06.2035 | | 166 | 164 | 0,02 |
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,344 % fällig am 25.09.2035 | | 243 | 240 | 0,03 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,224 % fällig am 25.02.2036 | | 114 | 112 | 0,01 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,329 % fällig am 25.11.2035 | | 84 | 83 | 0,01 |
| 4,999 % fällig am 25.11.2032 ^ | | 528 | 523 | 0,07 |
| **Argent Securities Trust** | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.05.2036 | | 580 | 158 | 0,02 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | |
| 1,844 % fällig am 25.10.2036 | | 7.629 | 6.334 | 0,78 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,964 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 12 | 12 | 0,00 |
| 2,254 % fällig am 25.12.2035 | | 69 | 69 | 0,01 |
| 2,629 % fällig am 25.06.2035 | | 528 | 521 | 0,07 |
| 3,424 % fällig am 25.07.2034 | | 22 | 20 | 0,00 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,884 % fällig am 25.02.2037 | | 765 | 715 | 0,09 |
| 2,674 % fällig am 25.05.2035 | | 300 | 294 | 0,04 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 2,174 % fällig am 25.05.2047 ^ | | 923 | 725 | 0,09 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 1,804 % fällig am 25.11.2047 ^ | | 626 | 603 | 0,08 |
| 2,074 % fällig am 25.03.2036 | | 96 | 95 | 0,01 |
| 2,104 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 1.600 | 1.364 | 0,17 |
| 2,149 % fällig am 25.08.2036 | | 2.100 | 2.024 | 0,25 |
| 2,284 % fällig am 25.04.2036 | | 169 | 169 | 0,02 |
| 2,359 % fällig am 25.02.2036 | | 18 | 18 | 0,00 |
| 2,464 % fällig am 25.10.2047 | | 2.208 | 2.130 | 0,26 |
| 2,614 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 6.000 | 5.562 | 0,69 |
| 2,674 % fällig am 25.11.2034 | | 97 | 96 | 0,01 |
| 3,199 % fällig am 25.11.2034 | | 177 | 173 | 0,02 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc.** | | | | |
| 2,184 % fällig am 25.04.2034 | | 176 | 158 | 0,02 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 2,244 % fällig am 25.01.2032 | | 4 | 4 | 0,00 |
| **Ellington Loan Acquisition Trust** | | | | |
| 2,674 % fällig am 25.05.2037 | | 364 | 355 | 0,04 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.04.2036 (a)(d) | | 177 | 176 | 0,02 |
| 2,899 % fällig am 25.07.2034 | | 185 | 183 | 0,02 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 2,164 % fällig am 25.04.2036 | | 295 | 261 | 0,03 |
| 2,554 % fällig am 25.06.2035 ^ | | 700 | 643 | 0,08 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | | |
| 1,744 % fällig am 25.11.2036 | | 77 | 25 | 0,00 |
| **GSAMP Trust** | | | | |
| 1,674 % fällig am 25.12.2046 | | 25 | 14 | 0,00 |
| 1,714 % fällig am 25.01.2037 | | 44 | 28 | 0,00 |
| 1,944 % fällig am 25.05.2046 | | 3 | 3 | 0,00 |
| 2,104 % fällig am 25.06.2036 | $ | 209 | $ 128 | 0,02 |
| 2,104 % fällig am 25.08.2036 | | 609 | 512 | 0,06 |
| 2,359 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 90 | 89 | 0,01 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 2,719 % fällig am 25.05.2035 | | 89 | 87 | 0,01 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | |
| 2,004 % fällig am 25.06.2036 | | 28 | 28 | 0,00 |
| **IXIS Real Estate Capital Trust** | | | | |
| 2,254 % fällig am 25.02.2036 | | 10 | 10 | 0,00 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 1,814 % fällig am 25.03.2047 | | 151 | 150 | 0,02 |
| 1,884 % fällig am 25.06.2037 | | 126 | 126 | 0,02 |
| 1,924 % fällig am 25.07.2036 | | 670 | 340 | 0,04 |
| 1,924 % fällig am 25.03.2037 | | 400 | 377 | 0,05 |
| 2,144 % fällig am 25.07.2036 | | 203 | 199 | 0,03 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,164 % fällig am 25.05.2046 | | 561 | 201 | 0,03 |
| 2,224 % fällig am 25.02.2036 | | 927 | 796 | 0,10 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,824 % fällig am 25.08.2036 | | 3.797 | 1.265 | 0,16 |
| 1,924 % fällig am 25.03.2036 | | 1.090 | 981 | 0,12 |
| 2,314 % fällig am 25.03.2035 | | 205 | 205 | 0,03 |
| 2,374 % fällig am 25.12.2034 ^ | | 13 | 13 | 0,00 |
| 2,404 % fällig am 25.02.2034 | | 510 | 482 | 0,06 |
| 2,524 % fällig am 25.04.2034 | | 102 | 98 | 0,01 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.05.2037 | | 215 | 165 | 0,02 |
| 1,784 % fällig am 25.09.2036 | | 245 | 115 | 0,01 |
| 2,204 % fällig am 25.01.2035 | | 560 | 550 | 0,07 |
| 2,329 % fällig am 25.01.2035 | | 290 | 272 | 0,03 |
| 3,524 % fällig am 25.02.2047 | | 140 | 128 | 0,02 |
| **Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 3,199 % fällig am 25.11.2032 | | 25 | 25 | 0,00 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 4,624 % fällig am 25.01.2033 ^ | | 212 | 185 | 0,02 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,359 % fällig am 25.05.2035 | | 20 | 20 | 0,00 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.09.2037 | | 327 | 323 | 0,04 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,844 % fällig am 25.01.2037 | | 269 | 168 | 0,02 |
| 2,359 % fällig am 25.08.2035 | | 176 | 175 | 0,02 |
| **Park Place Securities, Inc.** | | | | |
| 2,329 % fällig am 25.09.2035 | | 245 | 248 | 0,03 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,344 % fällig am 25.08.2035 | | 46 | 47 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.09.2034 | | 26 | 26 | 0,00 |
| 3,424 % fällig am 25.12.2034 | | 473 | 463 | 0,06 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 5,340 % fällig am 25.01.2037 | | 1.341 | 525 | 0,07 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 2,314 % fällig am 25.11.2035 | | 152 | 150 | 0,02 |
| 2,329 % fällig am 25.09.2035 | | 707 | 681 | 0,08 |
| 2,509 % fällig am 25.01.2034 | | 42 | 41 | 0,01 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | | |
| 2,089 % fällig am 25.03.2036 | | 365 | 354 | 0,04 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 1,804 % fällig am 25.07.2036 | | 90 | 35 | 0,00 |
| 2,299 % fällig am 25.01.2035 | | 21 | 19 | 0,00 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 2,089 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 12.014 | 9.959 | 1,23 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 2,004 % fällig am 25.03.2036 | | 146 | 143 | 0,02 |
| 2,254 % fällig am 25.11.2035 | | 342 | 330 | 0,04 |
| 2,599 % fällig am 25.10.2033 | | 35 | 35 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.08.2037 | | 197 | 195 | 0,02 |
| **Structured Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 2,314 % fällig am 25.09.2035 | | 252 | 242 | 0,03 |
| **Truman Capital Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,884 % fällig am 25.03.2036 | | 751 | 744 | 0,09 |
| **WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust** | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.01.2037 | | 189 | 167 | 0,02 |
| | | | 46.804 | 5,77 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **ENERGIE** | | | | |
| **Constellation Oil Services Holding S.A. (c)(i)** | | 161.700 | $ 18 | 0,00 |
| **Noble Corp. (c)(i)** | | 34.182 | 866 | 0,11 |
| **Valaris Ltd. (c)** | | 7.498 | 317 | 0,04 |
| | | | 1.201 | 0,15 |
| Summe Stammaktien | | | 1.201 | 0,15 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | PARI (000S) | | |
| **American Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.04.2030 | $ | 75 | 68 | 0,01 |
| 3,150 % fällig am 15.08.2033 | | 89 | 79 | 0,01 |
| 3,200 % fällig am 15.12.2029 | | 742 | 680 | 0,08 |
| 3,350 % fällig am 15.04.2031 | | 235 | 217 | 0,03 |
| 3,375 % fällig am 01.11.2028 | | 456 | 409 | 0,05 |
| 3,575 % fällig am 15.07.2029 | | 369 | 343 | 0,04 |
| 3,650 % fällig am 15.12.2029 | | 445 | 369 | 0,05 |
| 3,650 % fällig am 15.08.2030 | | 227 | 212 | 0,03 |
| 3,700 % fällig am 01.04.2028 | | 60 | 52 | 0,01 |
| **Antares Holdings LP** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.01.2027 | | 250 | 200 | 0,02 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.12.2024 | | 1.100 | 1.091 | 0,14 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | |
| 3,557 % fällig am 15.08.2027 | | 200 | 183 | 0,02 |
| **British Airways Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.05.2034 | | 111 | 107 | 0,01 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | |
| 3,187 % fällig am 15.11.2036 | | 300 | 229 | 0,03 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.03.2028 | | 900 | 842 | 0,10 |
| 5,375 % fällig am 01.04.2038 | | 100 | 89 | 0,01 |
| **CommScope, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.09.2029 | | 7.200 | 5.828 | 0,72 |
| **DAE Funding LLC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 15.02.2024 | | 1.100 | 1.042 | 0,13 |
| 2,625 % fällig am 20.03.2025 | | 700 | 652 | 0,08 |
| 3,375 % fällig am 20.03.2028 | | 800 | 705 | 0,09 |
| **Delta Air Lines, Inc.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 01.05.2025 | | 1.227 | 1.244 | 0,15 |
| **El Paso Natural Gas Co. LLC** | | | | |
| 8,375 % fällig am 15.06.2032 | | 100 | 117 | 0,01 |
| **Energy Transfer LP** | | | | |
| 4,950 % fällig am 15.05.2028 | | 1.700 | 1.664 | 0,21 |
| 5,350 % fällig am 15.05.2045 | | 100 | 87 | 0,01 |
| 6,625 % fällig am 15.10.2036 | | 100 | 101 | 0,01 |
| 7,500 % fällig am 01.07.2038 | | 1.700 | 1.824 | 0,23 |
| **EnLink Midstream LLC** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.06.2029 | | 400 | 351 | 0,04 |
| **EQT Corp.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.02.2025 | | 6.200 | 6.391 | 0,79 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 0,346 % fällig am 01.12.2024 | € | 1.800 | 1.756 | 0,22 |
| 1,744 % fällig am 19.07.2024 | | 300 | 291 | 0,04 |
| 2,330 % fällig am 25.11.2025 | | 2.900 | 2.693 | 0,33 |
| 2,386 % fällig am 17.02.2026 | | 500 | 458 | 0,06 |
| 2,700 % fällig am 10.08.2026 | $ | 700 | 597 | 0,07 |
| 2,748 % fällig am 14.06.2024 | £ | 400 | 449 | 0,06 |
| 3,021 % fällig am 06.03.2024 | € | 1.300 | 1.306 | 0,16 |
| 3,250 % fällig am 15.09.2025 | | 200 | 192 | 0,02 |
| 3,350 % fällig am 01.11.2022 | $ | 2.300 | 2.288 | 0,28 |
| 3,375 % fällig am 13.11.2025 | | 300 | 271 | 0,03 |
| 4,063 % fällig am 01.11.2024 | | 2.600 | 2.474 | 0,31 |
| 4,950 % fällig am 28.05.2027 | | 200 | 186 | 0,02 |
| 5,584 % fällig am 18.03.2024 | | 600 | 598 | 0,07 |
| **Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.05.2028 | | 1.700 | 1.408 | 0,17 |
| 6,500 % fällig am 01.10.2025 | | 2.140 | 2.023 | 0,25 |
| **Freedom Mortgage Corp.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.01.2027 | | 1.400 | 1.040 | 0,13 |
| 7,625 % fällig am 01.05.2026 | | 3.400 | 2.657 | 0,33 |
| 8,250 % fällig am 15.04.2025 | | 1.582 | 1.334 | 0,17 |
| **Global Atlantic Fin Co.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 15.10.2029 | | 1.300 | 1.180 | 0,15 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **GLP Capital LP** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.06.2028 | $ | 600 | $ 587 | 0,07 |
| **Kinder Morgan Energy Partners LP** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.02.2037 | | 600 | 639 | 0,08 |
| 6,950 % fällig am 15.01.2038 | | 600 | 647 | 0,08 |
| **Las Vegas Sands Corp.** | | | | |
| 3,200 % fällig am 08.08.2024 | | 900 | 851 | 0,11 |
| 3,500 % fällig am 18.08.2026 | | 900 | 783 | 0,10 |
| 3,900 % fällig am 08.08.2029 | | 400 | 327 | 0,04 |
| **Midwest Connector Capital Co. LLC** | | | | |
| 3,900 % fällig am 01.04.2024 | | 200 | 196 | 0,02 |
| **MPT Operating Partnership LP** | | | | |
| 3,375 % fällig am 24.04.2030 | £ | 100 | 97 | 0,01 |
| 3,692 % fällig am 05.06.2028 | | 300 | 316 | 0,04 |
| **NGPL PipeCo LLC** | | | | |
| 7,768 % fällig am 15.12.2037 | $ | 2.340 | 2.551 | 0,32 |
| **Nielsen Finance LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.07.2029 | | 400 | 362 | 0,04 |
| **NuStar Logistics LP** | | | | |
| 5,625 % fällig am 28.04.2027 | | 1.800 | 1.614 | 0,20 |
| **Organon & Co.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 30.04.2028 | € | 4.800 | 4.217 | 0,52 |
| 1,367 % fällig am 10.03.2023 | $ | 1.700 | 1.675 | 0,21 |
| 2,500 % fällig am 01.02.2031 | | 100 | 77 | 0,01 |
| 3,150 % fällig am 01.01.2026 | | 600 | 550 | 0,07 |
| 3,300 % fällig am 15.03.2027 ^ | | 200 | 179 | 0,02 |
| 3,300 % fällig am 01.12.2027 ^ | | 100 | 87 | 0,01 |
| 3,300 % fällig am 01.08.2040 | | 2.400 | 1.658 | 0,21 |
| 3,450 % fällig am 01.07.2025 | | 300 | 282 | 0,04 |
| 3,500 % fällig am 15.06.2025 ^ | | 200 | 190 | 0,02 |
| 3,750 % fällig am 15.02.2024 ^ | | 100 | 98 | 0,01 |
| 3,750 % fällig am 01.07.2028 | | 300 | 265 | 0,03 |
| 3,950 % fällig am 01.12.2047 ^ | | 100 | 69 | 0,01 |
| 4,200 % fällig am 01.06.2041 | | 100 | 73 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 01.08.2023 | | 200 | 199 | 0,02 |
| 4,250 % fällig am 15.03.2046 ^ | | 100 | 73 | 0,01 |
| 4,450 % fällig am 15.04.2042 ^ | | 200 | 151 | 0,02 |
| 4,500 % fällig am 01.07.2040 | | 1.050 | 815 | 0,10 |
| 4,550 % fällig am 01.07.2030 | | 600 | 534 | 0,07 |
| 4,600 % fällig am 15.06.2043 ^ | | 300 | 229 | 0,03 |
| 4,650 % fällig am 01.08.2028 | | 400 | 371 | 0,05 |
| **Piper Sandler Cos.** | | | | |
| 5,200 % fällig am 15.10.2023 | | 600 | 592 | 0,07 |
| **Plains All American Pipeline LP** | | | | |
| 4,900 % fällig am 15.02.2045 | | 2.100 | 1.693 | 0,21 |
| 5,150 % fällig am 01.06.2042 | | 1.800 | 1.515 | 0,19 |
| 6,650 % fällig am 15.01.2037 | | 800 | 800 | 0,10 |
| **RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.** | | | | |
| 9,750 % fällig am 01.12.2026 | | 700 | 682 | 0,08 |
| **RLJ Lodging Trust LP** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.07.2026 | | 200 | 174 | 0,02 |
| **Rockies Express Pipeline LLC** | | | | |
| 4,800 % fällig am 15.05.2030 | | 1.000 | 834 | 0,10 |
| 4,950 % fällig am 15.07.2029 | | 500 | 428 | 0,05 |
| **Service Properties Trust** | | | | |
| 4,350 % fällig am 01.10.2024 | | 300 | 244 | 0,03 |
| **Sprint Corp.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.09.2023 | | 100 | 103 | 0,01 |
| **Standard Industries, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 21.11.2026 | € | 3.000 | 2.463 | 0,30 |
| **Tallgrass Energy Partners LP** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2028 | $ | 700 | 596 | 0,07 |
| 6,000 % fällig am 31.12.2030 | | 700 | 582 | 0,07 |
| **Time Warner Cable LLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.11.2040 | | 800 | 735 | 0,09 |
| 6,750 % fällig am 15.06.2039 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **U.S. Airways Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.05.2027 | | 191 | 174 | 0,02 |
| **United Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,900 % fällig am 01.11.2029 | | 90 | 80 | 0,01 |
| 3,450 % fällig am 01.06.2029 | | 142 | 133 | 0,02 |
| 3,450 % fällig am 07.01.2030 | | 153 | 133 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 01.09.2031 | | 167 | 153 | 0,02 |
| 4,150 % fällig am 11.10.2025 | | 334 | 328 | 0,04 |
| 5,875 % fällig am 15.04.2029 | | 3.811 | 3.751 | 0,46 |
| **VICI Properties LP** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.02.2025 | | 300 | 281 | 0,03 |
| **Vistra Operations Co. LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.02.2027 | $ | 23 | $ 22 | 0,00 |
| **Wynn Resorts Finance LLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.10.2029 | | 1.300 | 1.026 | 0,13 |
| | | | 86.761 | 10,71 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Adient U.S. LLC** | | | | |
| 4,916 % fällig am 10.04.2028 | | 396 | 370 | 0,05 |
| **Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC** | | | | |
| 3,845 % fällig am 01.12.2027 | | 2.167 | 2.065 | 0,26 |
| **CenturyLink, Inc.** | | | | |
| 3,916 % fällig am 15.03.2027 | | 3.977 | 3.663 | 0,45 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 3,420 % fällig am 01.02.2027 | | 6.245 | 5.974 | 0,74 |
| **CommScope, Inc.** | | | | |
| 4,916 % fällig am 06.04.2026 | | 486 | 439 | 0,05 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | |
| 3,374 % fällig am 22.06.2026 | | 5.185 | 4.979 | 0,61 |
| **INEOS Finance PLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.04.2024 | € | 9.743 | 9.750 | 1,20 |
| **Level 3 Financing, Inc.** | | | | |
| 3,416 % fällig am 01.03.2027 | $ | 4.163 | 3.869 | 0,48 |
| **Nielsen Finance LLC** | | | | |
| 3,190 % fällig am 04.10.2023 | | 1.283 | 1.277 | 0,16 |
| **Standard Industries, Inc.** | | | | |
| 3,788 % fällig am 22.09.2028 | | 1.334 | 1.293 | 0,16 |
| | | | 33.679 | 4,16 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Banc of America Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,024 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 96 | 74 | 0,01 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 3,461 % fällig am 20.01.2047 ^ | | 47 | 44 | 0,01 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 6,250 % fällig am 26.08.2036 | | 1.965 | 1.063 | 0,13 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,400 % fällig am 25.02.2036 | | 7 | 7 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,470 % fällig am 25.10.2035 | | 74 | 71 | 0,01 |
| 2,679 % fällig am 25.10.2046 ^ | | 23 | 22 | 0,00 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,956 % fällig am 25.01.2036 | | 12 | 11 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 3 | 2 | 0,00 |
| 2,032 % fällig am 20.05.2046 ^ | | 309 | 265 | 0,03 |
| 2,124 % fällig am 25.04.2036 | | 568 | 222 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 141 | 86 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 864 | 461 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 206 | 133 | 0,02 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 1,436 % fällig am 25.04.2046 ^ | | 17 | 6 | 0,00 |
| 2,164 % fällig am 25.04.2046 | | 1.725 | 550 | 0,07 |
| 3,044 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 11 | 10 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 356 | 178 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 | | 67 | 31 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 109 | 50 | 0,01 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 25.04.2033 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | | |
| 2,502 % fällig am 26.04.2038 | | 129 | 129 | 0,02 |
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,612 % fällig am 25.09.2035 | | 13 | 12 | 0,00 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,052 % fällig am 19.05.2035 | | 157 | 145 | 0,02 |
| 2,092 % fällig am 19.06.2035 | | 4 | 3 | 0,00 |
| 2,152 % fällig am 20.10.2045 | | 392 | 365 | 0,04 |
| 2,232 % fällig am 19.11.2035 | | 7 | 6 | 0,00 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | | |
| 2,064 % fällig am 25.11.2035 | | 1.500 | 1.396 | 0,17 |
| **Impac Secured Assets Trust** | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 3 | 3 | 0,00 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,984 % fällig am 25.07.2047 | | 59 | 43 | 0,01 |
| 2,810 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 12 | 10 | 0,00 |
| 2,938 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 2 | 2 | 0,00 |
| **Lehman Mortgage Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 106 | 101 | 0,01 |
| **Luminent Mortgage Trust** | | | | |
| 2,024 % fällig am 25.10.2046 | $ | 759 | $ 691 | 0,08 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 2,284 % fällig am 25.11.2029 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 3,235 % fällig am 25.05.2036 | | 4 | 3 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,118 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 38 | 28 | 0,00 |
| **Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust** | | | | |
| 3,058 % fällig am 25.08.2035 | | 1 | 1 | 0,00 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 2,024 % fällig am 25.05.2047 | | 67 | 62 | 0,01 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,064 % fällig am 25.06.2037 | | 232 | 210 | 0,03 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 2,024 % fällig am 25.05.2036 | | 482 | 412 | 0,05 |
| 2,044 % fällig am 25.09.2047 ^ | | 632 | 703 | 0,09 |
| **SunTrust Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,274 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 2 | 2 | 0,00 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,874 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 11 | 10 | 0,00 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 1,676 % fällig am 25.11.2042 | | 8 | 8 | 0,00 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 4,057 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 129 | 43 | 0,01 |
| | | | 7.675 | 0,95 |
| Summe USA | | | 176.120 | 21,74 |
| **VENEZUELA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Petroleos de Venezuela S.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 16.05.2024 ^ | | 1.600 | 100 | 0,01 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Venezuela Government International Bond** | | | | |
| 6,000 % fällig am 09.12.2020 ^ | | 241 | 19 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 31.03.2038 ^ | | 1.528 | 134 | 0,02 |
| 7,750 % fällig am 13.10.2019 ^ | | 1.900 | 147 | 0,02 |
| | | | 300 | 0,04 |
| Summe Venezuela | | | 400 | 0,05 |
| **JUNGFERNINSELN (BRITISCH)** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Champion Path Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 27.01.2026 | | 500 | 318 | 0,04 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | | |
| **Pacific Gas and Electric Co.** | | | | |
| 2,370 % fällig am 14.11.2022 | | 600 | 598 | 0,07 |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | | |
| 51,049 % fällig am 30.09.2022 (d)(e) | ARS | 12.000 | 40 | 0,01 |
| **U.S. TREASURY BILLS** | | | | |
| 0,680 % fällig am 07.07.2022 (d)(e) | $ | 4.100 | 4.099 | 0,51 |
| 0,797 % fällig am 14.07.2022 (d)(e) | | 24.600 | 24.591 | 3,03 |
| 0,904 % fällig am 28.07.2022 (d)(e)(k) | | 14.400 | 14.388 | 1,78 |
| 1,416 % fällig am 04.10.2022 (d)(e) | | 5.500 | 5.474 | 0,67 |
| | | | 48.552 | 5,99 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 49.190 | 6,07 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **$ 611.183** | **75,44** |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (g) | 250.000 | $ 2.122 | 0,26 |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (g) | 651.264 | 5.562 | 0,69 |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (g) | 538.168 | 5.261 | 0,65 |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (g) | 3.511.468 | $ 34.939 | 4,31 |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g) | 752.093 | 7.482 | 0,93 |
| | | 55.366 | 6,84 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g) | 258.970 | $ 25.624 | 3,16 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$ 80.990** | **10,00** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 7.873 | U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | $ (8.031) | $ 7.873 | $ 7.873 | 0,97 |
| NOM | 1,480 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 73.000 | U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.11.2025 | (74.656) | 73.000 | 73.003 | 9,01 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (82.687)** | **$ 80.873** | **$ 80.876** | **9,98** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09.2022 | 409 | $ 832 | 0,10 |
| Euro-Schatz September Futures | Short | 09.2022 | 924 | 420 | 0,05 |
| | | | | $ 1.252 | 0,15 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 1.252** | **0,15** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20.06.2026 | $ 2.200 | $ (43 ) | (0,01) |
| Auchan Holding S.A. | 1,000 | 20.12.2027 | € 200 | (16 ) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.12.2026 | $ 500 | (28 ) | 0,00 |
| Casino Guichard Perrachon S.A. | 5,000 | 20.12.2022 | € 1.100 | 29 | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.06.2027 | $ 800 | (33 ) | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2026 | 6.100 | (164 ) | (0,02) |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2026 | 600 | (24 ) | 0,00 |
| Glencore Finance Europe Ltd. | 5,000 | 20.12.2025 | € 3.300 | (382 ) | (0,05) |
| Glencore Finance Europe Ltd. | 5,000 | 20.12.2027 | 2.200 | (342 ) | (0,04) |
| Marks & Spencer PLC | 1,000 | 20.12.2024 | 4.100 | 40 | 0,01 |
| Marks & Spencer PLC | 1,000 | 20.06.2027 | 100 | (5 ) | 0,00 |
| Marks & Spencer PLC | 1,000 | 20.12.2028 | 800 | (89 ) | (0,01) |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.12.2024 | 4.000 | (209 ) | (0,03) |
| | | | | $ (1.266 ) | (0,15) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-34 5-Year Index | 1,000 % | 20.12.2025 | $ 17.500 | $ (1.543) | (0,19) |
| CDX.EM-35 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2026 | 300 | (26) | 0,00 |
| CDX.EM-36 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 75.200 | (6.783) | (0,84) |
| CDX.IG-37 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 3.600 | (41) | (0,01) |
| CDX.IG-38 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 75.600 | (883) | (0,11) |
| iTraxx Crossover 37 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2027 | € 47.500 | (4.085) | (0,50) |
| iTraxx Europe Main 36 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 2.500 | (17) | 0,00 |
| iTraxx Europe Main 37 10-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 4.900 | (59) | (0,01) |
| | | | | $ (13.437) | (1,66) |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 % | 21.09.2027 | £ | 24.300 | $ 450 | 0,05 |
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2032 | | 100 | 8 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,050 | 15.12.2031 | ¥ | 1.920.000 | 47 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 | 15.06.2027 | $ | 13.200 | 2 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2032 | | 5.500 | (134) | (0,02) |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2052 | | 1.600 | (37) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,000 | 16.12.2030 | | 60.700 | 9.738 | 1,20 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 17.06.2025 | | 73.700 | 7.185 | 0,89 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 16.12.2050 | | 5.220 | 1.425 | 0,18 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 16.06.2051 | | 8.700 | 1.310 | 0,16 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 17.06.2050 | | 6.700 | 2.759 | 0,34 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 | 21.12.2026 | | 83.500 | 7.180 | 0,89 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2052 | € | 7.300 | 1.672 | 0,21 |
| | | | | | | $ 31.605 | 3,90 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | | **$ 16.902** | **2,09** |

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

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

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

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

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

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 % | 20.07.2022 | 1.700 | $ (3) | $ (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Crossover 36 5-Year Index | Verkauf | 5,250 | 20.07.2022 | 900 | (9) | (18) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 2.400 | (13) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 5.700 | (16) | (19) | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 1.500 | (3) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Kauf | 0,700 | 17.08.2022 | 1.900 | (2) | 0 | 0,00 |
| BRC | Put - OTC CDX.IG-37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 2.500 | (6) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 2.400 | (22) | (27) | (0,01) |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 2.400 | (12) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,600 | 17.08.2022 | 1.000 | (2) | (2) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 700 | (1) | (1) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 1.500 | (3) | (2) | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,300 | 17.08.2022 | 2.000 | (4) | (3) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 95,000 | 17.08.2022 | 300 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,100 | 20.07.2022 | 2.900 | (11) | (11) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 1.500 | (5) | (5) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,250 | 20.07.2022 | 1.100 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,350 | 17.08.2022 | 1.600 | (4) | (2) | 0,00 |
| | | | | | | $ (122) | $ (108) | (0,01) |

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,000 % | 01.07.2022 | 11.700 | $ (52) | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,800 | 01.07.2022 | 11.700 | (53) | (16) | 0,00 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,840 | 05.07.2022 | 10.500 | (41) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 1,520 | 05.07.2022 | 10.500 | (40) | (157) | (0,02) |
| | | | | | | | $ (186) | $ (173) | (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 | Nenn-betrag[2] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2031 | $ 5.500 | $ (236) | $ (146) | $ (382) | (0,05) |
| GST | ADLER Real Estate AG | 5,000 | 20.12.2026 | € 700 | (5) | (230) | (235) | (0,03) |
| JPM | Casino Guichard Perrachon S.A. | 5,000 | 20.12.2022 | 300 | 12 | (29) | (17) | 0,00 |
| | Hochtief AG | 5,000 | 20.12.2026 | 2.700 | 643 | (394) | 249 | 0,03 |
| | | | | | $ 414 | $ (799) | $ (385) | (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.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | £ | 28.037 | $ | 35.450 | $ 1.400 | $ 0 | $ 1.400 | 0,17 |
| | 08.2022 | IDR | 185.812 | | 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10.2022 | ZAR | 57 | | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | BRL | 1.773 | | 370 | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 23.500 | | 182 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 240.533 | € | 228.625 | 0 | (1.518) | (1.518) | (0,19) |
| | 07.2022 | | 944 | £ | 759 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 215.370 | $ | 226.939 | 1.365 | 0 | 1.365 | 0,17 |
| | 08.2022 | IDR | 76.732.683 | | 5.275 | 150 | 0 | 150 | 0,02 |
| | 10.2022 | ZAR | 7.456 | | 451 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | NOK | 87.685 | | 8.944 | 69 | 0 | 69 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 8.944 | NOK | 87.646 | 0 | (68) | (68) | (0,01) |
| DUB | 07.2022 | | 11 | PLN | 48 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10.2022 | | 5.451 | ZAR | 84.052 | 0 | (375) | (375) | (0,05) |
| GLM | 07.2022 | BRL | 7.378 | $ | 1.424 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 4.168 | BRL | 21.003 | 0 | (152) | (152) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 5.138 | MXN | 104.931 | 54 | 0 | 54 | 0,01 |
| | 08.2022 | | 1.412 | BRL | 7.378 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 10.2022 | | 34 | MXN | 689 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 08.2022 | CNH | 6.339 | $ | 943 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 3.634 | IDR | 53.450.858 | 0 | (64) | (64) | (0,01) |
| MBC | 07.2022 | AUD | 13.380 | $ | 9.215 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 07.2022 | NOK | 3.370 | | 360 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 3.028 | € | 2.910 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 14.421 | $ | 2.148 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 9.216 | AUD | 13.380 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 533 | CNH | 3.567 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.604 | IDR | 23.513.699 | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| | 05.2023 | CNH | 16.100 | $ | 2.399 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | BRL | 11.852 | | 2.299 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 11 | € | 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.423 | £ | 1.999 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 382.562 | $ | 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 2.281 | BRL | 11.852 | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| SCX | 08.2022 | CNH | 25.581 | $ | 3.819 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | € | 231.535 | | 248.856 | 6.798 | 0 | 6.798 | 0,84 |
| | 07.2022 | $ | 33.197 | £ | 27.278 | 0 | (70) | (70) | (0,01) |
| | 08.2022 | £ | 27.278 | $ | 33.213 | 69 | 0 | 69 | 0,01 |
| UAG | 07.2022 | $ | 9.557 | AUD | 13.380 | 0 | (356) | (356) | (0,04) |
| | 07.2022 | | 9.659 | NOK | 91.083 | 0 | (440) | (440) | (0,05) |
| | 09.2022 | MXN | 103.972 | $ | 5.218 | 125 | 0 | 125 | 0,01 |
| | | | | | | $ 10.173 | $ (3.171) | $ 7.002 | 0,86 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend II, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | € | 2 | $ | 2 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 60 | € | 56 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | € | 86.973 | $ | 91.452 | 526 | 0 | 526 | 0,06 |
| | 07.2022 | $ | 9.794 | € | 9.101 | 0 | (279) | (279) | (0,03) |
| | 08.2022 | | 70.442 | | 66.851 | 0 | (423) | (423) | (0,05) |
| CBK | 07.2022 | € | 870 | $ | 934 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | | 74.935 | | 78.757 | 447 | (31) | 416 | 0,05 |
| | 07.2022 | $ | 80.371 | € | 74.528 | 0 | (2.455) | (2.455) | (0,30) |
| | 08.2022 | | 70.456 | | 66.851 | 0 | (437) | (437) | (0,05) |
| SOG | 07.2022 | | 79.941 | | 74.377 | 0 | (2.184) | (2.184) | (0,27) |
| UAG | 07.2022 | | 72.067 | | 67.064 | 0 | (1.955) | (1.955) | (0,24) |
| | | | | | | $ 997 | $ (7.766) | $ (6.769) | (0,83) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | £ | 1.601 | $ | 2.008 | $ 65 | $ 0 | $ 65 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 192.180 | £ | 151.994 | 0 | (7.589) | (7.589) | (0,94) |
| BPS | 07.2022 | £ | 11.979 | $ | 14.673 | 132 | (7) | 125 | 0,01 |
| BRC | 07.2022 | | 3.414 | | 4.168 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 192.179 | £ | 152.349 | 0 | (7.159) | (7.159) | (0,88) |
| CBK | 07.2022 | | 3.942 | | 3.140 | 0 | (129) | (129) | (0,02) |
| MBC | 07.2022 | £ | 24.351 | $ | 29.971 | 397 | 0 | 397 | 0,05 |
| MYI | 07.2022 | | 243 | | 293 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 35 | | 43 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 7.999 | £ | 6.363 | 0 | (272) | (272) | (0,03) |
| SOG | 07.2022 | £ | 137.513 | $ | 167.353 | 351 | 0 | 351 | 0,04 |
| | 08.2022 | $ | 167.431 | £ | 137.513 | 0 | (348) | (348) | (0,04) |
| TOR | 07.2022 | | 190.435 | | 151.053 | 0 | (6.989) | (6.989) | (0,86) |
| | | | | | | $ 967 | $ (22.495) | $ (21.528) | (2,66) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (21.961)** | **(2,71)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 769.239** | **94,95** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ 40.914** | **5,05** |
| **Nettovermögen** | **$ 810.153** | **100,00** |

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

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

**^** **Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a)** **Reines Kapitalwertpapier.**

**(b)** **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

**(c)** **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

**(d)** **Nullkuponwertpapier.**

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

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

**(g)** **Mit dem Fonds verbunden.**

**(h)** **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(i)** **Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|
| Constellation Oil Services Holding S.A. | 10.06.2022 | $ 18 | $ 18 | 0,00 |
| Deutsche Bank AG 3,035 % fällig am 28.05.2032 | 29.07.2021 | 309 | 238 | 0,03 |
| Intelsat Emergence S.A. | 24.02.2020 - 01.05.2020 | 1.289 | 403 | 0,05 |
| Noble Corp. | 05.02.2021 - 08.02.2021 | 356 | 866 | 0,11 |
| | | $ 1.972 | $ 1.525 | 0,19 |

**(l)** **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.212 und Barmittel in Höhe von USD 10 als Sicherheiten verpfändet.**

**(k)** **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 138 und Barmittel in Höhe von USD 25.557 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von USD 33.536 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 1.183 | $ 609.460 | $ 540 | $ 611.183 |
| Investmentfonds | 55.366 | 25.624 | 0 | 80.990 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 80.873 | 0 | 80.873 |
| Finanzderivate[3] | 1.252 | (5.059) | 0 | (3.807) |
| **Summen** | **$ 57.801** | **$ 710.898** | **$ 540** | **$ 769.239** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 1.027 | $ 1.091.334 | $ 1.166 | $ 1.093.527 |
| Investmentfonds | 126.929 | 0 | 0 | 126.929 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 58.930 | 0 | 58.930 |
| Finanzderivate[3] | 802 | 29.107 | 0 | 29.909 |
| **Totals** | **$ 128.758** | **$ 1.179.371** | **$ 1.166** | **$ 1.309.295** |

(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 2022:**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | (2,000) % | 20.05.2022 | TBD[1] | € (1.400) | $ (1.460) | (0,18) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (1.460)** | **(0,18)** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (6.169) | $ 6.310 | $ 141 |
| BPS | (36) | 0 | (36) |
| BRC | (7.553) | 7.018 | (535) |
| CBK | (279) | 370 | 91 |
| DUB | (377) | 340 | (37) |
| GLM | (99) | 0 | (99) |
| GST | (238) | 0 | (238) |
| JPM | 146 | (290) | (144) |
| MBC | (2.088) | 1.598 | (490) |
| MYC | (3) | 0 | (3) |
| MYI | 1 | 9 | 10 |
| SCX | (267) | 270 | 3 |
| SOG | 4.616 | (4.770) | (154) |
| TOR | (6.989) | 7.320 | 331 |
| UAG | (2.626) | 2.460 | (166) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 43,56 | 52,29 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 28,09 | 28,84 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 3,79 | 2,65 |
| Investmentfonds | 10,00 | 9,72 |
| Pensionsgeschäfte | 9,98 | 4,51 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,15 | 0,06 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 2,09 | 1,24 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (2,71) | 1,00 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (0,18) | (0,37) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Albanien | k. A. | 0,07 |
| Argentinien | 0,62 | 0,63 |
| Australien | 0,02 | 0,04 |
| Österreich | k. A. | 0,27 |
| Weissrussland | 0,01 | 0,05 |
| Bermuda | 0,64 | 0,52 |
| Brasilien | 0,18 | 0,45 |
| Kanada | 0,39 | 0,32 |
| Cayman-Inseln | 3,22 | 3,02 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Chile | 0,06 | 0,14 |
| China | 0,09 | 0,37 |
| Kolumbien | 0,46 | 0,47 |
| Dänemark | 0,13 | k. A. |
| Dominikanische Republik | 0,51 | 0,62 |
| Ecuador | 0,16 | 0,27 |
| Ägypten | 0,47 | 0,72 |
| Finnland | 0,02 | k. A. |
| Frankreich | 3,68 | 3,85 |
| Deutschland | 2,54 | 2,93 |
| Ghana | 0,07 | 0,12 |
| Guernsey, Kanalinseln | 0,55 | 0,53 |
| Hongkong | 1,28 | 1,33 |
| Indien | 0,04 | 0,03 |
| Indonesien | 0,03 | 1,49 |
| Irland | 3,53 | 3,35 |
| Insel Man | k. A. | 0,29 |
| Israel | k. A. | 0,07 |
| Italien | 4,65 | 4,64 |
| Elfenbeinküste | 0,11 | 0,28 |
| Japan | 1,01 | 0,86 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,54 | 0,47 |
| Jordanien | k. A. | 0,06 |
| Liberia | k. A. | 0,11 |
| Luxemburg | 5,31 | 4,89 |
| Mazedonien | 0,04 | 0,06 |
| Mauritius | 0,16 | 0,11 |
| Mexiko | 1,64 | 2,03 |
| Marokko | k. A. | 0,03 |
| Multinational | 0,41 | 0,54 |
| Niederlande | 4,53 | 3,48 |
| Nigeria | 0,36 | 0,38 |
| Oman | 0,32 | 0,58 |
| Panama | k. A. | 0,16 |
| Peru | k. A. | 0,26 |
| Katar | 0,20 | 1,05 |
| Rumänien | 0,14 | 0,29 |
| Saudi-Arabien | k. A. | 1,07 |
| Serbien | k. A. | 0,07 |
| Slowenien | 0,23 | 0,06 |
| Südafrika | 0,13 | 0,38 |
| Spanien | 0,28 | 0,36 |
| Sri Lanka | 0,09 | 0,09 |
| Supranational | 0,06 | 0,06 |
| Schweden | 0,31 | 0,03 |
| Schweiz | 1,60 | 1,16 |
| Tunesien | k. A. | 0,03 |
| Türkei | 0,71 | 1,26 |
| Ukraine | 0,18 | 0,60 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 0,13 | 0,30 |
| Großbritannien | 5,70 | 7,12 |
| USA | 21,74 | 19,04 |
| Venezuela | 0,05 | 0,02 |
| Jungferninseln (Britisch) | 0,04 | 0,04 |
| Kurzfristige Instrumente | 6,07 | 9,85 |
| Investmentfonds | 10,00 | 9,72 |
| Pensionsgeschäfte | 9,98 | 4,51 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,15 | 0,06 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,15) | 0,03 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (1,66) | (0,01) |
| Zinsswaps | 3,90 | 1,22 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,01) | 0,00 |
| Zinsswapoptionen | (0,02) | k. A. |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,05) | 0,03 |
| Devisenterminkontrakte | 0,86 | (0,31) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (3,49) | 1,28 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 5,05 | (0,30) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | | |
| **AAdvantage Loyalty IP Ltd.** | | | | | |
| 5,813 % fällig am 20.04.2028 | $ | 900 | $ | 862 | 0,03 |
| **Adient U.S. LLC** | | | | | |
| 4,916 % fällig am 10.04.2028 | | 1.584 | | 1.480 | 0,06 |
| **At Home Group, Inc.** | | | | | |
| 4,967 % fällig am 24.07.2028 | | 1.294 | | 1.010 | 0,04 |
| **BCP Modular Services Holdings Ltd.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.12.2028 | € | 4.900 | | 4.596 | 0,19 |
| **Caesars Resort Collection LLC** | | | | | |
| 4,416 % fällig am 23.12.2024 | $ | 4.451 | | 4.297 | 0,18 |
| 5,166 % fällig am 21.07.2025 | | 6.019 | | 5.818 | 0,24 |
| **Carnival Corp.** | | | | | |
| 5,877 % fällig am 30.06.2025 | | 2.646 | | 2.470 | 0,10 |
| **Delos Finance SARL** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 06.10.2023 | | 3.220 | | 3.188 | 0,13 |
| **Hertz Corp.** | | | | | |
| 4,920 % fällig am 30.06.2028 | | 2.822 | | 2.663 | 0,11 |
| **Hilton Grand Vacations Borrower LLC** | | | | | |
| 4,666 % fällig am 02.08.2028 | | 1.588 | | 1.489 | 0,06 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | | |
| 3,374 % fällig am 22.06.2026 | | 4.774 | | 4.584 | 0,19 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | | |
| 4,920 % fällig am 01.02.2029 | | 397 | | 364 | 0,01 |
| **IRB Holding Corp.** | | | | | |
| 4,238 % fällig am 15.12.2027 | | 1.827 | | 1.743 | 0,07 |
| 4,416 % fällig am 05.02.2025 | | 4.068 | | 3.869 | 0,16 |
| **MPH Acquisition Holdings LLC** | | | | | |
| 5,825 % fällig am 01.09.2028 | | 4.466 | | 4.129 | 0,17 |
| **Organon & Co.** | | | | | |
| 4,625 % fällig am 02.06.2028 | | 2.793 | | 2.692 | 0,11 |
| **RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.** | | | | | |
| 5,416 % fällig am 16.11.2025 | | 4.479 | | 4.189 | 0,17 |
| **Starfruit Finco BV** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 01.10.2025 | € | 5.476 | | 5.256 | 0,22 |
| **U.S. Foods, Inc.** | | | | | |
| 4,325 % fällig am 22.11.2028 | $ | 3.980 | | 3.798 | 0,16 |
| **United Airlines, Inc.** | | | | | |
| 5,392 % fällig am 21.04.2028 | | 1.481 | | 1.379 | 0,06 |
| **Zayo Group Holdings, Inc.** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 09.03.2027 | € | 1.955 | | 1.809 | 0,07 |
| 4,666 % fällig am 09.03.2027 | $ | 6.204 | | 5.570 | 0,23 |
| | | | | 67.255 | 2,76 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 22.09.2025 (f)(h) | € | 700 | | 650 | 0,03 |
| **Acef Holding S.C.A.** | | | | | |
| 1,250 % fällig am 26.04.2030 | | 2.000 | | 1.576 | 0,06 |
| **ADLER Group S.A.** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 27.04.2027 | | 4.300 | | 2.185 | 0,09 |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | | |
| 2,450 % fällig am 29.10.2026 | $ | 500 | | 436 | 0,02 |
| 3,000 % fällig am 29.10.2028 | | 200 | | 169 | 0,01 |
| 3,300 % fällig am 23.01.2023 | | 2.450 | | 2.441 | 0,10 |
| 4,450 % fällig am 01.10.2025 | | 150 | | 145 | 0,01 |
| **AGFC Capital Trust** | | | | | |
| 2,794 % fällig am 15.01.2067 | | 2.500 | | 1.366 | 0,06 |
| **Altarea S.C.A.** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 16.01.2030 | € | 1.800 | | 1.343 | 0,05 |
| 1,875 % fällig am 17.01.2028 | | 1.700 | | 1.416 | 0,06 |
| **AMCO - Asset Management Co. SpA** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 17.07.2023 | | 1.800 | | 1.889 | 0,08 |
| 2,250 % fällig am 17.07.2027 | | 2.600 | | 2.604 | 0,11 |
| **American Tower Corp.** | | | | | |
| 0,400 % fällig am 15.02.2027 | | 3.100 | | 2.796 | 0,11 |
| **Annington Funding PLC** | | | | | |
| 2,308 % fällig am 06.10.2032 | £ | 1.000 | | 980 | 0,04 |
| 2,924 % fällig am 06.10.2051 | | 2.200 | | 1.797 | 0,07 |
| **Antares Holdings LP** | | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.07.2026 | $ | 1.600 | | 1.391 | 0,06 |
| **Argan S.A.** | | | | | |
| 1,011 % fällig am 17.11.2026 | € | 4.300 | | 3.676 | 0,15 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | | |
| 0,375 % fällig am 15.04.2027 | € | 600 | $ | 490 | 0,02 |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | $ | 13.200 | | 12.234 | 0,50 |
| **Ascendas Real Estate Investment Trust** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 23.06.2028 | € | 3.200 | | 2.691 | 0,11 |
| **Atrium Finance Issuer BV** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.09.2027 | | 3.000 | | 2.539 | 0,10 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.11.2027 | $ | 3.600 | | 3.180 | 0,13 |
| 3,875 % fällig am 01.05.2023 | | 300 | | 298 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 15.12.2024 | | 200 | | 198 | 0,01 |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | | |
| 2,528 % fällig am 18.11.2027 | | 4.290 | | 3.501 | 0,14 |
| **Balder Finland Oyj** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 18.01.2027 | € | 1.800 | | 1.371 | 0,06 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 24.09.2024 | | 400 | | 387 | 0,02 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 14.04.2026 | £ | 4.400 | | 4.812 | 0,20 |
| 4,375 % fällig am 14.01.2026 (f)(h) | € | 3.200 | | 2.824 | 0,12 |
| **Bank of America Corp.** | | | | | |
| 3,550 % fällig am 05.03.2024 | $ | 2.200 | | 2.194 | 0,09 |
| 3,864 % fällig am 23.07.2024 | | 5.300 | | 5.280 | 0,22 |
| 4,125 % fällig am 22.01.2024 | | 5.050 | | 5.108 | 0,21 |
| **Bank of Ireland Group PLC** | | | | | |
| 7,500 % fällig am 19.05.2025 (f)(h) | € | 3.700 | | 3.844 | 0,16 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (h) | $ | 1.659 | | 1.676 | 0,07 |
| **Barclays PLC** | | | | | |
| 2,894 % fällig am 24.11.2032 | | 4.100 | | 3.300 | 0,14 |
| 3,330 % fällig am 24.11.2042 | | 3.600 | | 2.682 | 0,11 |
| 3,375 % fällig am 02.04.2025 | € | 1.100 | | 1.159 | 0,05 |
| 6,375 % fällig am 15.12.2025 (f)(h) | £ | 1.700 | | 1.905 | 0,08 |
| 7,125 % fällig am 15.06.2025 (f)(h) | | 200 | | 234 | 0,01 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (f)(h) | | 2.500 | | 2.993 | 0,12 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (f)(h) | $ | 600 | | 591 | 0,02 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2022 (f)(h) | £ | 200 | | 242 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 15.06.2024 (f)(h) | $ | 400 | | 394 | 0,02 |
| **Bevco Lux SARL** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 16.01.2030 | € | 4.400 | | 3.639 | 0,15 |
| **Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL** | | | | | |
| 1,250 % fällig am 26.04.2027 | | 2.100 | | 1.829 | 0,07 |
| 2,000 % fällig am 15.02.2024 | | 1.100 | | 1.118 | 0,05 |
| **Blue Owl Finance LLC** | | | | | |
| 3,125 % fällig am 10.06.2031 | $ | 4.500 | | 3.478 | 0,14 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | | |
| 1,904 % fällig am 30.09.2028 | | 11.800 | | 10.094 | 0,41 |
| 2,000 % fällig am 13.09.2036 | £ | 2.100 | | 1.822 | 0,07 |
| 2,125 % fällig am 23.01.2027 | € | 2.400 | | 2.412 | 0,10 |
| 4,400 % fällig am 14.08.2028 | $ | 4.800 | | 4.598 | 0,19 |
| **BPCE S.A.** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 13.10.2046 (h) | € | 3.800 | | 2.863 | 0,12 |
| **Brown & Brown, Inc.** | | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.09.2024 | $ | 7.500 | | 7.480 | 0,31 |
| **CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 27.01.2028 | € | 2.000 | | 1.730 | 0,07 |
| 0,900 % fällig am 12.10.2029 | | 2.300 | | 1.905 | 0,08 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | | |
| 3,010 % fällig am 01.09.2023 | $ | 4.200 | | 4.196 | 0,17 |
| 3,200 % fällig am 21.10.2026 | | 1.500 | | 1.428 | 0,06 |
| 3,290 % fällig am 17.03.2026 (j) | | 4.300 | | 4.162 | 0,17 |
| 4,044 % fällig am 01.06.2024 | | 4.000 | | 3.991 | 0,16 |
| 4,658 % fällig am 24.05.2028 | | 900 | | 894 | 0,04 |
| **Citycon Treasury BV** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 12.03.2028 | € | 2.600 | | 2.004 | 0,08 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 26.09.2023 | $ | 1.100 | | 1.099 | 0,04 |
| 4,375 % fällig am 29.06.2027 (f)(h) | € | 1.800 | | 1.660 | 0,07 |
| **Covivio Hotels SACA** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 27.07.2029 | | 3.300 | | 2.748 | 0,11 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 27.01.2031 | | 3.400 | | 2.364 | 0,10 |
| 1,625 % fällig am 23.04.2027 | | 2.450 | | 2.049 | 0,08 |
| 1,750 % fällig am 14.01.2030 | | 100 | | 74 | 0,00 |
| 2,750 % fällig am 12.05.2026 | | 1.100 | | 1.025 | 0,04 |
| 2,750 % fällig am 22.01.2028 | £ | 5.950 | | 5.587 | 0,23 |
| **Credit Suisse AG** | | | | | |
| 0,250 % fällig am 01.09.2028 | € | 3.700 | $ | 3.102 | 0,13 |
| 0,646 % fällig am 01.09.2023 | | 3.400 | | 3.563 | 0,15 |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (h) | $ | 5.500 | | 5.514 | 0,23 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 12.09.2025 | £ | 500 | | 574 | 0,02 |
| 3,869 % fällig am 12.01.2029 | $ | 4.750 | | 4.273 | 0,17 |
| 4,550 % fällig am 17.04.2026 | | 4.200 | | 4.112 | 0,17 |
| 5,250 % fällig am 11.02.2027 (f)(h) | | 800 | | 620 | 0,03 |
| 6,250 % fällig am 18.12.2024 (f)(h) | | 500 | | 457 | 0,02 |
| 6,375 % fällig am 21.08.2026 (f)(h) | | 1.000 | | 829 | 0,03 |
| 7,125 % fällig am 29.07.2022 (f)(h) | | 1.700 | | 1.699 | 0,07 |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (f)(h) | | 3.000 | | 2.775 | 0,11 |
| 7,500 % fällig am 11.12.2023 (f)(h) | | 5.200 | | 4.967 | 0,20 |
| **Cromwell Ereit Lux Finco SARL** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 19.11.2025 | € | 3.100 | | 2.653 | 0,11 |
| **Crown Castle International Corp.** | | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.02.2028 | $ | 4.050 | | 3.825 | 0,16 |
| **CTP NV** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 21.06.2025 | € | 2.200 | | 1.962 | 0,08 |
| 0,625 % fällig am 27.09.2026 | | 1.800 | | 1.504 | 0,06 |
| 1,250 % fällig am 21.06.2029 | | 5.100 | | 3.726 | 0,15 |
| 1,500 % fällig am 27.09.2031 | | 1.700 | | 1.078 | 0,04 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | | |
| 0,898 % fällig am 28.05.2024 (j) | $ | 1.900 | | 1.781 | 0,07 |
| 1,375 % fällig am 03.09.2026 | € | 6.400 | | 6.225 | 0,26 |
| 1,375 % fällig am 17.02.2032 | | 4.600 | | 3.677 | 0,15 |
| 1,625 % fällig am 20.01.2027 | | 1.900 | | 1.781 | 0,07 |
| 2,625 % fällig am 16.12.2024 | £ | 1.200 | | 1.389 | 0,06 |
| 3,035 % fällig am 28.05.2032 (j) | $ | 800 | | 634 | 0,03 |
| 3,300 % fällig am 16.11.2022 | | 1.500 | | 1.500 | 0,06 |
| 3,875 % fällig am 12.02.2024 | £ | 3.500 | | 4.196 | 0,17 |
| 3,961 % fällig am 26.11.2025 | $ | 5.000 | | 4.836 | 0,20 |
| 4,625 % fällig am 30.10.2027 (f)(h) | € | 1.200 | | 969 | 0,04 |
| **Digital Dutch Finco BV** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.03.2030 | | 1.100 | | 934 | 0,04 |
| **Doric Nimrod Air Alpha Pass-Through Trust** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 30.05.2025 | $ | 25 | | 25 | 0,00 |
| **Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.11.2024 | | 138 | | 137 | 0,01 |
| **DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 25.01.2027 | € | 1.400 | | 1.215 | 0,05 |
| **EQT AB** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 06.04.2028 | | 1.200 | | 1.146 | 0,05 |
| **Equinix, Inc.** | | | | | |
| 0,250 % fällig am 15.03.2027 | | 1.500 | | 1.359 | 0,06 |
| **Erste Group Bank AG** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.04.2024 (f)(h) | | 200 | | 204 | 0,01 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | | |
| 4,625 % fällig am 29.04.2030 | $ | 2.500 | | 2.403 | 0,10 |
| **Five Corners Funding Trust** | | | | | |
| 4,419 % fällig am 15.11.2023 | | 800 | | 805 | 0,03 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | | |
| 2,330 % fällig am 25.11.2025 | € | 200 | | 186 | 0,01 |
| 2,366 % fällig am 03.08.2022 | $ | 300 | | 299 | 0,01 |
| 2,700 % fällig am 10.08.2026 | | 3.900 | | 3.328 | 0,14 |
| 2,748 % fällig am 14.06.2024 | £ | 2.300 | | 2.584 | 0,11 |
| 2,900 % fällig am 16.02.2028 | $ | 1.800 | | 1.453 | 0,06 |
| 3,021 % fällig am 06.03.2024 | € | 900 | | 904 | 0,04 |
| 3,250 % fällig am 15.09.2025 | | 100 | | 96 | 0,00 |
| 3,550 % fällig am 07.10.2022 | $ | 3.800 | | 3.787 | 0,16 |
| 4,535 % fällig am 06.03.2025 | £ | 200 | | 228 | 0,01 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | | |
| 0,010 % fällig am 30.04.2024 | € | 4.900 | | 5.040 | 0,21 |
| 0,523 % fällig am 08.03.2023 | $ | 1.500 | | 1.471 | 0,06 |
| 0,673 % fällig am 08.03.2024 | | 1.500 | | 1.466 | 0,06 |
| 1,000 % fällig am 16.12.2025 | £ | 2.500 | | 2.805 | 0,11 |
| 1,875 % fällig am 16.12.2030 | | 2.500 | | 2.497 | 0,10 |
| 2,581 % fällig am 15.05.2026 | $ | 800 | | 782 | 0,03 |
| 3,000 % fällig am 15.03.2024 | | 1.500 | | 1.481 | 0,06 |
| 3,200 % fällig am 23.02.2023 | | 3.800 | | 3.802 | 0,16 |
| 3,615 % fällig am 15.03.2028 | | 2.000 | | 1.894 | 0,08 |
| **Hamburg Commercial Bank AG** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 22.09.2026 | € | 2.800 | | 2.637 | 0,11 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 24.07.2027 | £ | 5.200 | | 5.676 | 0,23 |
| 2,455 % fällig am 18.05.2024 | $ | 2.300 | | 2.282 | 0,09 |
| 2,871 % fällig am 22.11.2032 | | 5.000 | | 4.096 | 0,17 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 4,300 % fällig am 08.03.2026 | $ | 700 | $ 694 | 0,03 |
| 4,583 % fällig am 19.06.2029 | | 2.900 | 2.799 | 0,11 |
| 4,750 % fällig am 04.07.2029 (f)(h) | € | 2.200 | 1.932 | 0,08 |
| 5,250 % fällig am 16.09.2022 (f)(h) | | 200 | 207 | 0,01 |
| **Huarong Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 24.02.2030 | $ | 900 | 678 | 0,03 |
| 3,625 % fällig am 30.09.2030 | | 2.600 | 2.002 | 0,08 |
| 3,875 % fällig am 13.11.2029 | | 300 | 240 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 07.11.2027 | | 500 | 436 | 0,02 |
| 4,500 % fällig am 29.05.2029 | | 1.700 | 1.417 | 0,06 |
| 4,750 % fällig am 27.04.2027 | | 1.300 | 1.175 | 0,05 |
| 4,950 % fällig am 07.11.2047 | | 1.200 | 846 | 0,03 |
| **Hyundai Capital Services, Inc.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.09.2023 | | 3.500 | 3.370 | 0,14 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 0,750 % fällig am 16.03.2028 | € | 3.100 | 2.751 | 0,11 |
| 3,250 % fällig am 23.09.2024 | $ | 5.800 | 5.620 | 0,23 |
| 4,000 % fällig am 23.09.2029 | | 400 | 357 | 0,01 |
| 5,148 % fällig am 10.06.2030 | £ | 1.400 | 1.475 | 0,06 |
| **Jackson National Life Global Funding** | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.09.2022 | $ | 600 | 599 | 0,02 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 2,595 % fällig am 24.02.2026 | | 6.400 | 6.090 | 0,25 |
| 3,220 % fällig am 01.03.2025 | | 3.050 | 2.998 | 0,12 |
| 4,005 % fällig am 23.04.2029 | | 4.500 | 4.318 | 0,18 |
| **Kennedy-Wilson, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.02.2030 | | 3.000 | 2.352 | 0,10 |
| **Legal & General Group PLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 24.03.2031 (f)(h) | £ | 800 | 823 | 0,03 |
| **LFS Topco LLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.10.2026 | $ | 1.500 | 1.187 | 0,05 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 0,500 % fällig am 12.11.2025 | € | 2.000 | 1.982 | 0,08 |
| 4,375 % fällig am 22.03.2028 | $ | 900 | 875 | 0,04 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 0,625 % fällig am 17.11.2025 | € | 300 | 280 | 0,01 |
| 1,500 % fällig am 13.07.2026 | | 2.300 | 2.159 | 0,09 |
| 1,625 % fällig am 17.01.2030 | | 900 | 741 | 0,03 |
| 2,000 % fällig am 17.01.2034 | | 1.000 | 738 | 0,03 |
| 2,750 % fällig am 15.01.2030 | £ | 900 | 943 | 0,04 |
| **Mitsubishi HC Capital, Inc.** | | | | |
| 3,960 % fällig am 19.09.2023 | $ | 600 | 601 | 0,02 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | |
| 0,470 % fällig am 06.09.2029 | € | 3.000 | 2.580 | 0,11 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 2,584 % fällig am 24.10.2023 | $ | 2.600 | 2.600 | 0,11 |
| 2,630 % fällig am 18.02.2026 | | 2.000 | 1.911 | 0,08 |
| 3,875 % fällig am 29.04.2024 | | 2.575 | 2.581 | 0,11 |
| 4,000 % fällig am 23.07.2025 | | 625 | 625 | 0,03 |
| **Morgan Stanley Domestic Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 20.06.2028 | | 7.500 | 7.513 | 0,31 |
| **MPT Operating Partnership LP** | | | | |
| 2,500 % fällig am 24.03.2026 | £ | 2.500 | 2.694 | 0,11 |
| **Mutuelle Assurance Des Commercants et Industriels de France et Des Cadres et Sal** | | | | |
| 0,625 % fällig am 21.06.2027 | € | 1.200 | 1.074 | 0,04 |
| 2,125 % fällig am 21.06.2052 | | 3.400 | 2.690 | 0,11 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 3,766 % fällig am 08.03.2024 | $ | 3.500 | 3.492 | 0,14 |
| 4,302 % fällig am 08.03.2029 | | 6.800 | 6.514 | 0,27 |
| 4,363 % fällig am 01.08.2024 | | 2.000 | 2.003 | 0,08 |
| 5,875 % fällig am 20.12.2024 (f)(h) | £ | 1.600 | 1.845 | 0,08 |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.11.2025 | € | 13.300 | 13.229 | 0,55 |
| 2,000 % fällig am 04.03.2025 | | 4.500 | 4.649 | 0,19 |
| 3,747 % fällig am 25.06.2024 | $ | 900 | 901 | 0,04 |
| 4,519 % fällig am 25.06.2024 | | 7.200 | 7.185 | 0,29 |
| 4,892 % fällig am 18.05.2029 | | 1.700 | 1.649 | 0,07 |
| **NatWest Markets PLC** | | | | |
| 1,000 % fällig am 28.05.2024 | € | 1.700 | 1.740 | 0,07 |
| **New Immo Holding S.A.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 26.11.2026 | | 1.800 | 1.644 | 0,07 |
| **New York Life Global Funding** | | | | |
| 2,250 % fällig am 12.07.2022 | $ | 1.500 | 1.500 | 0,06 |
| **Nissan Motor Acceptance Co. LLC** | | | | |
| 1,125 % fällig am 16.09.2024 | | 900 | 828 | 0,03 |
| 1,850 % fällig am 16.09.2026 | | 1.600 | 1.350 | 0,06 |
| 2,000 % fällig am 09.03.2026 | | 1.400 | 1.213 | 0,05 |
| 2,450 % fällig am 15.09.2028 | $ | 700 | $ 565 | 0,02 |
| 2,650 % fällig am 13.07.2022 | | 1.300 | 1.300 | 0,05 |
| **Nova Ljubljanska Banka d.d.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 05.02.2030 | € | 2.500 | 2.300 | 0,09 |
| 3,650 % fällig am 19.11.2029 (k) | | 2.900 | 2.698 | 0,11 |
| **Nuveen Finance LLC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.11.2024 | $ | 500 | 497 | 0,02 |
| **OneMain Finance Corp.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.03.2023 | | 350 | 346 | 0,01 |
| 6,125 % fällig am 15.03.2024 | | 2.650 | 2.537 | 0,10 |
| **Owl Rock Capital Corp.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 11.06.2028 | | 1.900 | 1.494 | 0,06 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2023 | | 2.900 | 2.890 | 0,12 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2024 | | 28 | 28 | 0,00 |
| **Park Intermediate Holdings LLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.05.2029 | | 2.500 | 2.151 | 0,09 |
| 7,500 % fällig am 01.06.2025 | | 3.800 | 3.798 | 0,16 |
| **Piper Sandler Cos.** | | | | |
| 5,200 % fällig am 15.10.2023 | | 3.600 | 3.550 | 0,15 |
| **Prologis International Funding S.A.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 01.06.2031 | € | 2.200 | 2.164 | 0,09 |
| **Public Storage** | | | | |
| 0,500 % fällig am 09.09.2030 | | 900 | 739 | 0,03 |
| **RLJ Lodging Trust LP** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.07.2026 | $ | 1.600 | 1.389 | 0,06 |
| **Sagax AB** | | | | |
| 1,125 % fällig am 30.01.2027 | € | 3.800 | 3.346 | 0,14 |
| 2,000 % fällig am 17.01.2024 | | 800 | 819 | 0,03 |
| 2,250 % fällig am 13.03.2025 | | 2.200 | 2.188 | 0,09 |
| **Sagax Euro MTN NL BV** | | | | |
| 0,750 % fällig am 26.01.2028 | | 2.200 | 1.772 | 0,07 |
| 1,000 % fällig am 17.05.2029 | | 1.200 | 926 | 0,04 |
| **Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB** | | | | |
| 1,000 % fällig am 12.08.2027 | | 1.400 | 947 | 0,04 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 3,823 % fällig am 03.11.2028 | $ | 5.100 | 4.739 | 0,19 |
| 4,796 % fällig am 15.11.2024 | | 8.800 | 8.805 | 0,36 |
| **Sirius Real Estate Ltd.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 22.06.2026 | € | 4.400 | 3.979 | 0,16 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 4,677 % fällig am 15.06.2027 | $ | 3.700 | 3.680 | 0,15 |
| **Sofina S.A.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 23.09.2028 | € | 2.900 | 2.387 | 0,10 |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | |
| 6,500 % (f) | | 1.996 | 2.032 | 0,08 |
| **Synchrony Financial** | | | | |
| 5,150 % fällig am 19.03.2029 | $ | 11.500 | 10.772 | 0,44 |
| **TP ICAP Finance PLC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 18.11.2028 | £ | 1.200 | 1.201 | 0,05 |
| 5,250 % fällig am 29.05.2026 | | 3.500 | 4.158 | 0,17 |
| **UBS AG** | | | | |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (h) | $ | 1.050 | 1.053 | 0,04 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 4,375 % fällig am 10.02.2031 (f)(h) | | 900 | 661 | 0,03 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 2,569 % fällig am 22.09.2026 | | 350 | 313 | 0,01 |
| 6,625 % fällig am 03.06.2023 (f)(h) | € | 2.000 | 1.989 | 0,08 |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | $ | 12.000 | 12.431 | 0,51 |
| **Ursa Re Ltd.** | | | | |
| 5,448 % fällig am 07.12.2027 | | 6.000 | 5.991 | 0,25 |
| **VICI Properties LP** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.02.2025 | | 1.700 | 1.593 | 0,07 |
| 3,750 % fällig am 15.02.2027 | | 3.300 | 2.909 | 0,12 |
| 4,125 % fällig am 15.08.2030 | | 2.500 | 2.162 | 0,09 |
| **Virgin Money UK PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 24.04.2026 | £ | 200 | 231 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 25.09.2026 | | 600 | 705 | 0,03 |
| 4,000 % fällig am 03.09.2027 | | 100 | 116 | 0,00 |
| **Volkswagen Financial Services NV** | | | | |
| 0,875 % fällig am 20.02.2025 | | 3.200 | 3.569 | 0,15 |
| 1,125 % fällig am 18.09.2023 | | 3.300 | 3.875 | 0,16 |
| 2,750 % fällig am 10.07.2023 | | 2.400 | 2.885 | 0,12 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 2,469 % fällig am 31.10.2023 | $ | 500 | 500 | 0,02 |
| 3,000 % fällig am 22.04.2026 | | 2.100 | 2.002 | 0,08 |
| **Workspace Group PLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 11.03.2028 | £ | 2.700 | $ 2.700 | 0,11 |
| **WPC Eurobond BV** | | | | |
| 1,350 % fällig am 15.04.2028 | € | 1.700 | 1.490 | 0,06 |
| | | | 554.546 | 22,77 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 31.07.2050 | £ | 2.300 | 2.351 | 0,10 |
| **Accor S.A.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 29.11.2028 | € | 3.500 | 2.916 | 0,12 |
| **Aeroporti di Roma SpA** | | | | |
| 1,750 % fällig am 30.07.2031 | | 3.800 | 3.046 | 0,12 |
| 5,441 % fällig am 20.02.2023 | £ | 300 | 368 | 0,01 |
| **Air Canada** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.08.2026 | $ | 1.300 | 1.102 | 0,04 |
| **Alaska Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,800 % fällig am 15.02.2029 | | 971 | 960 | 0,04 |
| **Altice France S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.10.2029 | € | 2.300 | 1.802 | 0,07 |
| 5,500 % fällig am 15.10.2029 | $ | 2.500 | 1.917 | 0,08 |
| **AMC Networks, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.08.2025 | | 1.700 | 1.587 | 0,06 |
| **American Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.04.2030 | | 448 | 407 | 0,02 |
| 3,250 % fällig am 15.04.2030 | | 149 | 125 | 0,01 |
| 3,350 % fällig am 15.04.2031 | | 862 | 794 | 0,03 |
| 3,375 % fällig am 01.11.2028 | | 977 | 877 | 0,04 |
| 3,575 % fällig am 15.07.2029 | | 1.033 | 961 | 0,04 |
| 3,700 % fällig am 01.04.2028 | | 180 | 156 | 0,01 |
| **American Airlines, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 20.04.2026 | | 700 | 646 | 0,03 |
| 5,750 % fällig am 20.04.2029 | | 3.700 | 3.172 | 0,13 |
| **Atlantia SpA** | | | | |
| 1,875 % fällig am 12.02.2028 | € | 10.100 | 8.247 | 0,34 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** | | | | |
| 2,839 % fällig am 15.12.2023 | $ | 200 | 199 | 0,01 |
| 3,875 % fällig am 15.12.2023 | | 400 | 399 | 0,02 |
| **Becton Dickinson Euro Finance SARL** | | | | |
| 1,336 % fällig am 13.08.2041 | € | 3.100 | 2.047 | 0,08 |
| **Bellis Acquisition Co. PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 16.02.2026 | £ | 7.600 | 7.199 | 0,30 |
| **Boeing Co.** | | | | |
| 1,950 % fällig am 01.02.2024 | $ | 700 | 678 | 0,03 |
| 2,750 % fällig am 01.02.2026 | | 5.100 | 4.744 | 0,19 |
| **British Airways Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,900 % fällig am 15.09.2036 | | 1.596 | 1.410 | 0,06 |
| 4,250 % fällig am 15.05.2034 | | 722 | 697 | 0,03 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | |
| 3,137 % fällig am 15.11.2035 | | 4 | 3 | 0,00 |
| 4,926 % fällig am 15.05.2037 | | 16 | 14 | 0,00 |
| **Caesars Entertainment, Inc.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 01.07.2025 | | 100 | 97 | 0,00 |
| **CCO Holdings LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.02.2028 | | 1.250 | 1.158 | 0,05 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.06.2041 | | 2.000 | 1.403 | 0,06 |
| 3,900 % fällig am 01.06.2052 | | 1.900 | 1.323 | 0,05 |
| 4,200 % fällig am 15.03.2028 | | 2.800 | 2.619 | 0,11 |
| 4,908 % fällig am 23.07.2025 | | 2.970 | 2.981 | 0,12 |
| 6,384 % fällig am 23.10.2035 | | 875 | 881 | 0,04 |
| 6,484 % fällig am 23.10.2045 | | 1.100 | 1.072 | 0,04 |
| 6,834 % fällig am 23.10.2055 | | 150 | 151 | 0,01 |
| **Cigna Corp.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.07.2023 | | 794 | 796 | 0,03 |
| **Constellation Brands, Inc.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 09.05.2024 | | 3.500 | 3.489 | 0,14 |
| **Constellation Oil Services Holding S.A.** | | | | |
| 13,500 % fällig am 30.06.2025 | | 341 | 342 | 0,01 |
| **Constellation Oil Services Holding S.A. (3.000% Cash or 4.000% PIK)** | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.12.2026 (b) | | 917 | 677 | 0,03 |
| **Coty, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.04.2026 | € | 4.200 | 3.896 | 0,16 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2029 | $ | 2.000 | 1.721 | 0,07 |
| 5,000 % fällig am 15.04.2026 | | 6.300 | 5.783 | 0,24 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **DAE Funding LLC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 15.02.2024 | $ | 2.500 | $ 2.369 | 0,10 |
| **Davide Campari-Milano NV** | | | | |
| 1,250 % fällig am 06.10.2027 | € | 1.200 | 1.145 | 0,05 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 5,450 % fällig am 15.06.2023 | $ | 400 | 404 | 0,02 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.12.2026 | | 1.000 | 786 | 0,03 |
| 5,750 % fällig am 01.12.2028 | | 4.500 | 3.340 | 0,14 |
| **East Japan Railway Co.** | | | | |
| 0,773 % fällig am 15.09.2034 | € | 1.500 | 1.185 | 0,05 |
| 1,104 % fällig am 15.09.2039 | | 800 | 588 | 0,02 |
| 1,162 % fällig am 15.09.2028 | £ | 500 | 538 | 0,02 |
| **Energean Israel Finance Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 30.03.2024 | $ | 2.000 | 1.888 | 0,08 |
| 4,875 % fällig am 30.03.2026 | | 1.200 | 1.064 | 0,04 |
| **Exela Intermediate LLC** | | | | |
| 11,500 % fällig am 15.07.2026 | | 1.126 | 377 | 0,02 |
| **Expedia Group, Inc.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 15.03.2031 | | 2.000 | 1.593 | 0,06 |
| 6,250 % fällig am 01.05.2025 | | 1.669 | 1.721 | 0,07 |
| **Flex Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.02.2023 | | 500 | 504 | 0,02 |
| **Ford Motor Co.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.02.2032 | | 1.300 | 977 | 0,04 |
| **Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide** | | | | |
| 2,125 % fällig am 09.07.2027 | € | 1.900 | 1.814 | 0,07 |
| **GN Store Nord A/S** | | | | |
| 0,875 % fällig am 25.11.2024 | | 3.400 | 3.366 | 0,14 |
| **Grifols Escrow Issuer S.A.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.10.2028 | | 3.100 | 2.684 | 0,11 |
| **GSK Consumer Healthcare Capital UK PLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 24.03.2025 | $ | 3.000 | 2.925 | 0,12 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.09.2026 | | 900 | 894 | 0,04 |
| **Hilton Domestic Operating Co., Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.02.2032 | | 2.200 | 1.753 | 0,07 |
| 3,750 % fällig am 01.05.2029 | | 600 | 510 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 01.05.2031 | | 10.400 | 8.674 | 0,36 |
| **Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.06.2029 | | 4.000 | 3.246 | 0,13 |
| **Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement** | | | | |
| 0,125 % fällig am 16.09.2025 | € | 1.600 | 1.494 | 0,06 |
| 0,625 % fällig am 16.09.2028 | | 2.200 | 1.850 | 0,08 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.09.2026 (b) | | 3.200 | 2.783 | 0,11 |
| **Imperial Brands Finance Netherlands BV** | | | | |
| 1,750 % fällig am 18.03.2033 | | 4.200 | 3.191 | 0,13 |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | | |
| 2,125 % fällig am 12.02.2027 | | 2.500 | 2.393 | 0,10 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.03.2030 | $ | 1.406 | 1.163 | 0,05 |
| **InterContinental Hotels Group PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 08.10.2028 | £ | 1.000 | 1.109 | 0,04 |
| **JetBlue Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.11.2033 | $ | 178 | 155 | 0,01 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.07.2035 | | 73 | 71 | 0,00 |
| **Lendlease Europe Finance PLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 02.12.2033 | £ | 2.200 | 2.092 | 0,09 |
| **Magallanes, Inc.** | | | | |
| 3,528 % fällig am 15.03.2024 | $ | 3.100 | 3.038 | 0,12 |
| **Melco Resorts Finance Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 04.12.2029 | | 200 | 121 | 0,00 |
| **Mileage Plus Holdings LLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 20.06.2027 | | 6.600 | 6.506 | 0,27 |
| **MPH Acquisition Holdings LLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.09.2028 | | 3.300 | 2.946 | 0,12 |
| **MPLX LP** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.12.2022 | | 400 | 400 | 0,02 |
| **Nidec Corp.** | | | | |
| 0,046 % fällig am 30.03.2026 | € | 2.600 | 2.461 | 0,10 |
| **Nissan Motor Co. Ltd.** | | | | |
| 3,522 % fällig am 17.09.2025 | $ | 7.500 | 7.107 | 0,29 |
| 4,345 % fällig am 17.09.2027 | | 3.600 | 3.307 | 0,14 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Ovintiv Exploration, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.01.2026 | $ | 3.500 | $ 3.543 | 0,14 |
| **Panasonic Holdings Corp.** | | | | |
| 2,536 % fällig am 19.07.2022 | | 1.600 | 1.600 | 0,07 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | | |
| 3,950 % fällig am 10.03.2025 | | 2.000 | 1.971 | 0,08 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 6,700 % fällig am 16.02.2032 | | 4.981 | 3.808 | 0,16 |
| **RELX Capital, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 16.03.2023 | | 400 | 400 | 0,02 |
| **Ryanair DAC** | | | | |
| 0,875 % fällig am 25.05.2026 | € | 1.900 | 1.771 | 0,07 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.03.2028 | $ | 4.000 | 3.851 | 0,16 |
| **Safran S.A.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 17.03.2031 | € | 3.300 | 2.810 | 0,11 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 3,100 % fällig am 08.03.2029 | $ | 900 | 638 | 0,03 |
| 3,250 % fällig am 08.08.2031 | | 1.100 | 729 | 0,03 |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028 | | 7.800 | 6.027 | 0,25 |
| **Scripps Escrow, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.01.2031 | | 1.600 | 1.278 | 0,05 |
| **Sixt SE** | | | | |
| 1,750 % fällig am 09.12.2024 | € | 500 | 511 | 0,02 |
| **Studio City Finance Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2029 | $ | 600 | 311 | 0,01 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 3,375 % fällig am 16.04.2026 | € | 1.000 | 1.033 | 0,04 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 15.02.2051 | $ | 2.700 | 1.972 | 0,08 |
| 3,875 % fällig am 15.04.2030 | | 4.200 | 3.924 | 0,16 |
| **TD SYNNEX Corp.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 09.08.2028 | | 5.800 | 4.896 | 0,20 |
| **TDF Infrastructure SASU** | | | | |
| 1,750 % fällig am 01.12.2029 | € | 3.900 | 3.376 | 0,14 |
| **Tesco Corporate Treasury Services PLC** | | | | |
| 0,875 % fällig am 29.05.2026 | | 2.200 | 2.093 | 0,09 |
| **Toyota Tsusho Corp.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 13.09.2023 | $ | 3.400 | 3.396 | 0,14 |
| **United Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.04.2029 | | 3.641 | 3.584 | 0,15 |
| **United Airlines, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.04.2029 | | 200 | 170 | 0,01 |
| **Venture Global Calcasieu Pass LLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.11.2033 | | 6.400 | 5.299 | 0,22 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.01.2030 | £ | 4.000 | 3.926 | 0,16 |
| **Vmed O2 UK Financing PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.07.2031 | | 2.800 | 2.696 | 0,11 |
| **Wabtec Transportation Netherlands BV** | | | | |
| 1,250 % fällig am 03.12.2027 | € | 4.600 | 3.939 | 0,16 |
| **Werfenlife S.A.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 28.10.2026 | | 1.000 | 947 | 0,04 |
| **Wesfarmers Ltd.** | | | | |
| 0,954 % fällig am 21.10.2033 | | 1.800 | 1.417 | 0,06 |
| **WMG Acquisition Corp.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.08.2031 | | 2.300 | 1.832 | 0,07 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2026 | $ | 400 | 278 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 01.10.2027 | | 200 | 130 | 0,01 |
| | | | 237.901 | 9,77 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **CK Hutchison Group Telecom Finance S.A.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 17.10.2031 | € | 2.500 | 2.087 | 0,09 |
| 2,625 % fällig am 17.10.2034 | £ | 2.500 | 2.284 | 0,09 |
| **ONEOK, Inc.** | | | | |
| 4,350 % fällig am 15.03.2029 | $ | 100 | 94 | 0,00 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | | |
| 2,100 % fällig am 01.08.2027 | | 4.800 | 4.028 | 0,17 |
| 3,000 % fällig am 15.06.2028 | | 2.400 | 2.071 | 0,09 |
| 3,150 % fällig am 01.01.2026 | | 500 | 459 | 0,02 |
| 3,250 % fällig am 01.06.2031 | | 2.400 | 1.941 | 0,08 |
| 3,300 % fällig am 01.12.2027 ^ | | 3.000 | 2.622 | 0,11 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2050 | | 300 | 201 | 0,01 |
| 4,300 % fällig am 15.03.2045 ^ | | 500 | 364 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 4,950 % fällig am 08.06.2025 | $ | 1.500 | $ 1.472 | 0,06 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | | |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | | 1.196 | 1.240 | 0,05 |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027 | | 859 | 916 | 0,04 |
| **Southern California Gas Co.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 15.04.2027 | | 1.900 | 1.800 | 0,07 |
| **Southern Co. Gas Capital Corp.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 01.10.2023 | | 500 | 493 | 0,02 |
| **Sprint Corp.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.06.2024 | | 800 | 824 | 0,03 |
| | | | 22.896 | 0,94 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 815.343 | 33,48 |
| **WANDELANLEIHEN & WECHSEL** | | | | |
| **Royal Caribbean Cruises Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.06.2023 | | 5.000 | 4.800 | 0,20 |
| **Southwest Airlines Co.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 01.05.2025 | | 7.500 | 8.859 | 0,36 |
| | | | 13.659 | 0,56 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **California State General Obligation Bonds, (BABs), (AGM/CR Insured), Series 2010** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.11.2026 | | 2.345 | 2.667 | 0,11 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2021** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.07.2033 (d) | | 6 | 3 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2033 | | 4 | 4 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2035 | | 4 | 4 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2037 | | 3 | 3 | 0,00 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2022** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.11.2043 | | 22 | 11 | 0,00 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Notes, Series 2021** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.07.2024 (d) | | 2 | 2 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 01.07.2023 | | 5 | 5 | 0,00 |
| **Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021** | | | | |
| 1,337 % fällig am 01.06.2023 | | 3.400 | 3.335 | 0,14 |
| 1,711 % fällig am 01.06.2024 | | 1.900 | 1.828 | 0,07 |
| **Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010** | | | | |
| 7,350 % fällig am 01.07.2035 | | 750 | 819 | 0,03 |
| **Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2007** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.06.2047 (d) | | 22.700 | 1.839 | 0,08 |
| **Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2020** | | | | |
| 3,151 % fällig am 01.06.2032 | | 1.500 | 1.293 | 0,05 |
| 3,301 % fällig am 01.06.2033 | | 800 | 686 | 0,03 |
| | | | 12.499 | 0,51 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 0,317 % fällig am 25.11.2031 | | 12 | 12 | 0,00 |
| 0,480 % fällig am 25.07.2042 (a) | | 23.066 | 317 | 0,01 |
| 0,617 % fällig am 25.06.2042 (a) | | 17.809 | 253 | 0,01 |
| 1,208 % fällig am 25.02.2032 | | 28 | 28 | 0,00 |
| 1,264 % fällig am 25.11.2032 | | 8 | 8 | 0,00 |
| 1,524 % fällig am 01.11.2042 | | 12 | 12 | 0,00 |
| 1,718 % fällig am 25.09.2060 (a) | | 16.187 | 1.193 | 0,05 |
| 1,744 % fällig am 25.03.2034 | | 38 | 38 | 0,00 |
| 1,795 % fällig am 01.12.2034 | | 2 | 2 | 0,00 |
| 1,973 % fällig am 01.02.2035 | | 8 | 8 | 0,00 |
| 1,974 % fällig am 25.03.2037 | | 25 | 25 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 25.11.2050 (a) | | 4.423 | 468 | 0,02 |
| 2,024 % fällig am 25.09.2032 | | 2 | 2 | 0,00 |
| 2,045 % fällig am 18.10.2030 | | 4 | 4 | 0,00 |
| 2,247 % fällig am 25.06.2043 (a) | | 5.948 | 406 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 25.06.2050 (a) | | 6.573 | 1.302 | 0,05 |
| 4,276 % fällig am 25.12.2056 (a) | | 4.114 | 751 | 0,03 |
| 4,426 % fällig am 25.07.2059 (a) | | 10.142 | 1.754 | 0,07 |
| 4,476 % fällig am 25.07.2050 (a) | | 4.867 | 643 | 0,03 |
| 4,526 % fällig am 25.07.2043 (a) | | 1.248 | 190 | 0,01 |
| 4,576 % fällig am 25.05.2048 (a) | | 2.079 | 297 | 0,01 |
| 4,876 % fällig am 25.03.2042 (a) | | 8.098 | 1.143 | 0,05 |
| 4,935 % fällig am 25.11.2046 (a) | | 7.261 | 438 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 4,976 % fällig am 25.11.2035 (a) | $ | 116 | $ 7 | 0,00 |
| 5,006 % fällig am 25.10.2039 (a) | | 2.560 | 105 | 0,00 |
| 18,614 % fällig am 25.03.2036 | | 322 | 405 | 0,02 |
| **Freddie Mac** | | | | |
| 1,500 % fällig am 25.12.2035 (a) | | 9.365 | 445 | 0,02 |
| 1,876 % fällig am 25.07.2044 | | 367 | 381 | 0,02 |
| 1,904 % fällig am 25.09.2031 | | 101 | 100 | 0,00 |
| 1,965 % fällig am 15.08.2042 | | 1.111 | 841 | 0,04 |
| 2,000 % fällig am 25.12.2050 (a) | | 21.069 | 2.167 | 0,09 |
| 2,575 % fällig am 01.09.2027 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 15.01.2033 - 25.07.2050 (a) | | 19.818 | 3.925 | 0,16 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2047 | | 126 | 127 | 0,01 |
| 4,476 % fällig am 25.06.2050 (a) | | 10.643 | 1.521 | 0,06 |
| 4,526 % fällig am 25.06.2050 (a) | | 14.257 | 2.621 | 0,11 |
| 4,606 % fällig am 15.12.2037 (a) | | 365 | 40 | 0,00 |
| 5,286 % fällig am 15.04.2042 (a) | | 176 | 26 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 01.04.2027 - 01.01.2040 | | 500 | 534 | 0,02 |
| **Ginnie Mae** | | | | |
| 1,625 % fällig am 20.09.2031 | | 117 | 118 | 0,01 |
| 1,750 % fällig am 20.11.2029 | | 2 | 2 | 0,00 |
| 3,500 % fällig am 15.07.2045 | | 11.620 | 11.500 | 0,47 |
| 4,000 % fällig am 20.10.2042 (a) | | 4.041 | 713 | 0,03 |
| 4,000 % fällig am 15.02.2052 | | 5.000 | 5.090 | 0,21 |
| 4,500 % fällig am 20.10.2045 (a) | | 2.766 | 549 | 0,02 |
| **Ginnie Mae, TBA** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.07.2052 | | 3.000 | 3.011 | 0,12 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.04.2037 - 01.07.2048 | | 13.275 | 13.000 | 0,53 |
| 4,000 % fällig am 01.05.2047 - 01.03.2049 | | 11.175 | 11.206 | 0,46 |
| 4,500 % fällig am 01.04.2028 | | 6 | 6 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 01.07.2026 - 01.08.2040 | | 543 | 573 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 01.10.2025 - 01.05.2041 | | 286 | 307 | 0,01 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.07.2052 | | 99.000 | 85.944 | 3,53 |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 | | 30.200 | 27.168 | 1,12 |
| 3,000 % fällig am 01.08.2052 | | 35.100 | 32.665 | 1,34 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2052 | | 20.200 | 19.409 | 0,80 |
| | | | 233.801 | 9,60 |

## US-SCHATZOBLIGATIONEN

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 0,250 % fällig am 31.08.2025 | | 12.200 | 11.173 | 0,46 |
| 1,250 % fällig am 31.08.2024 | | 84.500 | 81.420 | 3,34 |
| 2,000 % fällig am 31.07.2022 | | 100.800 | 100.871 | 4,14 |
| | | | 193.464 | 7,94 |

## NON-AGENCY-MBS

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,144 % fällig am 25.01.2036 | | 1.065 | 983 | 0,04 |
| 2,855 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 293 | 243 | 0,01 |
| 2,855 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 38 | 34 | 0,00 |
| 2,950 % fällig am 25.08.2035 | | 24 | 23 | 0,00 |
| 2,968 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 8 | 7 | 0,00 |
| 3,182 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 1.352 | 1.018 | 0,04 |
| 3,344 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 137 | 132 | 0,01 |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | | |
| 1,396 % fällig am 25.11.2046 | | 61 | 20 | 0,00 |
| 2,044 % fällig am 25.06.2037 | | 3.134 | 3.035 | 0,13 |
| 6,750 % fällig am 25.11.2046 | | 557 | 489 | 0,02 |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 3,836 % fällig am 25.11.2045 ^ | | 235 | 125 | 0,01 |
| **Banc of America Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,984 % fällig am 25.06.2037 | | 647 | 485 | 0,02 |
| 5,016 % fällig am 25.06.2037 ^(a) | | 702 | 83 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2046 ^ | | 268 | 244 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2046 ^ | | 474 | 414 | 0,02 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 1,932 % fällig am 20.02.2047 | | 610 | 629 | 0,03 |
| 1,992 % fällig am 20.07.2036 | | 4.666 | 4.527 | 0,19 |
| 1,992 % fällig am 20.12.2046 ^ | | 211 | 197 | 0,01 |
| 2,024 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 164 | 154 | 0,01 |
| 2,369 % fällig am 20.10.2046 ^ | | 85 | 73 | 0,00 |
| 2,411 % fällig am 20.12.2034 ^ | | 11 | 9 | 0,00 |
| 2,736 % fällig am 20.02.2036 | | 29 | 28 | 0,00 |
| 2,745 % fällig am 20.04.2035 ^ | $ | 1.079 | $ 999 | 0,04 |
| 3,027 % fällig am 20.06.2037 ^ | | 59 | 54 | 0,00 |
| 3,461 % fällig am 20.01.2047 ^ | | 44 | 42 | 0,00 |
| 3,476 % fällig am 20.06.2036 ^ | | 13 | 12 | 0,00 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | | |
| 2,545 % fällig am 25.02.2035 | | 79 | 79 | 0,00 |
| 3,204 % fällig am 25.05.2035 ^ | | 239 | 220 | 0,01 |
| 3,356 % fällig am 25.06.2035 | | 53 | 46 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 20.07.2032 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 1,166 % fällig am 26.11.2036 | | 1.574 | 1.571 | 0,07 |
| 1,804 % fällig am 25.03.2037 | | 808 | 746 | 0,03 |
| 1,964 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 2.125 | 1.908 | 0,08 |
| 2,924 % fällig am 25.09.2047 | | 972 | 907 | 0,04 |
| 4,737 % fällig am 26.03.2037 | | 3.080 | 3.506 | 0,14 |
| 5,250 % fällig am 26.02.2036 | | 568 | 286 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 26.06.2036 | | 12.677 | 5.897 | 0,24 |
| 5,250 % fällig am 26.04.2037 | | 668 | 432 | 0,02 |
| 5,250 % fällig am 26.06.2037 | | 158 | 148 | 0,01 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,066 % fällig am 25.04.2033 | | 7 | 7 | 0,00 |
| 2,547 % fällig am 25.01.2035 | | 40 | 37 | 0,00 |
| 2,665 % fällig am 25.01.2035 | | 26 | 25 | 0,00 |
| 2,744 % fällig am 25.11.2034 | | 3 | 2 | 0,00 |
| 2,842 % fällig am 25.02.2033 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 3,064 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 62 | 59 | 0,00 |
| 3,349 % fällig am 25.09.2034 | | 99 | 95 | 0,00 |
| 3,624 % fällig am 25.11.2034 | | 38 | 34 | 0,00 |
| 3,899 % fällig am 25.07.2034 | | 45 | 42 | 0,00 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 1,964 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 191 | 166 | 0,01 |
| 2,064 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 453 | 677 | 0,03 |
| 2,104 % fällig am 25.02.2036 | | 424 | 418 | 0,02 |
| 2,752 % fällig am 25.05.2035 | | 329 | 317 | 0,01 |
| 2,887 % fällig am 25.04.2035 | | 64 | 56 | 0,00 |
| 2,922 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 3.959 | 1.862 | 0,08 |
| 3,128 % fällig am 25.11.2036 | | 2.860 | 1.875 | 0,08 |
| 3,232 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 23 | 14 | 0,00 |
| 3,235 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 309 | 261 | 0,01 |
| 3,254 % fällig am 25.01.2034 | | 46 | 45 | 0,00 |
| **Canada Square Funding PLC** | | | | |
| 1,550 % fällig am 17.10.2051 | £ | 5.053 | 6.132 | 0,25 |
| **Charter Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,540 % fällig am 16.01.2057 | | 2.019 | 2.449 | 0,10 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.02.2037 | $ | 18 | 17 | 0,00 |
| 3,137 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 356 | 338 | 0,01 |
| **ChaseFlex Trust** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.07.2037 | | 12 | 11 | 0,00 |
| **ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 4,149 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 854 | 747 | 0,03 |
| **Citicorp Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.09.2037 | | 33 | 32 | 0,00 |
| **Citigroup Global Markets Mortgage Securities, Inc.** | | | | |
| 2,124 % fällig am 25.05.2032 | | 28 | 27 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,480 % fällig am 25.11.2035 | | 68 | 66 | 0,00 |
| 2,826 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 91 | 82 | 0,00 |
| 3,328 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 10 | 9 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 2,192 % fällig am 25.02.2034 | | 13 | 13 | 0,00 |
| 3,440 % fällig am 25.09.2035 | | 2 | 2 | 0,00 |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,224 % fällig am 25.01.2037 | | 1.234 | 1.049 | 0,04 |
| 2,224 % fällig am 25.06.2037 | | 1.832 | 1.547 | 0,06 |
| 2,274 % fällig am 25.09.2036 | | 1.675 | 1.418 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2037 ^ | | 713 | 640 | 0,03 |
| **Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 99 | 66 | 0,00 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,476 % fällig am 25.12.2035 | | 2.514 | 2.186 | 0,09 |
| 1,802 % fällig am 20.03.2047 | | 5.514 | 4.463 | 0,18 |
| 1,807 % fällig am 20.12.2046 ^ | | 7.697 | 6.462 | 0,27 |
| 1,824 % fällig am 25.04.2047 | | 276 | 253 | 0,01 |
| 1,892 % fällig am 20.09.2046 | | 589 | 396 | 0,02 |
| 1,904 % fällig am 25.04.2047 | | 727 | 638 | 0,03 |
| 1,944 % fällig am 25.09.2047 | | 657 | 602 | 0,03 |
| 1,964 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,964 % fällig am 25.05.2047 | | 612 | 538 | 0,02 |
| 1,984 % fällig am 25.05.2047 | $ | 917 | $ 797 | 0,03 |
| 1,994 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 2.098 | 697 | 0,03 |
| 2,004 % fällig am 25.09.2046 ^ | | 20 | 19 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 441 | 352 | 0,02 |
| 2,032 % fällig am 20.03.2046 | | 58 | 45 | 0,00 |
| 2,032 % fällig am 20.05.2046 ^ | | 319 | 274 | 0,01 |
| 2,074 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 253 | 160 | 0,01 |
| 2,124 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 103 | 49 | 0,00 |
| 2,266 % fällig am 20.11.2035 | | 22 | 19 | 0,00 |
| 2,334 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 549 | 207 | 0,01 |
| 2,524 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 632 | 223 | 0,01 |
| 2,924 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 1.392 | 1.035 | 0,04 |
| 5,000 % fällig am 25.03.2035 | | 6 | 5 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 177 | 124 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.01.2036 | | 24 | 16 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.02.2035 | | 157 | 121 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.07.2035 ^ | | 661 | 471 | 0,02 |
| 5,750 % fällig am 25.05.2036 | | 448 | 230 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 393 | 251 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 799 | 442 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 123 | 83 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 1.246 | 640 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 224 | 117 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 278 | 128 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 559 | 304 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 100 | 56 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 617 | 370 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2032 | | 43 | 43 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 541 | 259 | 0,01 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 1,985 % fällig am 20.02.2036 ^ | | 31 | 26 | 0,00 |
| 2,084 % fällig am 25.05.2035 | | 41 | 34 | 0,00 |
| 2,204 % fällig am 25.04.2035 | | 44 | 39 | 0,00 |
| 2,241 % fällig am 20.07.2034 | | 79 | 76 | 0,00 |
| 2,264 % fällig am 25.03.2035 | | 271 | 227 | 0,01 |
| 2,284 % fällig am 25.02.2035 | | 3 | 3 | 0,00 |
| 2,364 % fällig am 25.02.2035 | | 807 | 706 | 0,03 |
| 2,592 % fällig am 25.04.2035 | | 35 | 28 | 0,00 |
| 2,672 % fällig am 20.04.2036 ^ | | 11 | 10 | 0,00 |
| 3,042 % fällig am 20.05.2036 ^ | | 675 | 642 | 0,03 |
| 3,238 % fällig am 20.02.2036 | | 525 | 503 | 0,02 |
| 5,250 % fällig am 25.12.2027 ^ | | 24 | 17 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 4 | 2 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 392 | 223 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 24 | 15 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.08.2037 | | 2.078 | 1.326 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 88 | 54 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.12.2037 | | 1.029 | 531 | 0,02 |
| **Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust** | | | | |
| 6,500 % fällig am 25.11.2034 ^ | | 18 | 17 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 1,081 % fällig am 25.03.2032 | | 29 | 27 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 484 | 343 | 0,01 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | | |
| 1,506 % fällig am 30.11.2037 | | 2.645 | 2.423 | 0,10 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust** | | | | |
| 2,224 % fällig am 25.02.2037 | | 3.926 | 1.987 | 0,08 |
| 6,250 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 43 | 21 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 368 | 227 | 0,01 |
| **Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.09.2047 ^ | | 704 | 637 | 0,03 |
| 1,954 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 374 | 328 | 0,01 |
| **Dutch Property Finance BV** | | | | |
| 0,235 % fällig am 28.07.2054 | € | 1.935 | 2.003 | 0,08 |
| **EMF-NL Prime BV** | | | | |
| 0,352 % fällig am 17.04.2041 | | 183 | 182 | 0,01 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 1,052 % fällig am 17.10.2040 | | 56 | 59 | 0,00 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | |
| 1,565 % fällig am 16.03.2070 | £ | 3.279 | 3.957 | 0,16 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,474 % fällig am 25.09.2034 | $ | 66 | 62 | 0,00 |
| 3,309 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 332 | 196 | 0,01 |
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,213 % fällig am 25.08.2035 | | 25 | 17 | 0,00 |
| **Friary PLC** | | | | |
| 1,358 % fällig am 21.11.2067 | £ | 780 | 948 | 0,04 |
| **GMAC Mortgage Corp. Loan Trust** | | | | |
| 2,900 % fällig am 19.04.2036 ^ | $ | 47 | 37 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 2,193 % fällig am 18.06.2039 | $ | 27 | $ 27 | 0,00 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,164 % fällig am 25.11.2045 | | 234 | 206 | 0,01 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,894 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 92 | 58 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 11 | 11 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 20 | 15 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 807 | 409 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 50 | 31 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 136 | 106 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 80 | 44 | 0,00 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.05.2038 | | 506 | 434 | 0,02 |
| 2,052 % fällig am 19.05.2035 | | 35 | 32 | 0,00 |
| 2,073 % fällig am 19.06.2045 ^ | | 1.057 | 547 | 0,02 |
| 2,112 % fällig am 19.01.2036 | | 662 | 423 | 0,02 |
| 2,172 % fällig am 19.02.2036 | | 224 | 128 | 0,01 |
| 2,432 % fällig am 19.11.2034 ^ | | 90 | 78 | 0,00 |
| 3,301 % fällig am 19.10.2033 | | 28 | 26 | 0,00 |
| **Harmony French Home Loans** | | | | |
| 0,301 % fällig am 27.05.2062 | € | 7.500 | 7.818 | 0,32 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | | |
| 2,763 % fällig am 25.04.2037 ^ | $ | 2.229 | 2.072 | 0,09 |
| **Impac CMB Trust** | | | | |
| 2,264 % fällig am 25.09.2034 | | 4 | 4 | 0,00 |
| 2,264 % fällig am 25.03.2035 | | 407 | 382 | 0,02 |
| 2,284 % fällig am 25.03.2035 | | 381 | 370 | 0,02 |
| 2,404 % fällig am 25.10.2034 | | 321 | 312 | 0,01 |
| 2,544 % fällig am 25.11.2034 | | 19 | 19 | 0,00 |
| **IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 1,686 % fällig am 25.01.2032 | | 14 | 13 | 0,00 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,044 % fällig am 25.07.2036 | | 808 | 766 | 0,03 |
| 2,224 % fällig am 25.07.2035 | | 223 | 191 | 0,01 |
| 2,424 % fällig am 25.11.2034 | | 101 | 92 | 0,00 |
| 2,444 % fällig am 25.11.2034 ^ | | 72 | 62 | 0,00 |
| 2,804 % fällig am 25.10.2034 | | 223 | 217 | 0,01 |
| 2,957 % fällig am 25.06.2037 | | 842 | 512 | 0,02 |
| 2,981 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 67 | 49 | 0,00 |
| 3,049 % fällig am 25.07.2037 | | 1.993 | 1.373 | 0,06 |
| 3,236 % fällig am 25.06.2036 | | 261 | 247 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 2.876 | 1.219 | 0,05 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,984 % fällig am 25.06.2037 | | 9.498 | 5.632 | 0,23 |
| 2,831 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 228 | 198 | 0,01 |
| 5,843 % fällig am 26.05.2037 | | 1.089 | 932 | 0,04 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | | |
| 1,997 % fällig am 25.12.2034 | | 20 | 19 | 0,00 |
| 2,614 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 9 | 8 | 0,00 |
| 2,749 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 172 | 149 | 0,01 |
| 2,753 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 23 | 20 | 0,00 |
| 3,043 % fällig am 27.07.2037 | | 133 | 125 | 0,01 |
| 3,285 % fällig am 25.05.2034 | | 6 | 6 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 53 | 30 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 257 | 158 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 143 | 78 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 234 | 111 | 0,01 |
| **Lanark Master Issuer PLC** | | | | |
| 1,410 % fällig am 22.12.2069 | £ | 1.920 | 2.332 | 0,10 |
| **Lehman Mortgage Trust** | | | | |
| 5,919 % fällig am 25.04.2036 ^ | $ | 1.127 | 820 | 0,03 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 1,906 % fällig am 25.08.2047 ^ | | 524 | 475 | 0,02 |
| **Luminent Mortgage Trust** | | | | |
| 1,984 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 22 | 20 | 0,00 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | | |
| 2,310 % fällig am 25.05.2034 | | 68 | 65 | 0,00 |
| 2,868 % fällig am 25.07.2035 ^ | | 185 | 170 | 0,01 |
| **MASTR Seasoned Securitization Trust** | | | | |
| 3,410 % fällig am 25.10.2032 | | 90 | 90 | 0,00 |
| **Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,024 % fällig am 15.11.2031 | | 22 | 21 | 0,00 |
| **Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 15.12.2030 | | 249 | 238 | 0,01 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 2,124 % fällig am 25.11.2035 | | 52 | 50 | 0,00 |
| 2,606 % fällig am 25.03.2036 ^ | $ | 510 | $ 297 | 0,01 |
| 2,820 % fällig am 25.02.2035 | | 12 | 12 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,421 % fällig am 25.12.2037 | | 1.116 | 794 | 0,03 |
| 2,789 % fällig am 25.11.2037 | | 1.647 | 1.296 | 0,05 |
| **Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,549 % fällig am 25.10.2035 | | 137 | 90 | 0,00 |
| 2,694 % fällig am 25.02.2035 | | 337 | 336 | 0,01 |
| 3,720 % fällig am 25.06.2036 | | 1.484 | 1.190 | 0,05 |
| **Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 5,675 % fällig am 25.12.2035 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Prime Mortgage Trust** | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.07.2034 | | 360 | 293 | 0,01 |
| **RBSGC Structured Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 681 | 601 | 0,03 |
| **RBSSP Resecuritization Trust** | | | | |
| 1,486 % fällig am 27.06.2036 | | 4.946 | 3.792 | 0,16 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.02.2047 | | 2.559 | 1.073 | 0,04 |
| 1,924 % fällig am 25.08.2035 | | 31 | 24 | 0,00 |
| 1,976 % fällig am 25.08.2035 | | 58 | 50 | 0,00 |
| 2,004 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 725 | 690 | 0,03 |
| 2,004 % fällig am 25.12.2036 | | 373 | 333 | 0,01 |
| 2,004 % fällig am 25.05.2047 | | 409 | 376 | 0,02 |
| 2,024 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 111 | 82 | 0,00 |
| 2,124 % fällig am 25.08.2037 | | 106 | 97 | 0,00 |
| 2,184 % fällig am 25.12.2045 | | 70 | 54 | 0,00 |
| 4,084 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 170 | 145 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 333 | 300 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 125 | 107 | 0,00 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 17 | 10 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 84 | 48 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 125 | 58 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 387 | 176 | 0,01 |
| **Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust** | | | | |
| 3,430 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 36 | 32 | 0,00 |
| 4,588 % fällig am 27.07.2037 ^ | | 242 | 199 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.03.2032 | | 24 | 23 | 0,00 |
| **RESIMAC Bastille Trust** | | | | |
| 1,682 % fällig am 05.12.2059 | | 138 | 138 | 0,01 |
| **Shamrock Residential DAC** | | | | |
| 0,338 % fällig am 24.01.2061 | € | 3.376 | 3.482 | 0,14 |
| **Stratton BTL Mortgage Funding** | | | | |
| 1,217 % fällig am 20.01.2054 | £ | 3.702 | 4.439 | 0,18 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,513 % fällig am 25.04.2034 | $ | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,543 % fällig am 25.02.2034 | | 47 | 46 | 0,00 |
| 2,853 % fällig am 25.09.2035 | | 89 | 83 | 0,00 |
| 2,872 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 204 | 187 | 0,01 |
| 2,873 % fällig am 25.09.2034 | | 302 | 293 | 0,01 |
| 2,914 % fällig am 25.12.2034 | | 19 | 19 | 0,00 |
| 3,023 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 127 | 85 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 1,744 % fällig am 25.08.2036 | | 723 | 670 | 0,03 |
| 2,004 % fällig am 25.06.2036 | | 60 | 59 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.10.2036 | | 2.031 | 1.886 | 0,08 |
| 2,044 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 92 | 88 | 0,00 |
| 2,095 % fällig am 19.07.2035 | | 145 | 136 | 0,01 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,981 % fällig am 25.12.2033 | | 69 | 67 | 0,00 |
| 3,394 % fällig am 25.06.2033 | | 1 | 1 | 0,00 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,304 % fällig am 25.04.2043 | | 39 | 39 | 0,00 |
| 2,874 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 371 | 335 | 0,01 |
| 4,783 % fällig am 25.06.2037 | | 2.523 | 2.358 | 0,10 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,605 % fällig am 20.10.2051 | £ | 6.670 | 8.074 | 0,33 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | |
| 1,602 % fällig am 12.03.2055 | | 4.687 | 5.538 | 0,23 |
| 1,902 % fällig am 12.06.2053 | | 1.819 | 2.210 | 0,09 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 1,134 % fällig am 25.12.2046 | $ | 133 | 120 | 0,01 |
| 1,206 % fällig am 25.01.2047 | | 187 | 177 | 0,01 |
| 1,216 % fällig am 25.01.2047 ^ | | 63 | 57 | 0,00 |
| 1,226 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 5 | 4 | 0,00 |
| 1,236 % fällig am 25.04.2047 | | 1.217 | 1.095 | 0,05 |
| 1,456 % fällig am 25.06.2046 | $ | 139 | $ 133 | 0,01 |
| 1,476 % fällig am 25.08.2046 | | 119 | 115 | 0,01 |
| 1,723 % fällig am 25.07.2046 | | 249 | 224 | 0,01 |
| 1,723 % fällig am 25.08.2046 | | 2.018 | 1.842 | 0,08 |
| 1,723 % fällig am 25.11.2046 | | 2.040 | 1.876 | 0,08 |
| 1,824 % fällig am 25.12.2046 | | 192 | 186 | 0,01 |
| 1,876 % fällig am 25.06.2042 | | 11 | 10 | 0,00 |
| 1,876 % fällig am 25.08.2042 | | 34 | 33 | 0,00 |
| 2,144 % fällig am 25.11.2045 | | 862 | 796 | 0,03 |
| 2,204 % fällig am 25.07.2045 | | 133 | 125 | 0,01 |
| 2,383 % fällig am 25.09.2033 | | 27 | 25 | 0,00 |
| 2,462 % fällig am 25.03.2034 | | 304 | 303 | 0,01 |
| 3,087 % fällig am 25.03.2036 | | 10 | 10 | 0,00 |
| 3,125 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 155 | 147 | 0,01 |
| 3,222 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 79 | 72 | 0,00 |
| 3,340 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 31 | 26 | 0,00 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 1,196 % fällig am 25.12.2046 | | 3.230 | 2.696 | 0,11 |
| 2,224 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 1.441 | 806 | 0,03 |
| 2,324 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 337 | 273 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.07.2035 ^ | | 428 | 399 | 0,02 |
| 5,750 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 332 | 318 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 144 | 106 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 288 | 276 | 0,01 |
| **Wells Fargo Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,974 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 284 | 252 | 0,01 |
| | | | 176.805 | 7,26 |

## FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,569 % fällig am 25.09.2035 | | 6.171 | 5.443 | 0,22 |
| **Accunia European CLO DAC** | | | | |
| 0,930 % fällig am 15.10.2030 | € | 3.079 | 3.187 | 0,13 |
| 0,950 % fällig am 15.07.2030 | | 3.767 | 3.889 | 0,16 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,744 % fällig am 25.08.2036 ^ | $ | 1.482 | 417 | 0,02 |
| 2,449 % fällig am 25.12.2045 ^ | | 1.009 | 840 | 0,03 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,329 % fällig am 25.11.2035 | | 4.376 | 4.310 | 0,18 |
| 2,644 % fällig am 25.09.2034 | | 1.704 | 1.687 | 0,07 |
| **AMMC CLO 21 Ltd.** | | | | |
| 2,536 % fällig am 02.11.2030 | | 2.400 | 2.362 | 0,10 |
| **Amortizing Residential Collateral Trust** | | | | |
| 2,324 % fällig am 25.10.2031 | | 23 | 22 | 0,00 |
| **AMRESCO Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.06.2029 | | 6 | 6 | 0,00 |
| **Ares European CLO DAC** | | | | |
| 0,850 % fällig am 20.04.2032 | € | 2.900 | 2.953 | 0,12 |
| 1,120 % fällig am 21.10.2033 | | 8.500 | 8.728 | 0,36 |
| **Argent Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,104 % fällig am 25.05.2035 | $ | 1.121 | 1.007 | 0,04 |
| **Argent Securities Trust** | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.09.2036 | | 1.973 | 722 | 0,03 |
| 1,844 % fällig am 25.05.2036 | | 555 | 151 | 0,01 |
| 1,924 % fällig am 25.06.2036 | | 1.659 | 524 | 0,02 |
| 1,924 % fällig am 25.07.2036 | | 4.442 | 3.935 | 0,16 |
| **Armada Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.07.2031 | € | 1.550 | 1.579 | 0,07 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | |
| 1,734 % fällig am 25.01.2037 | $ | 1.014 | 622 | 0,03 |
| 1,784 % fällig am 25.01.2037 | | 440 | 271 | 0,01 |
| 2,324 % fällig am 25.06.2034 | | 723 | 696 | 0,03 |
| 2,674 % fällig am 25.03.2034 ^ | | 366 | 352 | 0,01 |
| **Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,719 % fällig am 25.02.2035 | | 891 | 880 | 0,04 |
| **Aurium CLO DAC** | | | | |
| 0,730 % fällig am 16.01.2031 | € | 5.700 | 5.855 | 0,24 |
| 1,050 % fällig am 23.03.2032 | | 5.000 | 5.128 | 0,21 |
| **Avoca CLO DAC** | | | | |
| 0,690 % fällig am 15.07.2030 | | 5.143 | 5.301 | 0,22 |
| **Babson CLO Ltd.** | | | | |
| 2,053 % fällig am 20.01.2031 | $ | 5.700 | 5.608 | 0,23 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.11.2036 | | 1.326 | 1.271 | 0,05 |
| 1,824 % fällig am 25.12.2036 | | 18 | 18 | 0,00 |
| 1,854 % fällig am 25.02.2037 | | 3.284 | 3.119 | 0,13 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| 2,254 % fällig am 25.02.2036 | $ | 1.217 | $ | 1.214 | 0,05 |
| 2,479 % fällig am 25.07.2034 | | 1.549 | | 1.470 | 0,06 |
| 2,674 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 811 | | 753 | 0,03 |
| 2,718 % fällig am 25.07.2036 | | 68 | | 67 | 0,00 |
| 3,157 % fällig am 25.06.2043 | | 53 | | 50 | 0,00 |
| 3,499 % fällig am 25.08.2034 | | 326 | | 323 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.08.2036 | | 29 | | 29 | 0,00 |
| **Belle Haven ABS CDO Ltd.** | | | | | |
| 0,663 % fällig am 03.11.2044 | | 4.668 | | 1.496 | 0,06 |
| 0,703 % fällig am 03.11.2044 | | 6.905 | | 2.231 | 0,09 |
| **Black Diamond CLO DAC** | | | | | |
| 0,860 % fällig am 20.01.2032 | € | 1.298 | | 1.340 | 0,06 |
| 0,980 % fällig am 15.05.2032 | | 5.500 | | 5.619 | 0,23 |
| **BlueMountain Fuji EUR CLO DAC** | | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.01.2031 | | 9.500 | | 9.676 | 0,40 |
| 1,050 % fällig am 15.01.2031 | | 500 | | 505 | 0,02 |
| **BNPP AM Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 15.10.2031 | | 1.481 | | 1.523 | 0,06 |
| 0,820 % fällig am 22.07.2032 | | 5.800 | | 5.886 | 0,24 |
| **Bosphorus CLO DAC** | | | | | |
| 0,820 % fällig am 15.12.2030 | | 1.500 | | 1.536 | 0,06 |
| **Cairn CLO DAC** | | | | | |
| 0,670 % fällig am 31.01.2030 | | 3.877 | | 3.985 | 0,16 |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | | 5.300 | | 5.400 | 0,22 |
| **Carlyle Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,630 % fällig am 15.08.2030 | | 1.596 | | 1.636 | 0,07 |
| 0,700 % fällig am 15.01.2031 | | 6.500 | | 6.639 | 0,27 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,960 % fällig am 16.01.2033 | | 3.600 | | 3.660 | 0,15 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.11.2031 | | 11.100 | | 11.400 | 0,47 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.10.2036 | $ | 3.279 | | 3.160 | 0,13 |
| 1,864 % fällig am 25.06.2036 | | 1.150 | | 1.111 | 0,05 |
| 1,874 % fällig am 25.10.2036 | | 974 | | 815 | 0,03 |
| 2,524 % fällig am 25.05.2034 | | 514 | | 485 | 0,02 |
| **Centex Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.09.2034 | | 323 | | 311 | 0,01 |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,974 % fällig am 25.10.2037 | | 1.242 | | 1.237 | 0,05 |
| 3,124 % fällig am 25.10.2037 | | 10.000 | | 9.363 | 0,38 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 1,794 % fällig am 25.07.2045 | | 1.448 | | 1.101 | 0,05 |
| 1,824 % fällig am 25.05.2037 | | 4.083 | | 3.023 | 0,12 |
| 1,944 % fällig am 25.12.2036 | | 261 | | 196 | 0,01 |
| 2,124 % fällig am 25.08.2036 | | 2.756 | | 2.670 | 0,11 |
| 2,144 % fällig am 25.09.2036 | | 681 | | 619 | 0,03 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | | |
| 2,569 % fällig am 25.10.2034 | | 400 | | 390 | 0,02 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | | |
| 2,304 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 95 | | 73 | 0,00 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 11 | | 11 | 0,00 |
| 1,824 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 5.339 | | 4.802 | 0,20 |
| 1,834 % fällig am 25.05.2047 ^ | | 2.016 | | 1.911 | 0,08 |
| 1,844 % fällig am 25.09.2047 ^ | | 2.009 | | 1.940 | 0,08 |
| 3,349 % fällig am 25.05.2035 | | 1.143 | | 1.132 | 0,05 |
| 3,574 % fällig am 25.08.2035 | | 1.485 | | 1.439 | 0,06 |
| 4,444 % fällig am 25.07.2036 | | 2.871 | | 2.618 | 0,11 |
| 4,550 % fällig am 25.10.2032 ^ | | 1.612 | | 1.564 | 0,06 |
| 6,095 % fällig am 25.08.2035 | | 183 | | 180 | 0,01 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | | |
| 2,244 % fällig am 25.01.2032 | | 3 | | 3 | 0,00 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC** | | | | | |
| 3,009 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 604 | | 510 | 0,02 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 3,291 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 9.459 | | 3.978 | 0,16 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | | | |
| 1,694 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 147 | | 54 | 0,00 |
| 2,124 % fällig am 25.07.2036 | | 2.178 | | 2.067 | 0,09 |
| 3,136 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 151 | | 57 | 0,00 |
| **CSAB Mortgage-Backed Trust** | | | | | |
| 6,220 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 3.414 | | 1.261 | 0,05 |
| **CVC Cordatus Loan Fund DAC** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 21.07.2030 | € | 13.189 | | 13.610 | 0,56 |
| 0,890 % fällig am 26.08.2032 | | 500 | | 507 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Delta Funding Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 2,144 % fällig am 15.09.2029 | $ | 6 | $ | 5 | 0,00 |
| **Dryden Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.04.2033 | € | 8.900 | | 9.028 | 0,37 |
| 0,860 % fällig am 15.05.2034 | | 5.800 | | 5.866 | 0,24 |
| **EMC Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,364 % fällig am 25.05.2040 | $ | 120 | | 112 | 0,00 |
| **Euro-Galaxy CLO DAC** | | | | | |
| 0,620 % fällig am 24.04.2034 | € | 3.800 | | 3.872 | 0,16 |
| **Fieldstone Mortgage Investment Trust** | | | | | |
| 1,326 % fällig am 25.11.2036 | $ | 1.158 | | 756 | 0,03 |
| 1,964 % fällig am 25.04.2047 | | 4.232 | | 3.247 | 0,13 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,344 % fällig am 25.11.2035 | | 1.360 | | 1.290 | 0,05 |
| 2,524 % fällig am 25.07.2035 | | 2.206 | | 2.174 | 0,09 |
| **First NLC Trust** | | | | | |
| 1,804 % fällig am 25.08.2037 | | 6.884 | | 3.911 | 0,16 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | | |
| 1,724 % fällig am 25.08.2036 | | 640 | | 238 | 0,01 |
| 1,754 % fällig am 25.11.2036 | | 1.825 | | 732 | 0,03 |
| 1,759 % fällig am 25.10.2036 | | 1.874 | | 1.703 | 0,07 |
| 1,904 % fällig am 25.02.2037 | | 7.570 | | 5.977 | 0,25 |
| 1,964 % fällig am 25.02.2037 | | 1.642 | | 637 | 0,03 |
| 2,124 % fällig am 25.05.2036 | | 1.282 | | 804 | 0,03 |
| 2,239 % fällig am 25.11.2035 | | 6.788 | | 6.055 | 0,25 |
| 2,359 % fällig am 25.07.2035 | | 376 | | 375 | 0,02 |
| 2,494 % fällig am 25.05.2034 | | 1.754 | | 1.687 | 0,07 |
| **GE-WMC Mortgage Securities Trust** | | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.08.2036 | | 10.218 | | 5.014 | 0,21 |
| **GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC** | | | | | |
| 0,900 % fällig am 20.01.2032 | € | 2.900 | | 2.946 | 0,12 |
| **Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.** | | | | | |
| 2,504 % fällig am 15.09.2037 | $ | 9.200 | | 9.074 | 0,37 |
| **Grosvenor Place CLO BV** | | | | | |
| 0,720 % fällig am 30.10.2029 | € | 1.762 | | 1.834 | 0,08 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | | | |
| 2,524 % fällig am 25.08.2037 | $ | 128 | | 128 | 0,01 |
| 5,985 % fällig am 25.06.2036 | | 6.219 | | 1.959 | 0,08 |
| **GSAMP Trust** | | | | | |
| 1,824 % fällig am 25.11.2036 | | 2.851 | | 1.515 | 0,06 |
| 2,144 % fällig am 25.06.2036 | | 2.814 | | 2.725 | 0,11 |
| 2,164 % fällig am 25.04.2036 | | 587 | | 420 | 0,02 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 26.06.2030 | € | 12.868 | | 13.223 | 0,54 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | | |
| 2,719 % fällig am 25.05.2035 | $ | 222 | | 219 | 0,01 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.07.2037 | | 789 | | 476 | 0,02 |
| 1,864 % fällig am 25.04.2037 | | 903 | | 628 | 0,03 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | | | |
| 1,814 % fällig am 25.01.2037 | | 867 | | 649 | 0,03 |
| 1,844 % fällig am 25.12.2036 | | 1.615 | | 522 | 0,02 |
| 2,064 % fällig am 25.12.2036 | | 2.452 | | 791 | 0,03 |
| 2,404 % fällig am 25.01.2036 | | 9.268 | | 8.126 | 0,33 |
| **IXIS Real Estate Capital Trust** | | | | | |
| 2,084 % fällig am 25.01.2037 | | 276 | | 112 | 0,00 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.07.2036 | | 622 | | 315 | 0,01 |
| 2,029 % fällig am 25.05.2036 | | 547 | | 552 | 0,02 |
| 2,029 % fällig am 25.07.2036 | | 2.796 | | 2.710 | 0,11 |
| 4,436 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 850 | | 524 | 0,02 |
| **Lehman XS Trust** | | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.05.2036 | | 2.146 | | 2.381 | 0,10 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 1,734 % fällig am 25.11.2036 | | 9.247 | | 3.257 | 0,13 |
| 2,064 % fällig am 25.02.2036 | | 2.086 | | 2.030 | 0,08 |
| 2,224 % fällig am 25.02.2036 | | 273 | | 234 | 0,01 |
| 2,304 % fällig am 25.01.2046 | | 172 | | 172 | 0,01 |
| **Madison Park Funding Ltd.** | | | | | |
| 1,794 % fällig am 15.04.2029 | | 3.888 | | 3.837 | 0,16 |
| **Man GLG Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,690 % fällig am 15.12.2031 | € | 3.500 | | 3.581 | 0,15 |
| 0,870 % fällig am 15.01.2030 | | 449 | | 466 | 0,02 |
| **Massachusetts Educational Financing Authority** | | | | | |
| 2,134 % fällig am 25.04.2038 | $ | 640 | | 641 | 0,03 |
| **MASTR Specialized Loan Trust** | | | | | |
| 1,974 % fällig am 25.05.2037 | | 84 | | 75 | 0,00 |
| 1,994 % fällig am 25.01.2037 | | 1.184 | | 579 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | | |
| 1,884 % fällig am 25.03.2037 | $ | 2.596 | $ | 2.298 | 0,09 |
| 1,944 % fällig am 25.03.2037 | | 904 | | 805 | 0,03 |
| 2,104 % fällig am 25.08.2037 | | 11.920 | | 6.778 | 0,28 |
| 2,144 % fällig am 25.04.2037 | | 1.414 | | 859 | 0,04 |
| 2,144 % fällig am 25.05.2037 | | 1.107 | | 718 | 0,03 |
| 2,209 % fällig am 25.12.2036 | | 128 | | 127 | 0,01 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | | |
| 1,684 % fällig am 25.12.2036 | | 1.136 | | 625 | 0,03 |
| 1,754 % fällig am 25.10.2036 | | 690 | | 623 | 0,03 |
| 1,764 % fällig am 25.10.2036 | | 28 | | 14 | 0,00 |
| 1,764 % fällig am 25.11.2036 | | 701 | | 375 | 0,02 |
| 1,764 % fällig am 25.05.2037 | | 3.094 | | 2.738 | 0,11 |
| 1,774 % fällig am 25.10.2036 | | 6.535 | | 3.683 | 0,15 |
| 1,774 % fällig am 25.11.2036 | | 1.106 | | 703 | 0,03 |
| 1,774 % fällig am 25.12.2036 | | 244 | | 135 | 0,01 |
| 1,804 % fällig am 25.03.2037 | | 1.064 | | 509 | 0,02 |
| 1,844 % fällig am 25.10.2036 | | 1.063 | | 544 | 0,02 |
| 1,854 % fällig am 25.10.2036 | | 4.077 | | 2.311 | 0,10 |
| 1,874 % fällig am 25.03.2037 | | 560 | | 269 | 0,01 |
| 1,924 % fällig am 25.06.2036 | | 15 | | 13 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.09.2036 | | 68 | | 27 | 0,00 |
| 2,404 % fällig am 25.01.2035 | | 1.197 | | 1.165 | 0,05 |
| 2,674 % fällig am 25.09.2033 | | 75 | | 73 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Capital, Inc. Trust** | | | | | |
| 1,984 % fällig am 25.03.2036 | | 1.114 | | 929 | 0,04 |
| **Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust** | | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.07.2036 | | 1.637 | | 744 | 0,03 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 2,344 % fällig am 25.03.2035 | | 536 | | 524 | 0,02 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 1,954 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 2.085 | | 498 | 0,02 |
| 2,509 % fällig am 25.09.2035 | | 275 | | 274 | 0,01 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.09.2037 | | 820 | | 808 | 0,03 |
| 1,834 % fällig am 25.01.2037 | | 1.381 | | 516 | 0,02 |
| 1,964 % fällig am 25.11.2036 | | 2.168 | | 815 | 0,03 |
| 3,499 % fällig am 25.03.2035 | | 1.092 | | 1.077 | 0,04 |
| **OCP Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,820 % fällig am 15.01.2032 | € | 4.000 | | 4.125 | 0,17 |
| 0,880 % fällig am 22.09.2034 | | 6.800 | | 6.882 | 0,28 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 1,844 % fällig am 25.04.2037 | $ | 4.963 | | 3.701 | 0,15 |
| 1,844 % fällig am 25.05.2037 | | 3.992 | | 2.690 | 0,11 |
| 2,359 % fällig am 25.08.2035 | | 238 | | 237 | 0,01 |
| **Ownit Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.05.2037 | | 644 | | 509 | 0,02 |
| **OZLM Ltd.** | | | | | |
| 2,336 % fällig am 30.04.2027 | | 46 | | 46 | 0,00 |
| 2,441 % fällig am 16.05.2030 | | 4.600 | | 4.522 | 0,19 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** | | | | | |
| 0,730 % fällig am 15.07.2031 | € | 9.148 | | 9.377 | 0,39 |
| 0,780 % fällig am 15.04.2031 | | 5.353 | | 5.527 | 0,23 |
| **Palmerston Park CLO DAC** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 18.04.2030 | | 2.050 | | 2.111 | 0,09 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | | |
| 2,344 % fällig am 25.08.2035 | $ | 124 | | 127 | 0,01 |
| 2,569 % fällig am 25.06.2035 | | 1.027 | | 1.027 | 0,04 |
| 2,944 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 1.600 | | 1.543 | 0,06 |
| **People's Choice Home Loan Securities Trust** | | | | | |
| 2,569 % fällig am 25.05.2035 ^ | | 3.402 | | 3.063 | 0,13 |
| 2,974 % fällig am 25.01.2035 | | 518 | | 503 | 0,02 |
| **Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust** | | | | | |
| 1,834 % fällig am 25.01.2037 | | 1.118 | | 1.079 | 0,04 |
| **RAAC Trust** | | | | | |
| 2,224 % fällig am 25.06.2044 | | 136 | | 118 | 0,01 |
| 2,384 % fällig am 25.10.2046 | | 1.548 | | 1.465 | 0,06 |
| 2,824 % fällig am 25.10.2045 | | 698 | | 695 | 0,03 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 2,324 % fällig am 25.08.2032 | | 9 | | 8 | 0,00 |
| 3,269 % fällig am 25.09.2037 | | 733 | | 553 | 0,02 |
| 5,612 % fällig am 25.04.2037 | | 2.967 | | 999 | 0,04 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | | | |
| 2,364 % fällig am 25.05.2037 | | 2.834 | | 2.641 | 0,11 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | | |
| 1,964 % fällig am 25.11.2036 | | 2.202 | | 2.061 | 0,08 |
| 2,144 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 877 | | 792 | 0,03 |
| 2,164 % fällig am 25.07.2036 | | 1.271 | | 1.129 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | | |
| 1,794 % fällig am 25.10.2046 | $ | 368 | $ 360 | 0,02 |
| **Sculptor European CLO DAC** | | | | |
| 0,790 % fällig am 14.01.2032 | € | 6.100 | 6.157 | 0,25 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.10.2036 | $ | 10.099 | 3.842 | 0,16 |
| 2,284 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 1.988 | 1.508 | 0,06 |
| 2,389 % fällig am 25.02.2034 | | 294 | 288 | 0,01 |
| 2,584 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 271 | 254 | 0,01 |
| **SG Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 1,834 % fällig am 25.10.2036 | | 1.700 | 1.310 | 0,05 |
| **Sierra Madre Funding Ltd.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 07.09.2039 | | 2.179 | 1.672 | 0,07 |
| 1,520 % fällig am 07.09.2039 | | 12.503 | 9.594 | 0,39 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 2,684 % fällig am 25.04.2023 | | 310 | 310 | 0,01 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 1,684 % fällig am 25.11.2036 | | 265 | 90 | 0,00 |
| 1,794 % fällig am 25.08.2037 | | 1.685 | 1.493 | 0,06 |
| 1,834 % fällig am 25.06.2037 | | 2.753 | 1.990 | 0,08 |
| 1,904 % fällig am 25.06.2037 | | 3.982 | 2.878 | 0,12 |
| 2,184 % fällig am 25.10.2036 | | 418 | 404 | 0,02 |
| 2,524 % fällig am 25.10.2037 | | 3.854 | 3.033 | 0,12 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.09.2037 | | 491 | 216 | 0,01 |
| 2,224 % fällig am 25.12.2036 | | 1.277 | 1.207 | 0,05 |
| 3,455 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 1.532 | 658 | 0,03 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 2,599 % fällig am 25.01.2035 | | 5.219 | 4.884 | 0,20 |
| 2,749 % fällig am 25.01.2035 | | 397 | 357 | 0,01 |
| 3,199 % fällig am 25.01.2035 | | 456 | 366 | 0,02 |
| 3,349 % fällig am 25.01.2035 ^ | | 285 | 91 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,779 % fällig am 25.09.2036 | | 7.271 | 5.242 | 0,22 |
| 1,804 % fällig am 25.01.2037 | | 842 | 490 | 0,02 |
| 2,124 % fällig am 25.11.2037 | | 2.238 | 2.134 | 0,09 |
| 2,562 % fällig am 25.04.2035 | | 81 | 80 | 0,00 |
| 2,629 % fällig am 25.11.2035 | | 6.400 | 6.219 | 0,26 |
| **Structured Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 2,314 % fällig am 25.09.2035 | | 4.228 | 4.054 | 0,17 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | |
| 0,920 % fällig am 15.07.2030 | € | 768 | 793 | 0,03 |
| 0,920 % fällig am 12.01.2032 | | 6.200 | 6.296 | 0,26 |
| **Triaxx Prime CDO Ltd.** | | | | |
| 1,380 % fällig am 02.10.2039 | $ | 1.842 | 113 | 0,00 |
| **WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust** | | | | |
| 1,849 % fällig am 25.05.2037 | | 3.365 | 3.139 | 0,13 |
| **Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.05.2036 | | 861 | 703 | 0,03 |
| 2,104 % fällig am 25.05.2036 | | 704 | 581 | 0,02 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.04.2037 | | 2.867 | 2.113 | 0,09 |
| 3,349 % fällig am 25.11.2035 | | 6.389 | 6.373 | 0,26 |
| | | | 490.102 | 20,12 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 09.07.2030 | | 3.875 | 843 | 0,03 |
| 1,000 % fällig am 09.07.2029 | | 483 | 114 | 0,00 |
| 1,125 % fällig am 09.07.2035 | $ | 10.189 | $ 2.151 | 0,09 |
| 15,500 % fällig am 17.10.2026 | ARS | 17.300 | 21 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 47,331 % fällig am 04.10.2022 | | 3.300 | 3 | 0,00 |
| **Argentina Treasury Bond BONCER** | | | | |
| 1,400 % fällig am 25.03.2023 | | 732.561 | 2.687 | 0,11 |
| **Israel Government International Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 03.07.2030 | $ | 4.000 | 3.715 | 0,15 |
| 3,800 % fällig am 13.05.2060 | | 8.600 | 7.188 | 0,30 |
| **Kuwait International Government Bond** | | | | |
| 3,500 % fällig am 20.03.2027 | | 3.300 | 3.291 | 0,14 |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | PEN | 16.700 | 4.017 | 0,17 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 53.300 | 12.410 | 0,51 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 | | 8.300 | 2.060 | 0,08 |
| 8,200 % fällig am 12.08.2026 | | 11.900 | 3.275 | 0,13 |
| **Provincia de Buenos Aires** | | | | |
| 49,102 % fällig am 12.04.2025 | ARS | 315.510 | 1.059 | 0,04 |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 3,875 % fällig am 23.04.2023 | $ | 4.900 | 4.923 | 0,20 |
| **Republic of Greece Government International Bond** | | | | |
| 1,875 % fällig am 24.01.2052 | € | 1.700 | 1.087 | 0,04 |
| 3,500 % fällig am 30.01.2023 | | 154 | 163 | 0,01 |
| 3,750 % fällig am 30.01.2028 | | 360 | 390 | 0,02 |
| 3,900 % fällig am 30.01.2033 | | 2.035 | 2.146 | 0,09 |
| 4,000 % fällig am 30.01.2037 | | 1.120 | 1.237 | 0,05 |
| **Romania Government International Bond** | | | | |
| 1,750 % fällig am 13.07.2030 | | 3.600 | 2.690 | 0,11 |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 4,850 % fällig am 30.09.2029 | $ | 10.100 | 8.653 | 0,36 |
| 10,500 % fällig am 21.12.2026 | ZAR | 894.100 | 57.794 | 2,37 |
| **Turkey Government International Bond** | | | | |
| 5,750 % fällig am 22.03.2024 | $ | 1.800 | 1.677 | 0,07 |
| 6,350 % fällig am 10.08.2024 | | 9.400 | 8.713 | 0,36 |
| 7,250 % fällig am 23.12.2023 | | 1.700 | 1.664 | 0,07 |
| | | | 133.971 | 5,50 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **ENERGIE** | | | | |
| **Constellation Oil Services Holding S.A. (c)(j)** | | 1.038.200 | 113 | 0,01 |
| **FINANZWERTE** | | | | |
| **Intelsat Emergence S.A. (c)(j)** | | 19.324 | 541 | 0,02 |
| **National Bank of Greece S.A. (c)** | | 307.710 | 918 | 0,04 |
| | | | 1.459 | 0,06 |
| | | | 1.572 | 0,07 |
| **RECHTE** | | | | |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp 05/12/2025** | | 4.046 | 20 | 0,00 |
| **OPTIONSSCHEINE** | | | | |
| **Constellation Oil Services Holding S.A. - Exp. 10/06/2071 (j)** | | 1 | 0 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | | |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 10,250 % | | 38.168 | $ 6.790 | 0,28 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | | |
| **Pacific Gas and Electric Co.** | | | | |
| 2,370 % fällig am 14.11.2022 | $ | 1.700 | 1.693 | 0,07 |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | | |
| 51,049 % fällig am 30.09.2022 (d)(e) | ARS | 831.200 | 2.786 | 0,12 |
| **ISRAEL TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,005) % fällig am 03.08.2022 (d)(e) | ILS | 27.200 | 7.767 | 0,32 |
| **JAPAN TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,094) % fällig am 12.09.2022 (d)(e) | ¥ | 10.600.000 | 78.048 | 3,20 |
| **U.S. TREASURY BILLS** | | | | |
| 0,722 % fällig am 26.07.2022 (d)(e)(l) | $ | 922 | 922 | 0,04 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 91.216 | 3,75 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | **$** | **2.236.497** | **91,83** |
| | | **AKTIEN** | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (g)** | | 1.496.908 | 12.709 | 0,52 |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (g)** | | 770.713 | 6.582 | 0,27 |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (g)** | | 9.217.998 | 91.719 | 3,77 |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)** | | 4.138 | 41 | 0,00 |
| | | | 111.051 | 4,56 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g)** | | 1.328.250 | 131.426 | 5,39 |
| **Summe Investmentfonds** | | | **$ 242.477** | **9,95** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 4.909 | U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | $ (5.007) | $ 4.909 | $ 4.909 | 0,20 |
| MBC | 1,490 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 47.900 | U.S. Treasury Notes 3,250 % fällig am 30.06.2027 | (49.443) | 47.900 | 47.902 | 1,97 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (54.450)** | **$ 52.809** | **$ 52.811** | **2,17** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bobl September Futures | Long | 09.2022 | 50 | $ (2) | 0,00 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Long | 09.2022 | 706 | (2.595) | (0,11) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 836 | 2.731 | 0,11 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 4.189 | (4.439) | (0,18) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 3.379 | (2.935) | (0,12) |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2022 | 1.318 | (1.675) | (0,07) |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 573 | 872 | 0,04 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2022 | 620 | 3.514 | 0,14 |
| | | | | $ (4.529) | (0,19) |

## VERKAUFSOPTIONEN

### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CME Kaufoptionen mit Ausübungskurs von @ USD 98,000 auf 3-Month SOFR December Futures | $ 98,000 | 15.12.2023 | 4 | $ (3) | $ (3) | 0,00 |
| Call - CME Verkaufoptionen mit Ausübungskurs von @ USD 96,500 auf 3-Month SOFR December Futures | 96,500 | 15.12.2023 | 4 | (4) | (5) | 0,00 |
| | | | | $ (7) | $ (8) | 0,00 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | **$ (4.537)** | **(0,19)** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| AES Corp. | 5,000 % | 20.12.2025 | $ 500 | $ (36) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.06.2024 | 5.300 | 32 | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.06.2026 | 3.000 | (62) | 0,00 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 | 20.03.2023 | 1.600 | (12) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.06.2023 | 6.100 | (51) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.06.2026 | 100 | (4) | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.12.2024 | € 7.000 | 20 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2026 | $ 4.300 | (120) | (0,01) |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2026 | 400 | (16) | 0,00 |
| MetLife, Inc. | 1,000 | 20.12.2022 | 7.200 | (100) | 0,00 |
| Stellantis NV | 5,000 | 20.06.2026 | € 3.000 | (349) | (0,02) |
| Stellantis NV | 5,000 | 20.12.2026 | 4.600 | (481) | (0,02) |
| Tesco PLC | 1,000 | 20.06.2028 | 4.300 | (164) | (0,01) |
| Valeo S.A. | 1,000 | 20.06.2026 | 1.000 | (49) | 0,00 |
| Valeo S.A. | 1,000 | 20.06.2028 | 400 | (39) | 0,00 |
| | | | | $ (1.431) | (0,06) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[2]

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-33 5-Year Index | (1,000) % | 20.06.2025 | $ 95 | $ 3 | 0,00 |
| CDX.HY-35 5-Year Index | (5,000) | 20.12.2025 | 47.322 | 1.849 | 0,08 |
| CDX.HY-36 5-Year Index | (5,000) | 20.06.2026 | 122.166 | 12.617 | 0,52 |
| CDX.IG-38 5-Year Index | (1,000) | 20.06.2027 | 50.600 | 23 | 0,00 |
| | | | | $ 14.492 | 0,60 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-37 5-Year Index | 5,000 % | 20.12.2026 | $ 396 | $ (36) | 0,00 |
| CDX.HY-38 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2027 | 2.574 | (85) | (0,01) |
| CDX.IG-35 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2025 | 200 | (2) | 0,00 |
| CDX.IG-36 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2026 | 700 | (14) | 0,00 |
| CDX.IG-37 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 500 | (10) | 0,00 |
| iTraxx Crossover 37 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2027 | € 16.500 | (756) | (0,03) |
| iTraxx Europe Main 37 10-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 2.400 | (52) | 0,00 |
| | | | | $ (955) | (0,04) |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 % | 07.02.2023 | £ | 69.700 | $ (935) | (0,04) |
| Erhalt[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 | 21.09.2027 | | 86.000 | 2.958 | 0,12 |
| Erhalt[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2032 | | 67.200 | (5.294) | (0,22) |
| Erhalt[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2052 | | 44.200 | 7.583 | 0,31 |
| Erhalt[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 21.12.2052 | $ | 24.100 | (697) | (0,03) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,853 | 18.05.2032 | | 22.200 | (1.591) | (0,06) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,206 | 04.01.2027 | BRL | 13.900 | (168) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,045 | 04.01.2027 | | 136.700 | (1.012) | (0,04) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,050 | 04.01.2027 | | 126.600 | (934) | (0,04) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,086 | 04.01.2027 | | 82.400 | (608) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,098 | 04.01.2027 | | 126.200 | (923) | (0,04) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,115 | 04.01.2027 | | 129.800 | (159) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,814 | 04.01.2027 | | 76.300 | (270) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,868 | 04.01.2027 | | 68.000 | (223) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,000 | 16.06.2026 | CAD | 71.100 | (3.886) | (0,16) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,220 | 03.03.2025 | | 9.200 | (416) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,235 | 04.03.2025 | | 13.600 | (629) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,275 | 03.03.2025 | | 8.300 | (365) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,276 | 03.03.2025 | | 5.000 | (220) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,290 | 03.03.2025 | | 2.500 | (109) | 0,00 |
| Zahlung[4] | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,000 | 14.11.2023 | | 54.100 | (689) | (0,03) |
| Zahlung[4] | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,060 | 28.10.2023 | | 347.500 | (4.283) | (0,18) |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,750 | 15.12.2026 | KRW | 160.467.700 | (8.853) | (0,37) |
| Erhalt | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,750 | 15.12.2031 | | 81.913.000 | 7.572 | 0,31 |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 2,000 | 15.12.2026 | | 67.230.600 | (3.470) | (0,14) |
| Erhalt | 3-Month KRW-KORIBOR | 2,000 | 15.12.2031 | | 35.676.700 | 2.996 | 0,12 |
| Zahlung[4] | 3-Month NZD-BBR | 3,000 | 01.11.2023 | NZD | 144.800 | (1.139) | (0,05) |
| Zahlung[4] | 3-Month NZD-BBR | 3,000 | 15.12.2023 | | 203.200 | (1.598) | (0,06) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 10.12.2029 | $ | 40 | 4 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 20.06.2028 | | 104.830 | (3.023) | (0,12) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 12.04.2027 | € | 8.500 | (391) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 11.05.2027 | | 7.200 | (332) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,700 | 11.04.2027 | | 4.400 | (194) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 13.05.2027 | | 9.200 | (297) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.05.2027 | | 4.500 | (147) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,660 | 24.03.2023 | MXN | 435.510 | (576) | (0,02) |
| Zahlung | UKRPI | 3,579 | 15.10.2033 | £ | 19.400 | (2.202) | (0,09) |
| Zahlung | UKRPI | 3,596 | 15.05.2034 | | 6.900 | (872) | (0,04) |
| | | | | | | $ (25.392) | (1,05) |
| | **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (13.286)** | **(0,55)** |

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

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

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

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

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

## OPTIONSKAUF

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,023 % | 29.06.2023 | 17.500 | $ 931 | $ 2.572 | 0,10 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,021 | 25.10.2023 | 7.600 | 434 | 1.393 | 0,06 |
| FAR | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,021 | 15.09.2023 | 12.200 | 640 | 2.100 | 0,09 |
| MYC | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,021 | 15.09.2023 | 12.800 | 696 | 2.253 | 0,09 |
| | | | | | | | $ 2.701 | $ 8.318 | 0,34 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 % | 20.07.2022 | 7.400 | $ (34) | $ (16) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 25.200 | (72) | (82) | (0,01) |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 3.100 | (6) | (1) | 0,00 |
| BRC | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 3.600 | (33) | (40) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 17.800 | (81) | (39) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 13.100 | (20) | (10) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 22.300 | (42) | (25) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 95,000 | 17.08.2022 | 3.000 | (36) | (46) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 8.200 | (73) | (92) | (0,01) |
| | | | | | | $ (397) | $ (351) | (0,02) |

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 0,021 % | 29.06.2023 | 85.800 | $ (932) | $ (4.074) | (0,17) |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 0,020 | 25.10.2023 | 38.000 | (435) | (1.963) | (0,08) |
| BPS | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 31.03.2023 | 140.000 | (234) | (80) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 31.03.2023 | 140.000 | (308) | (511) | (0,02) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 28.04.2023 | 9.000 | (16) | (7) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 28.04.2023 | 9.000 | (16) | (31) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,857 | 13.07.2022 | 36.600 | (415) | (3.019) | (0,13) |
| | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,350 | 08.08.2022 | 3.300 | (13) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,550 | 08.08.2022 | 3.300 | (13) | (66) | 0,00 |
| FAR | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 0,020 | 15.09.2023 | 61.000 | (640) | (3.187) | (0,13) |
| GLM | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,870 | 02.11.2022 | 345.100 | (692) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,270 | 02.11.2022 | 345.100 | (692) | (7.910) | (0,33) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,018 | 20.10.2023 | 3.700 | (24) | (28) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,018 | 20.10.2023 | 3.700 | (24) | (19) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,140 | 23.10.2023 | 3.700 | (26) | (30) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,140 | 23.10.2023 | 3.700 | (26) | (18) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,190 | 23.10.2023 | 3.700 | (26) | (32) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,190 | 23.10.2023 | 3.700 | (26) | (17) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,225 | 23.10.2023 | 3.700 | (26) | (32) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,225 | 23.10.2023 | 3.700 | (26) | (17) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,973 | 25.10.2023 | 3.700 | (25) | (27) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,973 | 25.10.2023 | 3.700 | (25) | (20) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,841 | 27.10.2023 | 3.700 | (25) | (25) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,841 | 27.10.2023 | 3.700 | (25) | (22) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 07.12.2023 | 10.800 | (34) | (47) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 07.12.2023 | 10.800 | (34) | (33) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,500 | 07.02.2023 | 467.700 | (1.614) | (6.038) | (0,25) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 26.04.2023 | 8.800 | (15) | (7) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 26.04.2023 | 8.800 | (15) | (30) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 0,020 | 15.09.2023 | 64.000 | (696) | (3.385) | (0,14) |
| | | | | | | | $ (7.118) | $ (30.678) | (1,26) |

### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPM | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | $ 99,141 | 07.09.2022 | 1.700 | $ (6) | $ (11) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,156 | 07.09.2022 | 13.200 | (46) | (88) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,656 | 07.09.2022 | 7.900 | (30) | (66) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 101,141 | 07.09.2022 | 1.700 | (4) | (7) | 0,00 |
| SAL | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | 94,688 | 07.09.2022 | 9.000 | (53) | (46) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 99,156 | 07.07.2022 | 12.600 | (91) | (80) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 100,281 | 07.07.2022 | 8.900 | (44) | (19) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,406 | 07.09.2022 | 12.000 | (42) | (89) | (0,01) |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,656 | 07.09.2022 | 14.000 | (54) | (117) | (0,01) |
| | | | | | $ (370) | $ (523) | (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 | Nenn-betrag[2] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Turkey Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 2.100 | $ (154) | $ (74) | $ (228) | (0,01) |
| BRC | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 200 | (14) | (8) | (22) | 0,00 |
| CBK | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 100 | (6) | 6 | 0 | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 100 | (2) | 0 | (2) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 300 | (3) | 0 | (3) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 1.000 | 4 | (24) | (20) | 0,00 |
| GST | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 400 | (6) | (1) | (7) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 2.700 | (11) | 12 | 1 | 0,00 |

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 1.600 | $ (24) | $ 16 | $ (8) | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 1.900 | (414) | (1.008) | (1.422) | (0,06) |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 15.500 | (686) | 383 | (303) | (0,01) |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 300 | (37) | (5) | (42) | 0,00 |
| HUS | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 200 | (6) | 5 | (1) | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 1.700 | (50) | 35 | (15) | 0,00 |
| JPM | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 200 | (12) | 10 | (2) | 0,00 |
| MYC | California State General Obligation Bonds, Series 2003 | 1,000 | 20.09.2024 | 2.900 | 23 | 28 | 51 | 0,00 |
| | | | | | $ (1.398 ) | $ (625 ) | $ (2.023) | (0,08) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 % | 17.11.2059 | $ 800 | $ (24) | $ 21 | $ (3) | 0,00 |
| MYC | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 11.000 | (379) | 339 | (40) | 0,00 |
| UAG | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 10.900 | (378) | 339 | (39) | 0,00 |
| | | | | | $ (781) | $ 699 | $ (82) | 0,00 |

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

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

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Erhalt | 6-Month THB-THBFIX | 1,000 % | 15.12.2026 | THB 905.200 | $ 151 | $ 1.663 | $ 1.814 | 0,07 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,500 | 15.12.2031 | 466.700 | (222) | (1.365) | (1.587) | (0,07) |
| CBK | Erhalt | 6-Month THB-THBFIX | 1,000 | 15.12.2026 | 467.100 | 93 | 843 | 936 | 0,04 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,500 | 15.12.2031 | 250.000 | (135) | (715) | (850) | (0,03) |
| DBL | Erhalt | 6-Month THB-THBFIX | 1,000 | 15.12.2026 | 426.000 | (32) | 886 | 854 | 0,03 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,500 | 15.12.2031 | 220.000 | (16) | (732) | (748) | (0,03) |
| GLM | Erhalt | 6-Month THB-THBFIX | 1,000 | 15.12.2026 | 3.356.200 | 245 | 6.084 | 6.329 | 0,26 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,500 | 15.12.2031 | 1.728.000 | (545) | (5.329) | (5.874) | (0,24) |
| JPM | Erhalt | 6-Month THB-THBFIX | 1,000 | 15.12.2026 | 1.240.000 | 259 | 2.079 | 2.338 | 0,10 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,500 | 15.12.2031 | 640.000 | (384) | (1.792) | (2.176) | (0,09) |
| | | | | | | $ (586) | $ 1.622 | $ 1.036 | 0,04 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | £ | 113.126 | $ | 143.035 | $ 5.650 | $ 0 | $ 5.650 | 0,23 |
| | 07.2022 | PEN | 16.118 | | 4.012 | 0 | (221) | (221) | (0,01) |
| | 07.2022 | $ | 390 | DKK | 2.739 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.610 | £ | 1.318 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 2.734 | $ | 390 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08.2022 | MXN | 19.916 | | 981 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN | 2.251 | | 571 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 5.476 | PEN | 21.133 | 67 | 0 | 67 | 0,00 |
| | 09.2022 | PEN | 17.814 | $ | 4.235 | 0 | (413) | (413) | (0,02) |
| | 11.2022 | | 29.854 | | 7.219 | 0 | (536) | (536) | (0,02) |
| | 11.2022 | ZAR | 61.507 | | 3.874 | 167 | 0 | 167 | 0,01 |
| | 02.2023 | PEN | 21.133 | | 5.382 | 0 | (71) | (71) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CAD | 1.614 | | 1.281 | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 4.225 | | 4.437 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 517 | | 627 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 29.003 | | 1.387 | 0 | (51) | (51) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.252 | CAD | 1.622 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 534.556 | € | 508.043 | 0 | (3.423) | (3.423) | (0,14) |
| | 07.2022 | | 8.169 | £ | 6.627 | 4 | (125) | (121) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.443 | MXN | 29.003 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 495.497 | $ | 522.114 | 3.140 | 0 | 3.140 | 0,13 |
| | 08.2022 | $ | 440 | INR | 34.291 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 08.2022 | ZAR | 238.960 | $ | 14.966 | 443 | 0 | 443 | 0,02 |
| | 09.2022 | ¥ | 4.863.000 | | 36.397 | 434 | 0 | 434 | 0,02 |
| | 09.2022 | MXN | 29.003 | | 1.422 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 09.2022 | TWD | 1.455 | | 52 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 132.208 | | 8.247 | 279 | 0 | 279 | 0,01 |
| BRC | 07.2022 | £ | 221 | | 267 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | ¥ | 5.737.000 | | 42.936 | 509 | 0 | 509 | 0,02 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 11.2022 | ZAR | 46.773 | $ | 2.914 | $ 95 | $ 0 | $ 95 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | PEN | 1.636 | | 416 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 28.964 | BRL | 140.714 | 0 | (2.058) | (2.058) | (0,08) |
| | 07.2022 | | 1.182 | € | 1.107 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 4.418 | PEN | 16.571 | 0 | (66) | (66) | 0,00 |
| | 08.2022 | ILS | 27.201 | $ | 8.489 | 711 | 0 | 711 | 0,03 |
| | 08.2022 | NZD | 1.107 | | 692 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN | 21.133 | | 5.355 | 0 | (188) | (188) | (0,01) |
| | 08.2022 | $ | 1.860 | PEN | 6.994 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| | 10.2022 | PEN | 12.657 | $ | 3.197 | 0 | (98) | (98) | 0,00 |
| | 11.2022 | | 18.521 | | 4.699 | 0 | (118) | (118) | 0,00 |
| | 12.2022 | | 30.115 | | 7.180 | 0 | (630) | (630) | (0,03) |
| DUB | 07.2022 | DKK | 1.261 | | 186 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.002 | PEN | 3.676 | 0 | (37) | (37) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 27 | PLN | 117 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 02.2023 | ZAR | 18.230 | $ | 1.092 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | $ | 1.099 | PEN | 4.112 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 09.2022 | HKD | 5.109 | $ | 652 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 65.131 | | 4.057 | 132 | 0 | 132 | 0,01 |
| | 05.2023 | | 32.040 | | 1.917 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| JPM | 08.2022 | KRW | 156.614 | | 123 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 886 | | 30 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 358 | CNH | 2.406 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 2.650 | COP | 10.180.350 | 0 | (224) | (224) | (0,01) |
| | 09.2022 | TWD | 1.723 | $ | 62 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | AUD | 11.244 | | 7.744 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 07.2022 | CAD | 2.554 | | 2.023 | 43 | 0 | 43 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 21.771 | € | 20.890 | 93 | (24) | 69 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 7.745 | AUD | 11.244 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 7.953 | CLP | 6.664.493 | 0 | (889) | (889) | (0,04) |
| | 08.2022 | | 807 | CNH | 5.418 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 05.2023 | | 813 | | 5.456 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | BRL | 140.714 | $ | 27.291 | 383 | 0 | 383 | 0,02 |
| | 07.2022 | DKK | 2.053 | | 304 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 3 | | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 763 | | 928 | 2 | (1) | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.237 | CAD | 1.604 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 82 | DKK | 575 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 89 | € | 85 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 730 | £ | 602 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 574 | $ | 82 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | KRW | 202.705 | | 159 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 263 | | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 27.077 | BRL | 140.714 | 0 | (401) | (401) | (0,02) |
| | 08.2022 | | 737 | INR | 57.593 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 09.2022 | TWD | 703 | $ | 25 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| RBC | 07.2022 | CAD | 3.254 | | 2.563 | 40 | 0 | 40 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 3.303 | CAD | 4.207 | 0 | (41) | (41) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 33 | MXN | 681 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | CAD | 1.686 | $ | 1.305 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 356 | | 437 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 185 | ILS | 623 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 26.246 | ¥ | 3.372.047 | 0 | (1.426) | (1.426) | (0,06) |
| | 08.2022 | NZD | 616 | $ | 384 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 1.435 | CNH | 9.610 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 11.2022 | COP | 1.203.477 | $ | 283 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | € | 525.815 | | 565.150 | 15.438 | 0 | 15.438 | 0,63 |
| | 07.2022 | $ | 131.012 | £ | 107.652 | 0 | (274) | (274) | (0,01) |
| | 08.2022 | £ | 107.652 | $ | 131.073 | 273 | 0 | 273 | 0,01 |
| UAG | 07.2022 | $ | 8.031 | AUD | 11.244 | 0 | (300) | (300) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 2.923 | ZAR | 47.031 | 0 | (57) | (57) | 0,00 |
| | 08.2022 | CLP | 6.614.249 | $ | 7.566 | 571 | 0 | 571 | 0,02 |
| | 08.2022 | NZD | 4.900 | | 3.146 | 101 | 0 | 101 | 0,00 |
| | 09.2022 | HKD | 1.853 | | 237 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | MXN | 44.291 | | 2.223 | 53 | 0 | 53 | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 179.301 | | 11.338 | 533 | 0 | 533 | 0,02 |
| | | | | | | $ 29.322 | $ (11.837) | $ 17.485 | 0,72 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Class Z AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | AUD | 6.265 | $ | 4.355 | $ 47 | $ 0 | $ 47 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 4.356 | AUD | 6.265 | 0 | (48) | (48) | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | AUD | 8.304 | $ | 5.769 | 59 | 0 | 59 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 7.138 | AUD | 9.915 | 0 | (321) | (321) | (0,01) |
| | 08.2022 | AUD | 24 | $ | 17 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08.2022 | $ 5.120 | AUD 7.372 | $ 0 | $ (49) | $ (49) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | AUD 1.661 | $ 1.148 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | 2.317 | 1.594 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 1.595 | AUD 2.317 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | AUD 340 | $ 239 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 8.193 | AUD 11.402 | 0 | (352) | (352) | (0,02 ) |
| SCX | 07.2022 | AUD 6.456 | $ 4.440 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 4.425 | AUD 6.432 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | AUD 4.609 | $ 3.173 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 3.090 | AUD 4.489 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | 7.463 | 10.448 | 0 | (278) | (278) | (0,01 ) |
| | | | | $ 123 | $ (1.052) | $ (929) | (0,04 ) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | CAD 254 | $ 198 | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 3.627 | CAD 4.603 | 0 | (59) | (59) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CAD 214 | $ 166 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 3.656 | CAD 4.636 | 0 | (62) | (62) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | 73 | 94 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 3.656 | 4.625 | 0 | (71) | (71) | (0,01) |
| | | | | $ 2 | $ (192) | $ (190) | (0,01) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | CHF 1.297 | $ 1.301 | $ 0 | $ (53) | $ (53) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 29.369 | CHF 28.064 | 0 | (54) | (54) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CHF 970 | $ 979 | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 936 | CHF 896 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | 29.349 | 28.092 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | CHF 26.923 | $ 28.343 | 221 | 0 | 221 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ 28.944 | CHF 27.762 | 55 | 0 | 55 | 0,00 |
| | 08.2022 | 28.343 | 26.878 | 0 | (220) | (220) | (0,01) |
| SCX | 07.2022 | CHF 622 | $ 655 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | 794 | 810 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | | | | $ 282 | $ (385) | $ (103) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und G Retail EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | € 417 | $ 447 | $ 12 | $ 0 | $ 12 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 3.452 | € 3.263 | 0 | (40) | (40) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | € 153.751 | $ 161.754 | 1.016 | 0 | 1.016 | 0,04 |
| | 07.2022 | $ 264 | € 248 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 08.2022 | 138.462 | 131.404 | 0 | (833) | (833) | (0,03) |
| BRC | 07.2022 | € 18.715 | $ 19.822 | 257 | 0 | 257 | 0,01 |
| CBK | 07.2022 | $ 17.718 | € 16.502 | 0 | (466) | (466) | (0,02) |
| MBC | 07.2022 | € 132.813 | $ 139.711 | 866 | (4) | 862 | 0,04 |
| | 07.2022 | $ 149.359 | € 138.501 | 0 | (4.563) | (4.563) | (0,19) |
| | 08.2022 | 138.488 | 131.404 | 0 | (858) | (858) | (0,04) |
| SOG | 07.2022 | 149.179 | 138.796 | 0 | (4.075) | (4.075) | (0,17) |
| UAG | 07.2022 | 128.585 | 119.659 | 0 | (3.488) | (3.488) | (0,14) |
| | | | | $ 2.151 | $ (14.332 ) | $ (12.181) | (0,50) |

Zum 30. Juni 2022 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 Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | £ 7.041 | $ 8.829 | $ 278 | $ 0 | $ 278 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ 426.733 | £ 337.509 | 0 | (16.846) | (16.846) | (0,69) |
| BPS | 07.2022 | £ 21.862 | $ 26.503 | 16 | (63) | (47) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 26.700 | £ 21.958 | 16 | (49) | (33) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | £ 457 | $ 562 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 425.028 | £ 336.942 | 0 | (15.830) | (15.830) | (0,65) |
| CBK | 07.2022 | 965 | 769 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | £ 103 | $ 127 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 324 | £ 259 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYI | 07.2022 | £ 83.621 | $ 101.016 | $ 0 | $ (537) | $ (537) | (0,02) |
| SCX | 07.2022 | $ 9.645 | £ 7.853 | 0 | (108) | (108) | (0,01) |
| SOG | 07.2022 | £ 310.731 | $ 378.160 | 792 | 0 | 792 | 0,03 |
| | 08.2022 | $ 378.335 | £ 310.731 | 0 | (787) | (787) | (0,03) |
| TOR | 07.2022 | 422.741 | 335.317 | 0 | (15.515) | (15.515) | (0,64) |
| | | | | $ 1.111 | $ (49.775) | $ (48.664) | (2,00) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | NOK 7.063 | $ 715 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 933 | NOK 8.807 | 0 | (42) | (42) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | NOK 8.467 | $ 858 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 934 | NOK 8.802 | 0 | (44) | (44) | (0,01) |
| | 08.2022 | 143 | 1.404 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | NOK 28 | $ 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | 314 | 32 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | 175 | 18 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 400 | 40 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | 7.063 | 715 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 924 | NOK 8.716 | 0 | (42) | (42) | 0,00 |
| | | | | $ 2 | $ (130) | $ (128) | (0,01) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | SEK 921 | $ 91 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 11 | SEK 109 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | SEK 23.204 | $ 2.283 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 2.283 | SEK 23.184 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | SEK 579 | $ 57 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 59 | SEK 599 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | SEK 478 | $ 49 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | 1.181 | 117 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 631 | 64 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 2.570 | SEK 25.114 | 0 | (119) | (119) | (0,01) |
| SOG | 07.2022 | 2.337 | 22.946 | 0 | (98) | (98) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | 2.473 | 24.212 | 0 | (110) | (110) | 0,00 |
| | | | | $ 26 | $ (347) | $ (321) | (0,01) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **$ (69.334)** | **(2,85)** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.07.2052 (i) | $ 109.800 | $ (95.320) | (3,91) |
| 2,000 % fällig am 01.08.2052 | 99.000 | (85.852) | (3,53) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (181.172)** | **(7,44)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 2.263.454** | **92,92** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ 172.374** | **7,08** |
| **Nettovermögen** | | **$ 2.435.828** | **100,00** |

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

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

**^** **Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a)** **Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

**(b)** **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

**(c)** **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

**(d)** **Nullkuponwertpapier.**

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

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

**(g) Mit dem Fonds verbunden.**

**(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(I) Zum 30. Juni 2022 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.**

**(j) Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|
| Citigroup. Inc, 3,290 % fällig am 17.03.2026 | 10.03.2022 | $ 4.300 | $ 4.162 | 0,17 |
| Constellation Oil Services Holding S,A, | 10.06.2022 | 113 | 113 | 0,01 |
| Constellation Oil Services Holding S,A, - Exp, 10.06.2071 | 10.06.2022 | 0 | 0 | 0,00 |
| Deutsche Bank AG 0,898 % fällig am 28.05.2024 | 25.05.2021 | 1.900 | 1.781 | 0,07 |
| Deutsche Bank AG 3,035 % fällig am 28.05.2032 | 25.05.2021 | 800 | 634 | 0,03 |
| Intelsat Emergence S,A, | 05.09.2018 | 2.000 | 541 | 0,02 |
| | | $ 9.113 | $ 7.231 | 0,30 |

**(k) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurde zum 30. Juni 2022 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von USD 465 als Sicherheiten verpfändet.**

**(l) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurde zum 30. Juni 2022 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von USD 124 und Barmittel in Höhe von USD 81.435 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von USD 43.181 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 2.234.804 | $ 1.693 | $ 2.236.497 |
| Investmentfonds | 111.051 | 131.426 | 0 | 242.477 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 52.809 | 0 | 52.809 |
| Finanzderivate[3] | 134 | (87.291) | 0 | (87.157) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (181.172) | 0 | (181.172) |
| **Summen** | **$ 111.185** | **$ 2.150.576** | **$ 1.693** | **$ 2.263.454** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 2.891.918 | $ 8.148 | $ 2.900.066 |
| Investmentfonds | 318.072 | 0 | 0 | 318.072 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 9.965 | 0 | 9.965 |
| Finanzderivate[3] | 616 | (23.878) | 0 | (23.262) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (262.976) | 0 | (262.976) |
| **Summen** | **$ 318.688** | **$ 2.615.029** | **$ 8.148** | **$ 2.941.865** |

(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 2022:**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| JML | (5,000) % | 08.04.2022 | TBD[1] | € (505) | $ (521) | (0,02) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (521)** | **(0,02)** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ (1) | $ 0 | $ (1) |
| BOA | (14.669) | 15.210 | 541 |
| BPS | 130 | 0 | 130 |
| BRC | (15.108) | 14.025 | (1.083) |
| CBK | (2.958) | 3.093 | 135 |
| DBL | 106 | 0 | 106 |
| DUB | (3.080) | 3.170 | 90 |
| FAR | (1.087) | 1.340 | 253 |

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| GLM | $ (13.765) | $ 14.604 | $ 839 |
| GST | (1.784) | 1.548 | (236) |
| HUS | (16) | 0 | (16) |
| JPM | (367) | 0 | (367) |
| MBC | (5.687) | 5.030 | (657) |
| MYC | (1.121) | 681 | (440) |
| MYI | (537) | 600 | 63 |
| RBC | (1) | 0 | (1) |
| RYL | 2 | 0 | 2 |
| SAL | (351) | 589 | 238 |
| SCX | (1.719) | 1.850 | 131 |
| SOG | 11.269 | (11.690) | (421) |
| TOR | (15.624) | 16.330 | 706 |
| UAG | (2.966) | 2.790 | (176) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 44,07 | 48,92 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 44,18 | 36,87 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 3,58 | 2,70 |
| Investmentfonds | 9,95 | 9,70 |
| Pensionsgeschäfte | 2,17 | 0,30 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,19) | (0,01) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,55) | (1,16) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (2,85) | 0,45 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (7,44) | (8,02) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (0,02) | (0,14) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 2,76 | 2,47 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 33,48 | 34,52 |
| Wandelanleihen & Wechsel | 0,56 | 0,50 |
| Kommunalanleihen und Wechsel | 0,51 | 0,44 |
| US-Regierungsbehörden | 9,60 | 2,49 |
| US-Schatzobligationen | 7,94 | 12,45 |
| Non-Agency-MBS | 7,26 | 6,38 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 20,12 | 16,61 |
| Staatsemissionen | 5,50 | 5,36 |
| Stammaktien | 0,07 | 0,03 |
| Bezugsrechte | 0,00 | k. A. |
| Optionsscheine | 0,00 | k. A. |
| Vorzugswertpapiere | 0,28 | 0,30 |
| Kurzfristige Instrumente | 3,75 | 6,94 |
| Investmentfonds | 9,95 | 9,70 |
| Pensionsgeschäfte | 2,17 | 0,30 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,19) | (0,01) |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | 0,00 | k. A. |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,06) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | 0,60 | (0,05) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,04) | 0,01 |
| Zinsswaps | (1,05) | (1,12) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoptionen | 0,34 | 0,07 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,02) | 0,00 |
| Zinsswapoptionen | (1,26) | (0,15) |
| Optionen auf Wertpapiere | (0,02) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,08) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | 0,00 | 0,01 |
| Zinsswaps | 0,04 | 0,01 |
| Devisenterminkontrakte | 0,72 | (0,32) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (2,57) | 0,83 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (7,44) | (8,02) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 7,08 | 10,25 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 17.10.2022 | € | 3.500 | € 3.481 | 0,06 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (d)(f) | | 1.200 | 1.156 | 0,02 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,237 % fällig am 25.04.2024 | | 4.500 | 4.498 | 0,07 |
| 0,750 % fällig am 26.07.2023 | | 15.000 | 14.892 | 0,25 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 03.09.2023 | | 7.000 | 6.989 | 0,12 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (d)(f) | £ | 1.200 | 1.374 | 0,02 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (d)(f) | $ | 2.400 | 2.261 | 0,04 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2022 (d)(f) | £ | 200 | 232 | 0,00 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 18.07.2022 (d)(f) | € | 400 | 400 | 0,01 |
| 6,750 % fällig am 13.06.2024 (d)(f) | | 400 | 386 | 0,01 |
| **Cajamar Caja Rural SCC** | | | | |
| 0,875 % fällig am 18.06.2023 | | 1.700 | 1.700 | 0,03 |
| **Castellum AB** | | | | |
| 2,125 % fällig am 20.11.2023 | | 2.600 | 2.526 | 0,04 |
| **Commerzbank AG** | | | | |
| 0,125 % fällig am 09.01.2024 | | 5.500 | 5.415 | 0,09 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,646 % fällig am 01.09.2023 | | 5.000 | 5.013 | 0,08 |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (f) | $ | 200 | 192 | 0,00 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 6,250 % fällig am 18.12.2024 (d)(f) | | 400 | 350 | 0,01 |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (d)(f) | | 1.000 | 885 | 0,01 |
| 7,500 % fällig am 11.12.2023 (d)(f) | | 2.000 | 1.827 | 0,03 |
| **Dell Bank International DAC** | | | | |
| 0,625 % fällig am 17.10.2022 | € | 19.300 | 19.314 | 0,32 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 1,125 % fällig am 30.08.2023 | | 1.600 | 1.593 | 0,03 |
| **Digital Dutch Finco BV** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.10.2022 | | 100 | 100 | 0,00 |
| **Digital Euro Finco LLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 16.01.2026 | | 900 | 867 | 0,01 |
| **DNB Boligkreditt A/S** | | | | |
| 0,375 % fällig am 14.11.2023 | | 3.800 | 3.765 | 0,06 |
| **Erste Group Bank AG** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.04.2024 (d)(f) | | 600 | 585 | 0,01 |
| **Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial** | | | | |
| 0,250 % fällig am 25.04.2023 | | 5.000 | 4.985 | 0,08 |
| **Europäische Finanzstabilisierungsfazilität** | | | | |
| 0,000 % fällig am 19.04.2024 (b) | | 15.000 | 14.739 | 0,24 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 0,434 % fällig am 26.09.2023 | | 12.500 | 12.501 | 0,21 |
| 0,579 % fällig am 07.02.2025 | | 17.700 | 17.621 | 0,29 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 16.09.2022 (d)(f) | | 800 | 790 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 29.09.2023 (d)(f) | | 200 | 198 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 23.03.2023 (d)(f) | $ | 200 | 188 | 0,00 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 2,125 % fällig am 30.08.2023 | € | 11.400 | 11.450 | 0,19 |
| 6,250 % fällig am 16.05.2024 (d)(f) | | 200 | 191 | 0,00 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.09.2023 (b) | | 2.500 | 2.484 | 0,04 |
| 0,500 % fällig am 15.09.2027 | | 10.000 | 9.461 | 0,16 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 0,125 % fällig am 13.09.2023 | | 2.800 | 2.736 | 0,05 |
| 0,750 % fällig am 03.10.2022 | | 1.000 | 1.001 | 0,02 |
| 1,000 % fällig am 02.05.2023 | | 5.100 | 5.075 | 0,08 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 1,000 % fällig am 09.11.2023 | | 1.000 | 984 | 0,02 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | |
| 0,198 % fällig am 30.05.2023 | | 1.300 | 1.303 | 0,02 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | |
| 1,020 % fällig am 11.10.2023 | | 2.500 | 2.476 | 0,04 |
| **Nasdaq, Inc.** | | | | |
| 3,850 % fällig am 30.06.2026 | $ | 100 | 95 | 0,00 |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 2,000 % fällig am 04.03.2025 | € | 7.000 | 6.918 | 0,11 |
| 2,500 % fällig am 22.03.2023 | | 3.000 | 3.028 | 0,05 |
| **NatWest Markets PLC** | | | | |
| 1,125 % fällig am 14.06.2023 | € | 1.100 | € 1.098 | 0,02 |
| **Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB** | | | | |
| 1,750 % fällig am 14.01.2025 | | 200 | 147 | 0,00 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 1,125 % fällig am 08.09.2023 | | 1.200 | 1.191 | 0,02 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 18.12.2023 (d)(f) | $ | 1.200 | 1.128 | 0,02 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 7,750 % fällig am 02.04.2023 (d)(f) | | 600 | 568 | 0,01 |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | |
| 6,500 % (d) | € | 1.051 | 1.023 | 0,02 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 24.07.2023 | | 2.500 | 2.537 | 0,04 |
| **UBS AG** | | | | |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (f) | $ | 250 | 240 | 0,00 |
| **Vesteda Finance BV** | | | | |
| 2,500 % fällig am 27.10.2022 | € | 100 | 100 | 0,00 |
| | | | 186.057 | 3,06 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **Bacardi Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 03.07.2023 | | 1.000 | 1.007 | 0,02 |
| **Becton Dickinson and Co.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 15.12.2022 | | 1.500 | 1.502 | 0,03 |
| **BMW Finance NV** | | | | |
| 0,625 % fällig am 06.10.2023 | | 900 | 891 | 0,01 |
| **Expedia Group, Inc.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 01.05.2025 | $ | 200 | 197 | 0,00 |
| **Highland Holdings SARL** | | | | |
| 0,000 % fällig am 12.11.2023 (b) | € | 5.200 | 5.078 | 0,08 |
| **Medtronic Global Holdings S.C.A.** | | | | |
| 0,375 % fällig am 07.03.2023 | | 300 | 300 | 0,01 |
| **Smurfit Kappa Acquisitions ULC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.01.2026 | | 500 | 493 | 0,01 |
| | | | 9.468 | 0,16 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **Contemporary Ruiding Development Ltd.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 17.09.2025 | $ | 4.800 | 4.243 | 0,07 |
| **EDP - Energias de Portugal S.A.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 27.11.2023 | € | 300 | 301 | 0,00 |
| **Eurogrid GmbH** | | | | |
| 1,625 % fällig am 03.11.2023 | | 3.000 | 2.993 | 0,05 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | |
| 1,498 % fällig am 03.11.2023 | $ | 8.250 | 7.779 | 0,13 |
| **Optus Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 20.06.2029 | € | 700 | 614 | 0,01 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.11.2022 | $ | 100 | 96 | 0,00 |
| | | | 16.026 | 0,26 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 211.551 | 3,48 |
| **WANDELANLEIHEN & WECHSEL** | | | | |
| **Luminar Technologies, Inc.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 15.12.2026 | | 17.000 | 9.253 | 0,15 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,850 % fällig am 25.04.2035 | | 31 | 29 | 0,00 |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | | |
| 6,750 % fällig am 25.11.2046 | | 63 | 53 | 0,00 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 2,924 % fällig am 25.09.2047 | | 192 | 172 | 0,00 |
| 4,737 % fällig am 26.03.2037 | | 389 | 368 | 0,01 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 3,357 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 497 | 420 | 0,01 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 3,224 % fällig am 25.09.2047 ^ | | 5.510 | 3.052 | 0,05 |
| 3,349 % fällig am 25.07.2034 | | 840 | 809 | 0,01 |
| **Canada Square Funding PLC** | | | | |
| 1,550 % fällig am 17.10.2051 | £ | 2.717 | 3.154 | 0,05 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,396 % fällig am 25.09.2037 ^ | $ | 56 | 49 | 0,00 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.02.2047 | $ | 64 | € 54 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.08.2035 | | 676 | 589 | 0,01 |
| 2,252 % fällig am 20.12.2035 | | 107 | 93 | 0,00 |
| 3,473 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 575 | 498 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 | | 274 | 172 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 | | 108 | 61 | 0,00 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 2,104 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 363 | 302 | 0,01 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,204 % fällig am 25.04.2035 | | 1.909 | 1.606 | 0,03 |
| 2,224 % fällig am 25.05.2035 | | 163 | 125 | 0,00 |
| 3,093 % fällig am 25.11.2037 | | 77 | 70 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | | 70 | 42 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.12.2037 | | 97 | 48 | 0,00 |
| **Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust** | | | | |
| 4,377 % fällig am 25.01.2034 ^ | | 662 | 564 | 0,01 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,802 % fällig am 19.10.2036 | | 94 | 79 | 0,00 |
| **Fingal Securities RMBS DAC** | | | | |
| 0,570 % fällig am 28.07.2055 | € | 80 | 80 | 0,00 |
| **Formentera Issuer PLC** | | | | |
| 1,348 % fällig am 28.07.2047 | £ | 3.788 | 4.325 | 0,07 |
| **FWD Securitization Trust** | | | | |
| 2,240 % fällig am 25.01.2050 | $ | 152 | 141 | 0,00 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 1,864 % fällig am 25.10.2045 | | 1.069 | 994 | 0,02 |
| **GSMPS Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,974 % fällig am 25.03.2035 | | 2.210 | 2.047 | 0,03 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,817 % fällig am 19.12.2036 | | 549 | 462 | 0,01 |
| 2,476 % fällig am 19.10.2035 | | 85 | 50 | 0,00 |
| **Harbour Energy PLC** | | | | |
| 1,305 % fällig am 28.01.2054 | £ | 1.791 | 2.056 | 0,03 |
| **Impac CMB Trust** | | | | |
| 2,264 % fällig am 25.03.2035 | $ | 57 | 51 | 0,00 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,804 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 81 | 72 | 0,00 |
| 2,204 % fällig am 25.01.2036 | | 540 | 373 | 0,01 |
| 3,131 % fällig am 25.08.2037 | | 2.965 | 2.066 | 0,03 |
| 3,276 % fällig am 25.06.2036 | | 1.902 | 1.569 | 0,03 |
| **Kentmere PLC** | | | | |
| 1,305 % fällig am 28.01.2042 | £ | 1.631 | 1.874 | 0,03 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 1,874 % fällig am 25.08.2037 | $ | 2.098 | 1.862 | 0,03 |
| **Miravet SARL** | | | | |
| 0,494 % fällig am 26.05.2065 | € | 3.314 | 3.324 | 0,05 |
| **Mortgage Equity Conversion Asset Trust** | | | | |
| 3,280 % fällig am 25.05.2042 | $ | 134 | 125 | 0,00 |
| **New Residential Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,500 % fällig am 25.05.2058 | | 466 | 443 | 0,01 |
| **Polaris 2022-2 PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 23.05.2059 | £ | 11.300 | 13.130 | 0,22 |
| **Polaris PLC** | | | | |
| 1,730 % fällig am 23.12.2058 | | 1.510 | 1.730 | 0,03 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 1,259 % fällig am 25.10.2037 | $ | 353 | 312 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.07.2036 | | 100 | 82 | 0,00 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2045 | £ | 7.985 | 9.263 | 0,15 |
| 1,547 % fällig am 20.02.2045 | | 555 | 643 | 0,01 |
| 1,605 % fällig am 20.10.2051 | | 2.403 | 2.783 | 0,05 |
| **Tower Bridge Funding PLC** | | | | |
| 1,407 % fällig am 20.11.2063 | | 8.753 | 10.043 | 0,17 |
| **Tudor Rose Mortgages** | | | | |
| 1,390 % fällig am 20.06.2048 | | 2.884 | 3.311 | 0,05 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 1,723 % fällig am 25.08.2046 | $ | 8.511 | 7.431 | 0,12 |
| 2,424 % fällig am 25.06.2044 | | 328 | 295 | 0,01 |
| 3,325 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 37 | 34 | 0,00 |
| | | | 83.380 | 1,37 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,494 % fällig am 25.09.2035 | | 2.800 | 2.535 | 0,04 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Accunia European CLO DAC** | | | | |
| 0,930 % fällig am 15.10.2030 | € | 891 | € 882 | 0,02 |
| 0,950 % fällig am 15.07.2030 | | 1.256 | 1.240 | 0,02 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.04.2036 | $ | 293 | 271 | 0,01 |
| 1,924 % fällig am 25.07.2036 | | 238 | 91 | 0,00 |
| **Adagio CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.10.2031 | € | 2.500 | 2.451 | 0,04 |
| **Aqueduct European CLO DAC** | | | | |
| 0,640 % fällig am 20.07.2030 | | 3.659 | 3.606 | 0,06 |
| **Ares European CLO DAC** | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.10.2030 | | 2.995 | 2.941 | 0,05 |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | | 6.400 | 6.258 | 0,10 |
| **Armada Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.07.2031 | | 6.300 | 6.138 | 0,10 |
| **Asset-Backed European Securitisation Transaction** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.12.2028 | | 197 | 197 | 0,00 |
| **Aurium CLO DAC** | | | | |
| 0,670 % fällig am 16.04.2030 | | 598 | 589 | 0,01 |
| **Avoca CLO DAC** | | | | |
| 0,690 % fällig am 15.07.2030 | | 1.744 | 1.719 | 0,03 |
| 0,820 % fällig am 15.10.2032 | | 1.900 | 1.853 | 0,03 |
| **Bain Capital Euro DAC** | | | | |
| 0,740 % fällig am 20.01.2032 | | 2.900 | 2.814 | 0,05 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,674 % fällig am 25.08.2037 | $ | 174 | 154 | 0,00 |
| **Black Diamond CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 03.10.2029 | € | 95 | 95 | 0,00 |
| 0,860 % fällig am 20.01.2032 | | 1.997 | 1.972 | 0,03 |
| 0,980 % fällig am 15.05.2032 | | 3.000 | 2.932 | 0,05 |
| **Blackrock European CLO DAC** | | | | |
| 0,620 % fällig am 15.10.2031 | | 5.000 | 4.835 | 0,08 |
| **BlueMountain Fuji EUR CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 15.07.2030 | | 1.809 | 1.782 | 0,03 |
| 0,720 % fällig am 15.01.2031 | | 3.100 | 3.020 | 0,05 |
| 0,910 % fällig am 15.01.2033 | | 1.000 | 962 | 0,02 |
| 1,050 % fällig am 15.01.2031 | | 400 | 387 | 0,01 |
| **BNPP AM Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,600 % fällig am 15.04.2031 | | 300 | 292 | 0,01 |
| 0,650 % fällig am 15.10.2031 | | 247 | 243 | 0,00 |
| **Cairn CLO DAC** | | | | |
| 0,600 % fällig am 30.04.2031 | | 3.698 | 3.650 | 0,06 |
| 0,650 % fällig am 20.10.2028 | | 141 | 140 | 0,00 |
| 0,670 % fällig am 31.01.2030 | | 631 | 621 | 0,01 |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | | 3.700 | 3.606 | 0,06 |
| 0,790 % fällig am 25.07.2029 | | 1.941 | 1.921 | 0,03 |
| **Carlyle Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 15.08.2030 | | 200 | 196 | 0,00 |
| 0,700 % fällig am 15.01.2031 | | 5.000 | 4.885 | 0,08 |
| 0,890 % fällig am 15.08.2032 | | 1.450 | 1.407 | 0,02 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,960 % fällig am 16.01.2033 | | 1.000 | 972 | 0,02 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.11.2031 | | 3.650 | 3.586 | 0,06 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,224 % fällig am 25.01.2036 | $ | 11.000 | 10.238 | 0,17 |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,124 % fällig am 25.10.2037 | | 400 | 358 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,251 % fällig am 25.10.2037 | | 789 | 682 | 0,01 |
| 7,250 % fällig am 25.05.2036 | | 119 | 67 | 0,00 |
| **Contego CLO BV** | | | | |
| 0,770 % fällig am 15.10.2030 | € | 1.000 | 979 | 0,02 |
| **Contego CLO DAC** | | | | |
| 0,640 % fällig am 23.01.2030 | | 2.298 | 2.259 | 0,04 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.08.2037 | $ | 2.441 | 2.308 | 0,04 |
| 1,814 % fällig am 25.11.2037 | | 31 | 30 | 0,00 |
| 1,844 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 64 | 63 | 0,00 |
| 1,874 % fällig am 25.02.2036 | | 124 | 115 | 0,00 |
| **CVC Cordatus Loan Fund DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 15.09.2031 | € | 2.700 | 2.640 | 0,04 |
| 0,650 % fällig am 21.07.2030 | | 4.779 | 4.717 | 0,08 |
| 0,650 % fällig am 15.10.2031 | | 8.700 | 8.491 | 0,14 |
| **Dryden Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.04.2033 | | 5.000 | 4.851 | 0,08 |
| 0,860 % fällig am 15.05.2034 | | 5.900 | 5.708 | 0,09 |
| **Ellington Loan Acquisition Trust** | | | | |
| 2,724 % fällig am 25.05.2037 | $ | 105 | € 97 | 0,00 |
| **Euro-Galaxy CLO DAC** | | | | |
| 0,620 % fällig am 24.04.2034 | € | 3.700 | 3.607 | 0,06 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,329 % fällig am 25.11.2036 | $ | 9.000 | 8.303 | 0,14 |
| **Fortuna Consumer Loan ABS DAC** | | | | |
| 0,206 % fällig am 18.10.2030 | € | 1.397 | 1.398 | 0,02 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.01.2037 | $ | 418 | 233 | 0,00 |
| **GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC** | | | | |
| 0,900 % fällig am 20.01.2032 | € | 900 | 874 | 0,01 |
| **Griffith Park CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 21.11.2031 | | 16.100 | 15.762 | 0,26 |
| **Grosvenor Place CLO BV** | | | | |
| 0,720 % fällig am 30.10.2029 | | 252 | 251 | 0,00 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | | |
| 1,724 % fällig am 25.12.2046 | $ | 1.025 | 548 | 0,01 |
| 5,985 % fällig am 25.06.2036 | | 1.175 | 354 | 0,01 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | € | 106 | 105 | 0,00 |
| 0,640 % fällig am 15.10.2031 | | 4.400 | 4.298 | 0,07 |
| 0,650 % fällig am 26.06.2030 | | 3.959 | 3.892 | 0,06 |
| 0,680 % fällig am 20.10.2031 | | 7.400 | 7.222 | 0,12 |
| 0,760 % fällig am 15.07.2031 | | 4.000 | 3.852 | 0,06 |
| 0,850 % fällig am 15.01.2032 | | 19.900 | 19.370 | 0,32 |
| 1,040 % fällig am 15.07.2031 | | 500 | 474 | 0,01 |
| **Hill FL BV** | | | | |
| 0,202 % fällig am 18.05.2030 | | 13.700 | 13.681 | 0,23 |
| **Invesco Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 15.07.2031 | | 500 | 485 | 0,01 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 1,834 % fällig am 25.10.2036 | $ | 123 | 115 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.03.2037 | | 14.800 | 13.342 | 0,22 |
| **Jubilee CLO DAC** | | | | |
| 0,391 % fällig am 12.07.2028 | € | 71 | 71 | 0,00 |
| 0,519 % fällig am 15.12.2029 | | 504 | 499 | 0,01 |
| 0,600 % fällig am 15.04.2030 | | 1.400 | 1.380 | 0,02 |
| 0,610 % fällig am 15.04.2030 | | 3.800 | 3.754 | 0,06 |
| 0,650 % fällig am 15.04.2031 | | 4.300 | 4.208 | 0,07 |
| **Laurelin DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 20.10.2031 | | 4.700 | 4.606 | 0,08 |
| **Madison Park Euro Funding DAC** | | | | |
| 0,800 % fällig am 15.07.2032 | | 3.200 | 3.102 | 0,05 |
| **Man GLG Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,680 % fällig am 15.10.2030 | | 2.291 | 2.244 | 0,04 |
| 0,690 % fällig am 15.12.2031 | | 4.400 | 4.306 | 0,07 |
| 0,870 % fällig am 15.01.2030 | | 642 | 636 | 0,01 |
| **Marlay Park CLO DAC** | | | | |
| 0,740 % fällig am 15.10.2030 | | 1.000 | 986 | 0,02 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,404 % fällig am 25.02.2034 | $ | 1.335 | 1.206 | 0,02 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 1,874 % fällig am 25.07.2036 | | 143 | 116 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.07.2036 | | 270 | 111 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,724 % fällig am 25.04.2037 | | 108 | 60 | 0,00 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 1,824 % fällig am 25.09.2037 | | 154 | 142 | 0,00 |
| **Oak Hill European Credit Partners DAC** | | | | |
| 0,730 % fällig am 20.01.2032 | € | 899 | 884 | 0,02 |
| 0,740 % fällig am 20.10.2031 | | 8.200 | 7.983 | 0,13 |
| **Oak Hill European Credit Partners Ltd.** | | | | |
| 0,900 % fällig am 22.07.2030 | | 686 | 682 | 0,01 |
| **OCP Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,880 % fällig am 22.09.2034 | | 5.200 | 5.034 | 0,08 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.03.2037 | $ | 186 | 162 | 0,00 |
| 1,844 % fällig am 25.04.2037 | | 529 | 377 | 0,01 |
| 1,844 % fällig am 25.05.2037 | | 384 | 248 | 0,00 |
| 2,404 % fällig am 25.11.2034 | | 169 | 156 | 0,00 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.10.2031 | € | 4.200 | 4.114 | 0,07 |
| 0,730 % fällig am 15.07.2031 | | 3.309 | 3.244 | 0,05 |
| 0,780 % fällig am 15.04.2031 | | 1.846 | 1.823 | 0,03 |
| **Palmerston Park CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 18.04.2030 | | 1.025 | 1.010 | 0,02 |
| **PBD Germany Auto Lease Master S.A., Compartment** | | | | |
| 0,188 % fällig am 26.11.2030 | € | 12.000 | € 12.008 | 0,20 |
| **Pepper Iberia Unsecured DAC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 07.04.2028 | | 18 | 18 | 0,00 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 5,285 % fällig am 25.01.2037 | $ | 228 | 84 | 0,00 |
| 5,545 % fällig am 25.01.2037 | | 335 | 130 | 0,00 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 1,964 % fällig am 25.05.2037 | | 1.539 | 1.456 | 0,02 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | | |
| 1,914 % fällig am 25.09.2036 | | 7.500 | 6.876 | 0,11 |
| **Segovia European CLO DAC** | | | | |
| 0,880 % fällig am 20.07.2032 | € | 4.100 | 3.985 | 0,07 |
| **Silver Arrow Merfina SRL** | | | | |
| 0,206 % fällig am 20.07.2033 | | 26.053 | 26.081 | 0,43 |
| **Silver Arrow S.A.** | | | | |
| 0,164 % fällig am 15.09.2027 | | 522 | 524 | 0,01 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.03.2037 | $ | 68 | 62 | 0,00 |
| 1,794 % fällig am 25.07.2037 | | 820 | 696 | 0,01 |
| 1,794 % fällig am 25.08.2037 | | 922 | 781 | 0,01 |
| 2,124 % fällig am 25.10.2036 | | 181 | 167 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.10.2037 | | 2.095 | 1.577 | 0,03 |
| **Tikehau CLO BV** | | | | |
| 0,870 % fällig am 04.08.2034 | € | 2.300 | 2.242 | 0,04 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | |
| 0,810 % fällig am 15.02.2034 | | 5.300 | 5.122 | 0,08 |
| 0,920 % fällig am 12.01.2032 | | 1.700 | 1.651 | 0,03 |
| | | | 329.616 | 5,42 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Cyprus Government International Bond** | | | | |
| 3,750 % fällig am 26.07.2023 | | 1.400 | 1.438 | 0,03 |
| **Iceland Government International Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 20.12.2022 | | 2.500 | 2.500 | 0,04 |
| **Israel Government International Bond** | | | | |
| 0,750 % fällig am 31.07.2022 | ILS | 30.200 | 8.248 | 0,14 |
| 1,250 % fällig am 30.11.2022 | | 9.300 | 2.542 | 0,04 |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | | |
| 1,750 % fällig am 04.07.2022 | € | 47.000 | 47.000 | 0,77 |
| **Stockholms Lans Landsting** | | | | |
| 0,750 % fällig am 26.02.2025 | | 7.000 | 6.840 | 0,11 |
| 2,125 % fällig am 12.09.2022 | | 2.000 | 2.009 | 0,03 |
| | | | 70.577 | 1,16 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | | |
| **Activision Blizzard, Inc.** | | 312.700 | 23.288 | 0,38 |
| **Meta Platforms, Inc. 'A' (a)** | | 128.700 | 19.851 | 0,32 |
| **Nexon Co. Ltd.** | | 857.900 | 16.829 | 0,28 |
| **Nintendo Co. Ltd.** | | 26.600 | 10.928 | 0,18 |
| | | | 70.896 | 1,16 |
| **LUXUSGÜTER** | | | | |
| **Aptiv PLC (a)** | | 334.400 | 28.490 | 0,47 |
| **BYD Co. Ltd. 'H'** | | 1.512.554 | 58.319 | 0,96 |
| **JD Health International, Inc. (a)** | | 1.840.724 | 13.937 | 0,23 |
| **Luminar Technologies, Inc. (a)** | | 2.894.700 | 16.419 | 0,27 |
| **Panasonic Holdings Corp.** | | 5.165.340 | 39.841 | 0,65 |
| **QuantumScape Corp. (a)** | | 196.400 | 1.614 | 0,03 |
| **Sekisui House Ltd.** | | 382.600 | 6.416 | 0,10 |
| **Shimano, Inc.** | | 75.100 | 12.086 | 0,20 |
| **Xpeng, Inc. (a)** | | 993.300 | 30.157 | 0,50 |
| | | | 207.279 | 3,41 |
| **FINANZWERTE** | | | | |
| **Galaxy Digital Holdings Ltd. (a)** | | 195.489 | 701 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| Galaxy Digital Holdings Ltd. (a)(g) | 116.515 | € 417 | 0,01 |
| | | 1.118 | 0,02 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| 3SBio, Inc. | 9.696.600 | 7.390 | 0,12 |
| AbbVie, Inc. | 129.400 | 18.957 | 0,31 |
| Alibaba Health Information Technology Ltd. (a) | 14.636.200 | 9.727 | 0,16 |
| Chugai Pharmaceutical Co. Ltd. | 347.000 | 8.480 | 0,14 |
| Cigna Corp. | 38.450 | 9.692 | 0,16 |
| CSPC Pharmaceutical Group Ltd. | 8.902.988 | 8.512 | 0,14 |
| Elevance Health, Inc. | 99.630 | 45.989 | 0,76 |
| Exact Sciences Corp. (a) | 152.800 | 5.757 | 0,10 |
| Exelixis, Inc. (a) | 1.306.200 | 26.013 | 0,43 |
| Halozyme Therapeutics, Inc. (a) | 610.500 | 25.694 | 0,42 |
| Hangzhou Tigermed Consulting Co. Ltd. 'H' | 819.400 | 9.090 | 0,15 |
| Hologic, Inc. (a) | 388.900 | 25.779 | 0,42 |
| Humana, Inc. | 123.970 | 55.504 | 0,91 |
| Incyte Corp. (a) | 317.000 | 23.036 | 0,38 |
| Legend Biotech Corp. (a) | 1.075 | 57 | 0,00 |
| Luye Pharma Group Ltd. (a) | 16.888.100 | 5.314 | 0,09 |
| Merck & Co., Inc. | 364.700 | 31.804 | 0,52 |
| Molina Healthcare, Inc. (a) | 40.500 | 10.832 | 0,18 |
| Neurocrine Biosciences, Inc. (a) | 132.000 | 12.308 | 0,20 |
| New Horizon Health Ltd. (a) | 2.914.060 | 8.412 | 0,14 |
| Regeneron Pharmaceuticals, Inc. (a) | 70.200 | 39.693 | 0,65 |
| Seagen, Inc. (a) | 101.200 | 17.128 | 0,28 |
| Shandong Weigao Group Medical Polymer Co. Ltd. 'H' | 7.175.800 | 8.016 | 0,13 |
| Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co. Ltd. 'H' | 2.130.000 | 7.579 | 0,13 |
| Shionogi & Co. Ltd. | 391.250 | 19.076 | 0,31 |
| United Therapeutics Corp. (a) | 110.100 | 24.816 | 0,41 |
| Vertex Pharmaceuticals, Inc. (a) | 272.600 | 73.476 | 1,21 |
| | | 538.131 | 8,85 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| ABB Ltd. | 684.700 | 17.515 | 0,29 |
| Aker Carbon Capture ASA (a) | 10.752.361 | 17.682 | 0,29 |
| Ballard Power Systems, Inc. (a) | 612.300 | 3.691 | 0,06 |
| Contemporary Amperex Technology Co. Ltd. 'A' (a) | 139.000 | 10.651 | 0,17 |
| Daifuku Co. Ltd. | 144.600 | 7.905 | 0,13 |
| Desktop Metal, Inc. 'A' (a) | 508.600 | 1.070 | 0,02 |
| FuelCell Energy, Inc. (a) | 2.171.400 | 7.789 | 0,13 |
| GXO Logistics, Inc. (a) | 287.100 | 11.883 | 0,20 |
| Hitachi Zosen Corp. | 3.981.300 | 23.974 | 0,39 |
| ITM Power PLC (a) | 3.699.900 | 7.445 | 0,12 |
| Kajima Corp. | 1.051.100 | 11.514 | 0,19 |
| Makita Corp. | 481.500 | 11.401 | 0,19 |
| Mitsubishi Electric Corp. | 2.319.770 | 23.821 | 0,39 |
| NEL ASA (a) | 8.158.100 | 9.523 | 0,16 |
| Plug Power, Inc. (a) | 1.079.900 | 17.116 | 0,28 |
| PowerCell Sweden AB (a) | 469.863 | 5.970 | 0,10 |
| Schneider Electric SE | 221.100 | € 25.140 | 0,41 |
| Secom Co. Ltd. | 160.260 | 9.453 | 0,16 |
| Sensata Technologies Holding PLC | 523.676 | 20.693 | 0,34 |
| Siemens Gamesa Renewable Energy S.A. | 485.200 | 8.730 | 0,14 |
| SMC Corp. | 22.400 | 9.525 | 0,16 |
| Taisei Corp. | 269.800 | 8.036 | 0,13 |
| Titan Wind Energy Suzhou Co. Ltd. 'A' (a) | 3.792.647 | 8.984 | 0,15 |
| Valmet Oyj | 1.297.700 | 30.516 | 0,50 |
| Vestas Wind Systems A/S | 1.153.400 | 23.405 | 0,38 |
| Xinjiang Goldwind Science & Technology Co. Ltd. 'H' | 18.962.000 | 34.030 | 0,56 |
| | | 367.462 | 6,04 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Advantest Corp. | 378.000 | 19.419 | 0,32 |
| Ambarella, Inc. (a) | 360.300 | 22.560 | 0,37 |
| ams-OSRAM AG (a) | 1.694.600 | 14.623 | 0,24 |
| ANSYS, Inc. (a) | 31.100 | 7.118 | 0,12 |
| Applied Materials, Inc. | 340.300 | 29.615 | 0,49 |
| Arista Networks, Inc. (a) | 353.100 | 31.661 | 0,52 |
| Automatic Data Processing, Inc. | 97.500 | 19.589 | 0,32 |
| BE Semiconductor Industries NV | 99.700 | 4.546 | 0,07 |
| Chipbond Technology Corp. | 6.930.908 | 13.268 | 0,22 |
| Cirrus Logic, Inc. (a) | 277.500 | 19.255 | 0,32 |
| Cognex Corp. | 137.023 | 5.573 | 0,09 |
| Daqo New Energy Corp. (a) | 560.300 | 38.256 | 0,63 |
| Delta Electronics, Inc. | 2.856.112 | 20.370 | 0,33 |
| Disco Corp. | 45.200 | 10.275 | 0,17 |
| Elan Microelectronics Corp. | 3.247.109 | 14.589 | 0,24 |
| Enphase Energy, Inc. (a) | 164.800 | 30.777 | 0,51 |
| First Solar, Inc. (a) | 630.600 | 41.095 | 0,68 |
| Flex Ltd. (a) | 985.300 | 13.637 | 0,22 |
| Fujitsu Ltd. | 96.000 | 11.475 | 0,19 |
| Globalwafers Co. Ltd. | 1.084.309 | 15.848 | 0,26 |
| GoerTek, Inc. 'A' | 4.918.805 | 23.633 | 0,39 |
| Hamamatsu Photonics KK | 448.500 | 16.691 | 0,27 |
| Ibiden Co. Ltd. | 243.900 | 6.601 | 0,11 |
| Infineon Technologies AG | 606.200 | 14.071 | 0,23 |
| Intel Corp. | 733.100 | 26.233 | 0,43 |
| IPG Photonics Corp. (a) | 92.900 | 8.365 | 0,14 |
| JinkoSolar Holding Co. Ltd. (a) | 1.087.412 | 71.957 | 1,18 |
| Lam Research Corp. | 82.570 | 33.657 | 0,55 |
| LONGi Green Energy Technology Co. Ltd. 'A' | 4.293.597 | 41.076 | 0,68 |
| Lotes Co. Ltd. | 861.336 | 18.537 | 0,30 |
| Marathon Digital Holdings, Inc. (a) | 325.800 | 1.664 | 0,03 |
| Marvell Technology, Inc. | 445.300 | 18.541 | 0,30 |
| MediaTek, Inc. | 587.008 | 12.325 | 0,20 |
| Micron Technology, Inc. (a) | 288.300 | 15.244 | 0,25 |
| Nanya Technology Corp. | 8.240.907 | 13.119 | 0,22 |
| NetApp, Inc. | 618.700 | 38.609 | 0,63 |
| Novatek Microelectronics Corp. | 1.650.204 | 16.060 | 0,26 |
| NXP Semiconductors NV | 138.700 | 19.639 | 0,32 |
| Otsuka Corp. | 272.400 | 7.744 | 0,13 |
| Power Integrations, Inc. | 191.800 | 13.761 | 0,23 |
| Realtek Semiconductor Corp. | 1.287.407 | 15.061 | 0,25 |
| Riot Blockchain, Inc. (a) | 534.900 | 2.144 | 0,04 |
| Rohm Co. Ltd. | 289.100 | 19.360 | 0,32 |
| Samsung Electronics Co. Ltd. | 1.078.000 | € 45.481 | 0,75 |
| Samsung SDI Co. Ltd. | 20.671 | 8.154 | 0,13 |
| Skyworks Solutions, Inc. | 123.900 | 10.979 | 0,18 |
| SMA Solar Technology AG | 284.023 | 11.048 | 0,18 |
| SolarEdge Technologies, Inc. (a) | 200.400 | 52.461 | 0,86 |
| Synopsys, Inc. (a) | 47.200 | 13.711 | 0,23 |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. | 4.080.809 | 62.557 | 1,03 |
| Teradyne, Inc. | 296.700 | 25.414 | 0,42 |
| Tokyo Electron Ltd. | 95.170 | 29.674 | 0,49 |
| Trend Micro, Inc. | 151.000 | 7.057 | 0,12 |
| Trimble, Inc. (a) | 191.400 | 10.661 | 0,18 |
| Unimicron Technology Corp. (a) | 3.090.100 | 15.819 | 0,26 |
| United Microelectronics Corp. | 23.056.819 | 29.480 | 0,48 |
| Velodyne Lidar, Inc. (a) | 2.219.100 | 2.028 | 0,03 |
| Xinyi Solar Holdings Ltd. | 6.722.500 | 9.964 | 0,16 |
| Zebra Technologies Corp. 'A' (a) | 74.600 | 20.975 | 0,35 |
| | | 1.193.104 | 19,62 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Canfor Corp. (a) | 1.156.000 | 19.244 | 0,32 |
| Holmen AB 'B' | 594.500 | 23.123 | 0,38 |
| LG Chem Ltd. | 61.200 | 23.257 | 0,38 |
| Mondi PLC | 825.949 | 13.991 | 0,23 |
| Nitto Denko Corp. | 390.700 | 24.140 | 0,40 |
| Shin-Etsu Chemical Co. Ltd. | 258.060 | 27.712 | 0,46 |
| Stora Enso Oyj 'R' | 2.968.700 | 44.887 | 0,74 |
| thyssenkrupp AG | 1.278.600 | 6.957 | 0,11 |
| UPM-Kymmene Oyj | 1.937.000 | 56.677 | 0,93 |
| West Fraser Timber Co. Ltd. | 320.900 | 23.503 | 0,39 |
| Worthington Industries, Inc. | 180.300 | 7.606 | 0,12 |
| | | 271.097 | 4,46 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Xinyi Energy Holdings Ltd. | 30.670.700 | 15.050 | 0,25 |
| | | 2.664.137 | 43,81 |
| **REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS** | | | |
| Weyerhaeuser Co. | 532.600 | 16.873 | 0,28 |

| | | PARI (000S) | |
|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | |
| Acciona Energia Financiacion Filiales S.A. | | | |
| (0,030) % fällig am 13.07.2022 | € 10.100 | 10.100 | 0,17 |
| 0,010 % fällig am 27.07.2022 | 18.000 | 18.001 | 0,30 |
| Fidelity National Information Services, Inc. | | | |
| (0,253) % fällig am 25.07.2022 | 19.000 | 19.005 | 0,31 |
| Fiserv, Inc. | | | |
| (0,182) % fällig am 11.08.2022 | 33.800 | 33.800 | 0,55 |
| (0,152) % fällig am 18.08.2022 | 9.800 | 9.799 | 0,16 |
| HeidelbergCement AG | | | |
| (0,162) % fällig am 11.07.2022 | 19.000 | 19.003 | 0,31 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **SGS Nederland Holding BV** | | | | |
| (0,162) % fällig am 06.07.2022 | € | 19.000 | € 19.001 | 0,31 |
| (0,142) % fällig am 13.07.2022 | | 29.800 | 29.803 | 0,49 |
| (0,101) % fällig am 25.07.2022 | | 17.000 | 17.003 | 0,28 |
| | | | 175.515 | 2,88 |
| **TREASURY BILLS DES EUROPÄISCHEN STABILITÄTSMECHANISMUS** | | | | |
| (0,612) % fällig am 07.07.2022 (b)(c) | | 42.000 | 42.002 | 0,69 |
| (0,593) % fällig am 22.09.2022 (b)(c) | | 3.000 | 3.002 | 0,05 |
| (0,533) % fällig am 04.08.2022 (b)(c) | | 60.000 | 60.031 | 0,99 |
| (0,365) % fällig am 08.09.2022 (b)(c) | | 4.300 | 4.302 | 0,07 |
| | | | 109.337 | 1,80 |
| **EUROPEAN UNION TREASURY BILLS** | | | | |
| (5,093) % fällig am 08.07.2022 (b)(c) | | 55.640 | 55.643 | 0,92 |
| (1,798) % fällig am 05.08.2022 (b)(c) | | 171.660 | 171.737 | 2,82 |
| (0,542) % fällig am 09.09.2022 (b)(c) | | 130.220 | 130.301 | 2,14 |
| (0,289) % fällig am 07.10.2022 (b)(c) | | 2.200 | 2.201 | 0,04 |
| (0,266) % fällig am 05.08.2022 (b)(c) | | 27.000 | 27.012 | 0,44 |
| | | | 386.894 | 6,36 |
| **FRANCE TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,765) % fällig am 27.07.2022 (b)(c) | | 1.120 | 1.120 | 0,02 |
| (0,727) % fällig am 13.07.2022 (b)(c) | | 8.970 | 8.972 | 0,15 |
| (0,659) % fällig am 27.07.2022 (b)(c) | | 21.200 | 21.211 | 0,35 |
| (0,646) % fällig am 24.08.2022 (b)(c) | | 1.110 | 1.111 | 0,02 |
| (0,634) % fällig am 03.08.2022 (b)(c) | | 7.600 | 7.604 | 0,12 |
| (0,618) % fällig am 03.08.2022 (b)(c) | | 9.400 | 9.405 | 0,15 |
| (0,557) % fällig am 24.08.2022 (b)(c) | | 22.000 | 22.017 | 0,36 |
| (0,552) % fällig am 24.08.2022 (b)(c) | | 22.000 | 22.017 | 0,36 |
| (0,546) % fällig am 21.09.2022 (b)(c) | | 43.200 | 43.249 | 0,71 |
| (0,543) % fällig am 21.09.2022 (b)(c) | | 19.200 | 19.222 | 0,32 |
| (0,529) % fällig am 07.09.2022 (b)(c) | | 23.600 | 23.622 | 0,39 |
| (0,526) % fällig am 07.09.2022 (b)(c) | | 3.600 | 3.603 | 0,06 |
| (0,516) % fällig am 07.09.2022 (b)(c) | € | 47.200 | €47.245 | 0,78 |
| (0,480) % fällig am 19.10.2022 (b)(c) | | 48.270 | 48.314 | 0,79 |
| (0,448) % fällig am 14.09.2022 (b)(c) | | 31.400 | 31.430 | 0,52 |
| (0,447) % fällig am 14.09.2022 (b)(c) | | 18.900 | 18.918 | 0,31 |
| (0,446) % fällig am 14.09.2022 (b)(c) | | 1.100 | 1.101 | 0,02 |
| (0,445) % fällig am 14.09.2022 (b)(c) | | 4.900 | 4.905 | 0,08 |
| (0,145) % fällig am 16.11.2022 (b)(c) | | 9.300 | 9.306 | 0,15 |
| (0,144) % fällig am 16.11.2022 (b)(c) | | 2.000 | 2.001 | 0,03 |
| | | | 346.373 | 5,69 |
| **GREECE TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,177) % fällig am 08.07.2022 (b)(c) | | 31.200 | 31.196 | 0,51 |
| **ISRAEL TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,066) % fällig am 02.11.2022 (b)(c) | ILS | 6.500 | 1.772 | 0,03 |
| (0,031) % fällig am 07.12.2022 (b)(c) | | 900 | 245 | 0,00 |
| (0,020) % fällig am 07.12.2022 (b)(c) | | 12.200 | 3.323 | 0,06 |
| (0,005) % fällig am 03.08.2022 (b)(c) | | 18.600 | 5.080 | 0,08 |
| 0,000 % fällig am 02.11.2022 (b)(c) | | 67.200 | 18.318 | 0,30 |
| 0,000 % fällig am 07.12.2022 (b)(c) | | 4.500 | 1.226 | 0,02 |
| 0,006 % fällig am 07.10.2022 (b)(c) | | 10.900 | 2.970 | 0,05 |
| 0,014 % fällig am 02.11.2022 (b)(c) | | 2.200 | 600 | 0,01 |
| 0,016 % fällig am 04.01.2023 (b)(c) | | 20.100 | 5.463 | 0,09 |
| 0,020 % fällig am 07.12.2022 (b)(c) | | 2.800 | 763 | 0,01 |
| 0,022 % fällig am 04.01.2023 (b)(c) | | 15.800 | 4.294 | 0,07 |
| 0,035 % fällig am 07.12.2022 (b)(c) | | 4.200 | 1.144 | 0,02 |
| 0,746 % fällig am 05.04.2023 (b)(c) | | 19.300 | 5.227 | 0,09 |
| 0,753 % fällig am 05.04.2023 (b)(c) | | 12.600 | 3.413 | 0,06 |
| 0,886 % fällig am 03.05.2023 (b)(c) | | 27.300 | 7.375 | 0,12 |
| | | | 61.213 | 1,01 |
| **ITALY TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,094) % fällig am 30.11.2022 (b)(c) | € | 37.300 | 37.292 | 0,62 |
| (0,085) % fällig am 30.11.2022 (b)(c) | | 50.000 | 49.988 | 0,82 |
| (0,079) % fällig am 30.11.2022 (b)(c) | | 50.000 | 49.988 | 0,82 |
| | | | 137.268 | 2,26 |
| **JAPAN TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,204) % fällig am 26.09.2022 (b)(c) | ¥ | 6.644.000 | € 46.795 | 0,77 |
| (0,170) % fällig am 26.09.2022 (b)(c) | | 7.046.000 | 49.626 | 0,82 |
| (0,138) % fällig am 08.08.2022 (b)(c) | | 4.000.000 | 28.168 | 0,46 |
| (0,123) % fällig am 01.08.2022 (b)(c) | | 9.030.000 | 63.586 | 1,05 |
| (0,121) % fällig am 22.08.2022 (b)(c) | | 13.700.000 | 96.480 | 1,59 |
| (0,114) % fällig am 25.07.2022 (b)(c) | | 8.910.000 | 62.740 | 1,03 |
| (0,113) % fällig am 25.07.2022 (b)(c) | | 4.340.000 | 30.560 | 0,50 |
| (0,109) % fällig am 29.08.2022 (b)(c) | | 13.700.000 | 96.483 | 1,59 |
| (0,098) % fällig am 11.07.2022 (b)(c) | | 6.000.000 | 42.246 | 0,69 |
| (0,082) % fällig am 04.07.2022 (b)(c) | | 6.580.000 | 46.329 | 0,76 |
| | | | 563.013 | 9,26 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 1.810.809 | 29,77 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **€ 5.196.196** | **85,44** |
| | | **AKTIEN** | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Income Fund (e)** | | 2.387.633 | 36.930 | 0,60 |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Capital Securities Fund (e)** | | 5.118.369 | 52.777 | 0,87 |
| | | | 89.707 | 1,47 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (e)** | | 3.415.400 | 331.779 | 5,46 |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF (e)** | | 1.532.400 | 14.698 | 0,24 |
| | | | 346.477 | 5,70 |
| **Summe Investmentfonds** | | | **€436.184** | **7,17** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | (1,300) % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | € | 26.600 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.12.2027 - 09.11.2028 | € (27.281) | € 26.600 | € 26.599 | 0,43 |
| FICC | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ | 24.628 | U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | (24.029) | 23.557 | 23.557 | 0,39 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | | **€ (51.310)** | **€ 50.157** | **€ 50.156** | **0,82** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

### FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 7.975 | € 820 | 0,01 |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 2.299 | (7.065) | (0,11) |
| E-mini NASDAQ 100 Index September Futures | Short | 09.2022 | 1.685 | 2.231 | 0,04 |
| E-mini S&P 500 Index September Futures | Short | 09.2022 | 3.176 | 15.707 | 0,26 |
| Euro STOXX 50 September Futures | Short | 09.2022 | 26.008 | 22.266 | 0,37 |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 235 | (306) | (0,01) |
| FTSE 100 Index September Futures | Short | 09.2022 | 3.770 | (1.674) | (0,03) |
| Nikkei 225 Yen-Denominated September Futures | Short | 09.2022 | 2.872 | 6.218 | 0,10 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 16.993 | (10.869) | (0,18) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 3.008 | (2.499) | (0,04) |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Long | 09.2022 | 2.831 | (14.376) | (0,24) |
| | | | | € 10.453 | 0,17 |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### OPTIONEN AUF INDIZES

| Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOE S&P 500 Index | € 3.500,000 | 15.07.2022 | 171 | € (1.072) | € (206) | 0,00 |
| Put - CBOE S&P 500 Index | 3.600,000 | 15.07.2022 | 333 | (2.000) | (808) | (0,01) |
| | | | | € (3.072) | € (1.014) | (0,01) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **€ 9.439** | **0,16** |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20.06.2026 | $ 500 | € (10) | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20.06.2027 | 1.300 | (12) | 0,00 |
| | | | | € (22) | 0,00 |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-35 5-Year Index | 5,000 % | 20.12.2025 | $ 297 | € (23) | 0,00 |
| CDX.HY-36 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2026 | 29.106 | (2.486) | (0,04) |
| CDX.HY-37 5-Year Index | 5,000 | 20.12.2026 | 5.074 | (410) | (0,01) |
| CDX.HY-38 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2027 | 180.576 | (10.191) | (0,17) |
| CDX.IG-35 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2025 | 4.400 | (49) | 0,00 |
| CDX.IG-36 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2026 | 15.000 | (244) | 0,00 |
| CDX.IG-37 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 12.500 | (217) | 0,00 |
| CDX.IG-38 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 306.200 | (3.376) | (0,06) |
| iTraxx Crossover 37 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2027 | € 16.100 | (700) | (0,01) |
| iTraxx Europe Main 36 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 11.900 | (78) | 0,00 |
| | | | | € (17.774) | (0,29) |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,200 % | 19.06.2029 | ¥ 22.320.000 | € (4.493) | (0,07) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,000 | 16.06.2026 | CAD 585.429 | (25.494) | (0,42) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,220 | 03.03.2025 | 5.692 | (246) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,235 | 04.03.2025 | 10.835 | (476) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,250 | 16.06.2031 | 82.272 | (7.499) | (0,12) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,275 | 03.03.2025 | 5.150 | (217) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,276 | 03.03.2025 | 3.072 | (129) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,290 | 03.03.2025 | 1.536 | (64) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,500 | 17.06.2025 | 102.600 | (4.903) | (0,08) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,500 | 17.06.2030 | 150.600 | (19.198) | (0,32) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,900 | 18.12.2029 | 181 | (22) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,250 | 15.06.2027 | 477.100 | (2.647) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,500 | 19.06.2029 | 123.500 | (13.144) | (0,22) |
| | | | | | € (78.532) | (1,29) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **€ (96.328)** | **(1,58)** |

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

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

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

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

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 % | 20.07.2022 | 11.600 | € (16) | € (8) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Crossover 36 5-Year Index | Verkauf | 5,250 | 20.07.2022 | 3.100 | (28) | (59) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 16.000 | (68) | (33) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 29.200 | (80) | (91) | (0,01) |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 11.300 | (19) | (4) | 0,00 |
| BRC | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 2.400 | (21) | (26) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 18.400 | (76) | (38) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,600 | 17.08.2022 | 6.200 | (14) | (11) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 7.100 | (10) | (5) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 13.200 | (24) | (14) | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,300 | 17.08.2022 | 15.100 | (32) | (23) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 95,000 | 17.08.2022 | 3.400 | (39) | (50) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 5.400 | (46) | (58) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,100 | 20.07.2022 | 17.600 | (60) | (64) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 7.100 | (20) | (25) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,350 | 17.08.2022 | 15.200 | (33) | (20) | 0,00 |
| | | | | | | € (586) | € (529) | (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 | Nenn-betrag[2] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | China Government International Bond | (1,000) % | 20.12.2023 | $ 17.130 | € (304) | € 108 | € (196) | (0,01) |
| BRC | China Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 16.800 | (309) | 117 | (192) | 0,00 |
| | | | | | € (613) | € 225 | € (388) | (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 | Nenn-betrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | Zahlung | SX4T Index | 21.919 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | € 60.878 | 14.12.2022 | € 0 | € 0 | € 0 | 0,00 |
| JPM | Zahlung | JPPMGSHP Index | 750.458 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | $ 66.963 | 07.06.2023 | 0 | 5.800 | 5.800 | 0,10 |
| | | | | | | | € 0 | € 5.800 | € 5.800 | 0,10 |

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | € 29.582 | SEK 316.345 | € 0 | € (54) | € (54) | 0,00 |
| | 07.2022 | 243 | $ 260 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ 5.033 | € 5.883 | 37 | 0 | 37 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ 710.200 | 5.000 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | PEN 73.668 | $ 18.228 | 0 | (1.057) | (1.057) | (0,02) |
| | 07.2022 | $ 4.248 | PEN 15.859 | 0 | (76) | (76) | 0,00 |
| | 08.2022 | MXN 859.239 | $ 42.327 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 08.2022 | SEK 316.637 | € 29.582 | 53 | 0 | 53 | 0,00 |
| | 08.2022 | SGD 30 | 21 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 55.744 | PEN 213.287 | 182 | 0 | 182 | 0,00 |
| | 01.2023 | PEN 15.859 | $ 4.175 | 69 | 0 | 69 | 0,00 |
| | 02.2023 | 200.000 | 51.372 | 0 | (214) | (214) | 0,00 |
| | 05.2023 | 13.287 | 3.387 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 07.2022 | AUD | 41.385 | € | 27.636 | € 416 | € 0 | € 416 | 0,01 |
| | 07.2022 | CAD | 30.439 | | 22.554 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 07.2022 | CHF | 54.985 | | 53.551 | 0 | (1.386) | (1.386) | (0,02) |
| | 07.2022 | € | 12.231 | AUD | 18.665 | 46 | 0 | 46 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 49.387 | CAD | 67.185 | 435 | (3) | 432 | 0,01 |
| | 07.2022 | | 4.708 | DKK | 35.025 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 10.890 | £ | 9.346 | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 60.811 | ¥ | 8.604.700 | 0 | (228) | (228) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 48.085 | NOK | 483.688 | 0 | (1.259) | (1.259) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 2.293.676 | $ | 2.413.925 | 15.306 | 0 | 15.306 | 0,25 |
| | 07.2022 | £ | 6.941 | € | 8.134 | 71 | 0 | 71 | 0,00 |
| | 07.2022 | NZD | 123.933 | | 73.884 | 183 | 0 | 183 | 0,00 |
| | 07.2022 | PLN | 654 | $ | 146 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | SEK | 81.710 | € | 7.760 | 133 | 0 | 133 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 210.509 | | 198.808 | 0 | (2.550) | (2.550) | (0,04) |
| | 08.2022 | AUD | 2.700 | | 1.769 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 86.769 | COP | 336.673.797 | 0 | (6.238) | (6.238) | (0,10) |
| | 08.2022 | | 2.223.535 | € | 2.110.182 | 0 | (12.765) | (12.765) | (0,21) |
| | 09.2022 | TWD | 4.711.665 | $ | 169.600 | 9.747 | 0 | 9.747 | 0,16 |
| BRC | 07.2022 | € | 4.595 | CAD | 6.270 | 54 | 0 | 54 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 3.210 | DKK | 23.889 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.928 | £ | 1.659 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 34.218 | ¥ | 4.833.300 | 0 | (188) | (188) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 9.158 | $ | 9.629 | 52 | 0 | 52 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 29.157.471 | € | 214.262 | 8.987 | 0 | 8.987 | 0,15 |
| | 07.2022 | $ | 32.178 | | 30.381 | 0 | (398) | (398) | (0,01) |
| | 08.2022 | DKK | 23.888 | | 3.210 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 22.730.000 | | 165.940 | 5.939 | 0 | 5.939 | 0,10 |
| | 11.2022 | ILS | 2.200 | $ | 689 | 52 | 0 | 52 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | AUD | 15.632 | € | 10.380 | 98 | 0 | 98 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 7.924 | AUD | 11.930 | 0 | (77) | (77) | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 70.266 | € | 82.474 | 854 | 0 | 854 | 0,01 |
| | 07.2022 | PEN | 94.064 | $ | 23.273 | 0 | (1.354) | (1.354) | (0,02) |
| | 07.2022 | $ | 168.110 | BRL | 828.960 | 0 | (9.231) | (9.231) | (0,15) |
| | 08.2022 | ILS | 49.242 | $ | 15.199 | 1.067 | 0 | 1.067 | 0,02 |
| | 08.2022 | PEN | 213.287 | | 52.752 | 0 | (3.038) | (3.038) | (0,05) |
| | 08.2022 | $ | 19.682 | PEN | 75.047 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 47.915 | CLP | 40.000.000 | 0 | (5.520) | (5.520) | (0,09) |
| | 10.2022 | ILS | 10.899 | $ | 3.228 | 90 | 0 | 90 | 0,00 |
| | 10.2022 | PEN | 25.309 | | 6.403 | 0 | (176) | (176) | 0,00 |
| | 11.2022 | ILS | 15.927 | | 5.076 | 457 | 0 | 457 | 0,01 |
| | 11.2022 | PEN | 50.000 | | 12.599 | 0 | (377) | (377) | (0,01) |
| | 11.2022 | $ | 157.320 | PEN | 624.530 | 4.744 | 0 | 4.744 | 0,08 |
| | 12.2022 | ILS | 21.600 | $ | 6.908 | 634 | 0 | 634 | 0,01 |
| | 01.2023 | | 35.894 | | 11.366 | 924 | 0 | 924 | 0,02 |
| | 04.2023 | | 19.176 | | 5.827 | 229 | 0 | 229 | 0,00 |
| | 05.2023 | | 27.071 | | 8.204 | 290 | 0 | 290 | 0,01 |
| DUB | 07.2022 | DKK | 415.681 | € | 55.866 | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 3.916 | CAD | 5.353 | 53 | 0 | 53 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 149.712 | PLN | 653.162 | 0 | (4.455) | (4.455) | (0,07) |
| | 08.2022 | TWD | 246.149 | $ | 8.288 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 12.2022 | ILS | 1.200 | | 379 | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | BRL | 828.960 | | 159.461 | 958 | 0 | 958 | 0,02 |
| | 08.2022 | $ | 158.206 | BRL | 828.960 | 0 | (1.064) | (1.064) | (0,02) |
| | 08.2022 | | 401 | TRY | 7.050 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 09.2022 | HKD | 1.122.702 | $ | 143.368 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 11.2022 | ILS | 67.200 | | 21.702 | 2.224 | 0 | 2.224 | 0,04 |
| IND | 08.2022 | $ | 32 | CLP | 27.994 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 3.371 | € | 2.847 | 0 | (371) | (371) | (0,01) |
| JPM | 07.2022 | AUD | 7.431 | | 4.932 | 44 | 0 | 44 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 8.805 | AUD | 13.275 | 20 | (93) | (73) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 25.017 | DKK | 186.143 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.128 | £ | 968 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 21.098 | € | 24.769 | 261 | 0 | 261 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 6.635.500 | | 47.550 | 883 | (52) | 831 | 0,01 |
| | 07.2022 | NOK | 1.403.458 | | 135.732 | 0 | (140) | (140) | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 186.139 | | 25.017 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 135.732 | NOK | 1.405.412 | 149 | 0 | 149 | 0,00 |
| | 08.2022 | KRW | 46.973.776 | $ | 36.901 | 656 | 0 | 656 | 0,01 |
| | 08.2022 | SGD | 5 | | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 2.868.409 | | 97.353 | 675 | 0 | 675 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 25 | CNH | 169 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 2.854 | € | 2.374 | € 0 | € (351) | € (351) | (0,01) |
| | 09.2022 | TWD | 5.579.213 | $ | 200.727 | 11.445 | 0 | 11.445 | 0,19 |
| | 12.2022 | ILS | 1.800 | | 584 | 60 | 0 | 60 | 0,00 |
| | 04.2023 | | 12.518 | | 3.760 | 109 | 0 | 109 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | € | 194.842 | £ | 168.595 | 997 | 0 | 997 | 0,02 |
| | 07.2022 | | 2.039 | ¥ | 293.300 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 16.438 | NOK | 165.555 | 0 | (411) | (411) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 150.630 | NZD | 248.950 | 0 | (2.584) | (2.584) | (0,04) |
| | 07.2022 | $ | 102.706 | € | 95.239 | 0 | (3.001) | (3.001) | (0,05) |
| | 07.2022 | | 38.270 | HUF | 13.177.392 | 0 | (3.485) | (3.485) | (0,06) |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08.2022 | £ | 168.826 | € | 194.842 | 0 | (999) | (999) | (0,02) |
| | 08.2022 | ¥ | 13.700.000 | | 100.449 | 4.018 | 0 | 4.018 | 0,07 |
| | 08.2022 | $ | 40.440 | CLP | 33.887.024 | 0 | (4.325) | (4.325) | (0,07) |
| | 08.2022 | | 73 | CNH | 489 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 19.000 | PEN | 72.447 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | € | 9.720 | CAD | 13.123 | 14 | (3) | 11 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 17.955 | DKK | 133.568 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 3.020 | ¥ | 425.300 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 211.152 | $ | 222.991 | 2.145 | 0 | 2.145 | 0,04 |
| | 07.2022 | £ | 15.191 | € | 17.673 | 29 | (2) | 27 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 243 | | 232 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | KRW | 60.722.890 | $ | 47.673 | 820 | 0 | 820 | 0,01 |
| | 08.2022 | TWD | 853.023 | | 28.957 | 206 | 0 | 206 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 2.277.395 | | 81.583 | 4.336 | 0 | 4.336 | 0,07 |
| RBC | 07.2022 | € | 11.631 | | 12.502 | 328 | 0 | 328 | 0,01 |
| | 07.2022 | SEK | 304.931 | € | 29.072 | 610 | 0 | 610 | 0,01 |
| | 09.2022 | MXN | 1.708.968 | $ | 83.056 | 0 | (597) | (597) | (0,01) |
| RYL | 09.2022 | ¥ | 13.690.000 | € | 96.414 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| | 12.2022 | $ | 2.758 | | 2.419 | 0 | (187) | (187) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | CAD | 42.627 | | 31.182 | 0 | (427) | (427) | (0,01) |
| | 07.2022 | € | 5.149 | AUD | 7.752 | 0 | (50) | (50) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 65 | $ | 70 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | ILS | 381.677 | | 113.214 | 3.999 | 0 | 3.999 | 0,07 |
| | 07.2022 | ¥ | 35.476.290 | € | 257.354 | 7.576 | 0 | 7.576 | 0,12 |
| | 08.2022 | $ | 130 | CNH | 868 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 11 | TWD | 338 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 81.524 | CLP | 68.500.000 | 0 | (8.948) | (8.948) | (0,15) |
| | 09.2022 | | 196 | COP | 789.077 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 11.2022 | | 1.269 | | 5.391.829 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 12.2022 | PEN | 16.000 | $ | 3.821 | 0 | (311) | (311) | (0,01) |
| SOG | 07.2022 | € | 52.135 | CHF | 52.093 | 0 | (87) | (87) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 178.328 | ¥ | 25.588.041 | 1.830 | 0 | 1.830 | 0,03 |
| | 07.2022 | SEK | 2.195 | € | 209 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2.366.062 | | 2.201.381 | 0 | (61.820) | (61.820) | (1,02) |
| | 08.2022 | CHF | 52.101 | | 52.135 | 85 | 0 | 85 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 25.593.166 | | 178.328 | 0 | (1.835) | (1.835) | (0,03) |
| | 09.2022 | HKD | 14.545 | $ | 1.857 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | CAD | 22.021 | € | 16.260 | 0 | (69) | (69) | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 4.977 | DKK | 37.026 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 82.484 | NOK | 833.152 | 0 | (1.825) | (1.825) | (0,03) |
| | 07.2022 | £ | 113.364 | € | 132.735 | 1.063 | (10) | 1.053 | 0,02 |
| | 07.2022 | ILS | 170.192 | $ | 49.314 | 666 | 0 | 666 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 108.936 | HUF | 38.202.497 | 0 | (8.181) | (8.181) | (0,13) |
| | 08.2022 | DKK | 37.024 | € | 4.977 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 4.000.000 | | 29.050 | 893 | 0 | 893 | 0,01 |
| | 09.2022 | HKD | 392.678 | $ | 50.141 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 09.2022 | MXN | 79.048 | | 3.967 | 92 | 0 | 92 | 0,00 |
| | | | | | | € 98.569 | € (152.065) | € (53.496) | (0,88) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen BM Retail AUD (Hedged) ausschüttend II und M Retail AUD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | € | 52 | AUD | 77 | € 0 | € (1) | € (1) | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | | 52 | | 77 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | | 78 | | 117 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | | 83 | | 124 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | € 0 | € (4) | € (4) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 07.2022 | € | 1.584 | CHF | 1.627 | € 41 | € 0 | € 41 | 0,00 |
| RBC | 07.2022 | CHF | 54 | € | 51 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | € | 1.584 | CHF | 1.629 | 43 | 0 | 43 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | CHF | 1.521 | € | 1.523 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 1.583 | CHF | 1.628 | 44 | 0 | 44 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.523 | | 1.522 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | | | | | | € 131 | € (5) | € 126 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | € 1.642 | £ 1.412 | € 2 | € (4) | € (2) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | 866 | 743 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | 209.919 | 178.846 | 0 | (2.173) | (2.173) | (0,04) |
| JPM | 07.2022 | 210.700 | 179.297 | 0 | (2.431) | (2.431) | (0,04) |
| MBC | 07.2022 | 1.223 | 1.049 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07.2022 | £ 142.526 | € 164.704 | 0 | (853) | (853) | (0,01) |
| | 08.2022 | € 160.653 | £ 139.202 | 823 | 0 | 823 | 0,01 |
| MYI | 07.2022 | 1.287 | 1.109 | 4 | (3) | 1 | 0,00 |
| RBC | 07.2022 | 550 | 471 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | 25.832 | 22.151 | 0 | (101) | (101) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 213 | 183 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ 88 | € 103 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | € 160.408 | £ 136.799 | 0 | (1.504) | (1.504) | (0,02) |
| UAG | 07.2022 | 117.117 | 99.942 | 0 | (1.025) | (1.025) | (0,02) |
| | | | | € 830 | € (8.105) | € (7.275) | (0,12) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend und M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | 07.2022 | € 10.087 | SGD 14.857 | € 124 | € 0 | € 124 | 0,01 |
| MBC | 07.2022 | 10.088 | 14.857 | 123 | 0 | 123 | 0,00 |
| RBC | 07.2022 | 237 | 350 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | 10.088 | 14.857 | 123 | 0 | 123 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | SGD 90 | € 61 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | € 373 | € (1) | € 372 | 0,01 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional USD (Hedged) thesaurierend, Institutional USD (Hedged) ausschüttend II, Investor USD (Hedged) thesaurierend, BM Retail USD (Hedged) ausschüttend II, E Class USD (Hedged) thesaurierend, E Class USD (Hedged) ausschüttend, E Class USD (Hedged) ausschüttend II, H Institutional USD (Hedged) thesaurierend, M Retail USD (Hedged) ausschüttend II and T Class USD (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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | $ 1.117 | € 1.051 | € 0 | € (17) | € (17) | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | 259 | 240 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | 1.925 | 1.822 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| IND | 07.2022 | 2.094 | 1.948 | 0 | (55) | (55) | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | € 9.319 | $ 10.010 | 255 | 0 | 255 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | 164.250 | 177.126 | 5.176 | 0 | 5.176 | 0,08 |
| | 07.2022 | $ 190.378 | € 180.967 | 0 | (1.134) | (1.134) | (0,02) |
| | 08.2022 | € 180.967 | $ 190.724 | 1.128 | 0 | 1.128 | 0,02 |
| MYI | 07.2022 | 10.845 | 11.628 | 277 | 0 | 277 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 499 | € 474 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| RBC | 07.2022 | € 1.254 | $ 1.328 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 1.028 | € 980 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | € 16.351 | $ 17.515 | 403 | 0 | 403 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ 424 | € 407 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | € 163.408 | $ 175.632 | 4.589 | 0 | 4.589 | 0,08 |
| UAG | 07.2022 | 164.426 | 176.693 | 4.585 | 0 | 4.585 | 0,08 |
| | 07.2022 | $ 443 | € 418 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | | | | € 16.431 | € (1.245) | € 15.186 | 0,25 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **€ (40.208)** | **(0,66)** |
| **Summe Anlagen** | **€ 5.555.440** | **91,35** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **€ 526.288** | **8,65** |
| **Nettovermögen** | **€ 6.081.728** | **100,00** |

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

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

**^** **Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a)** **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

**(b)** **Nullkuponwertpapier.**

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

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

**(e)** **Mit dem Fonds verbunden.**

**(f)** **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(g) Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|
| Galaxy Digital Holdings Ltd. | 15.11.2021 | € 3.298 | € 417 | 0,01 |

**Barmittel in Höhe von EUR 25.202 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für Leerverkäufe und Optionen gemäß Prime Brokerage-Vereinbarungen und Vereinbarungen, die börsennotierte Aktienoptionsgeschäfte regeln, verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von EUR 279.928 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von EUR 79.800 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | € 1.342.119 | € 3.854.077 | € 0 | € 5.196.196 |
| Investmentfonds | 421.486 | 14.698 | 0 | 436.184 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 50.157 | 0 | 50.157 |
| Finanzderivate[3] | 23.820 | (150.917) | 0 | (127.097) |
| **Summen** | **€ 1.787.425** | **€ 3.768.015** | **€ 0** | **€ 5.555.440** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 1.782.223 | € 5.070.325 | € 0 | € 6.852.548 |
| Investmentfonds | 433.439 | 16.631 | 0 | 450.070 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 202.276 | 0 | 202.276 |
| Finanzderivate[3] | (14.811) | 15.834 | 0 | 1.023 |
| **Summen** | **€ 2.200.851** | **€ 5.305.066** | **€ 0** | **€ 7.505.917** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | € (17) | € 0 | € (17) |
| BOA | (1.253) | 1.590 | 337 |
| BPS | 1.695 | (1.700) | (5) |
| BRC | 14.207 | (17.420) | (3.213) |
| CBK | (12.576) | 12.820 | 244 |
| DUB | (4.420) | 3.160 | (1.260) |
| GLM | 2.266 | (1.830) | 436 |
| GST | (23) | 240 | 217 |
| IND | (428) | 370 | (58) |
| JPM | 17.088 | (15.720) | 1.368 |
| MBC | (4.517) | 3.010 | (1.507) |
| MYC | (20) | (70) | (90) |
| MYI | 7.800 | (6.905) | 895 |
| RBC | 352 | 0 | 352 |
| RYL | (130) | (640) | (770) |
| SCX | 2.278 | (4.620) | (2.342) |
| SOG | (58.695) | 54.150 | (4.545) |
| UAG | (3.815) | 4.250 | 435 |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 68,70 | 78,86 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 13,48 | 10,60 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 3,26 | 0,29 |
| Investmentfonds | 7,17 | 5,89 |
| Pensionsgeschäfte | 0,82 | 2,65 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,16 | (0,20) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (1,58) | (0,16) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (0,66) | 0,37 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 3,48 | 4,09 |
| Wandelanleihen & Wechsel | 0,15 | 0,21 |
| Non-Agency-MBS | 1,37 | 0,70 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 5,42 | 4,43 |
| Staatsemissionen | 1,16 | 0,41 |
| Stammaktien | 43,81 | 48,53 |
| Real Estate Investment Trusts | 0,28 | 0,25 |
| Kurzfristige Instrumente | 29,77 | 31,13 |
| Investmentfonds | 7,17 | 5,89 |
| Pensionsgeschäfte | 0,82 | 2,65 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,17 | (0,20) |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf Indizes | (0,01) | k. A. |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,00 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,29) | 0,02 |
| Zinsswaps | (1,29) | (0,18) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,01) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf | (0,01) | (0,01) |
| Total Return Swaps auf Indizes | 0,10 | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | (0,88) | 0,29 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,14 | 0,09 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 8,65 | 1,70 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **ARGENTINIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 09.07.2030 | $ | 5.624 | $ 1.182 | 0,06 |
| 1,125 % fällig am 09.07.2035 | | 3.692 | 765 | 0,04 |
| 47,331 % fällig am 04.10.2022 | ARS | 20.070 | 17 | 0,00 |
| **Argentina Treasury Bond BONCER** | | | | |
| 1,400 % fällig am 25.03.2023 | | 50.161 | 184 | 0,01 |
| **Autonomous City of Buenos Aires Argentina** | | | | |
| 52,234 % fällig am 22.02.2028 (a) | | 52.420 | 188 | 0,01 |
| 53,715 % fällig am 29.03.2024 (a) | | 88.177 | 326 | 0,02 |
| Summe Argentinien | | | 2.662 | 0,14 |
| **ASERBAIDSCHAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Steas Funding DAC** | | | | |
| 7,230 % fällig am 17.03.2026 | $ | 4.500 | 4.219 | 0,23 |
| **BAHAMAS** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Bahamas Government International Bond** | | | | |
| 9,000 % fällig am 16.06.2029 | | 3.000 | 2.415 | 0,13 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco BTG Pactual S.A.** | | | | |
| 8,300 % fällig am 15.08.2024 | BRL | 228.000 | 40.211 | 2,17 |
| **Brazil Minas SPE Via State of Minas Gerais** | | | | |
| 5,333 % fällig am 15.02.2028 | $ | 600 | 589 | 0,03 |
| **Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.08.2022 (d)(f) | | 485 | 2 | 0,00 |
| **Oi S.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.02.2035 | BRL | 4.559 | 3.615 | 0,20 |
| **Swiss Insured Brazil Power Finance SARL** | | | | |
| 9,850 % fällig am 16.07.2032 | | 206.780 | 34.402 | 1,86 |
| **Vale S.A.** | | | | |
| 0,000 % (f) | | 99.420 | 7.999 | 0,43 |
| Summe Brasilien | | | 86.818 | 4,69 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Interoceanica Finance Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 30.11.2025 (d) | $ | 434 | 384 | 0,02 |
| **Kaisa Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 9,750 % fällig am 28.09.2023 ^ | | 8.000 | 1.109 | 0,06 |
| 10,500 % fällig am 15.01.2025 ^ | | 1.900 | 261 | 0,01 |
| 10,875 % fällig am 23.07.2023 ^ | | 500 | 69 | 0,00 |
| 11,700 % fällig am 11.11.2025 ^ | | 1.900 | 265 | 0,02 |
| **Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar und 1,000 % PIK)** | | | | |
| 7,350 % fällig am 01.12.2026 ^(b) | | 498 | 308 | 0,02 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | | |
| 6,720 % fällig am 01.12.2022 ^ | | 53 | 51 | 0,00 |
| **Poinsettia Finance Ltd.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 17.06.2031 | | 7.371 | 6.689 | 0,36 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 6,800 % fällig am 04.03.2030 (b) | IDR | 162.000.000 | 10.013 | 0,54 |
| Summe Cayman Inseln | | | 19.149 | 1,03 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **CHILE** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos** | | | | |
| 2,800 % fällig am 01.10.2033 | CLP | 3.590.000 | $ 2.747 | 0,15 |
| 4,500 % fällig am 15.10.2023 | | 165.434 | 184 | 0,01 |
| 5,000 % fällig am 01.03.2035 | | 4.055.000 | 3.831 | 0,21 |
| 6,000 % fällig am 01.01.2043 | | 6.895.000 | 7.107 | 0,38 |
| Summe Chile | | | 13.869 | 0,75 |
| **CHINA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Flourish Century** | | | | |
| 6,600 % fällig am 04.02.2049 ^(i) | $ | 2.800 | 308 | 0,02 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **China Government Bond** | | | | |
| 2,700 % fällig am 03.11.2026 | CNY | 96.600 | 14.463 | 0,78 |
| 3,030 % fällig am 11.03.2026 | | 308.500 | 46.895 | 2,53 |
| 3,120 % fällig am 05.12.2026 | | 83.500 | 12.747 | 0,69 |
| 3,280 % fällig am 03.12.2027 | | 164.010 | 25.274 | 1,36 |
| 3,810 % fällig am 14.09.2050 | | 89.400 | 14.449 | 0,78 |
| | | | 113.828 | 6,14 |
| Summe China | | | 114.136 | 6,16 |
| **KOLUMBIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Empresas Publicas de Medellin ESP** | | | | |
| 7,625 % fällig am 10.09.2024 | COP | 7.839.000 | 1.757 | 0,10 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Colombia Government International Bond** | | | | |
| 4,375 % fällig am 21.03.2023 | | 19.889.000 | 4.604 | 0,25 |
| 9,850 % fällig am 28.06.2027 | | 25.455.000 | 6.000 | 0,32 |
| **Colombian TES** | | | | |
| 5,750 % fällig am 03.11.2027 | | 93.221.200 | 17.748 | 0,96 |
| 6,000 % fällig am 28.04.2028 | | 34.450.000 | 6.482 | 0,35 |
| 6,250 % fällig am 26.11.2025 | | 261.166.900 | 55.069 | 2,97 |
| 6,250 % fällig am 09.07.2036 | | 11.355.800 | 1.731 | 0,09 |
| 7,000 % fällig am 26.03.2031 | | 76.546.000 | 13.939 | 0,75 |
| 7,000 % fällig am 30.06.2032 | | 30.685.600 | 5.446 | 0,29 |
| 7,250 % fällig am 18.10.2034 | | 42.222.600 | 7.300 | 0,40 |
| 7,250 % fällig am 26.10.2050 | | 16.745.900 | 2.515 | 0,14 |
| 7,500 % fällig am 26.08.2026 | | 80.543.200 | 17.226 | 0,93 |
| 9,250 % fällig am 28.05.2042 | | 18.391.000 | 3.535 | 0,19 |
| **Republic of Colombia** | | | | |
| 1,000 % fällig am 11.03.2027 (b) | | 29.254.000 | 5.568 | 0,30 |
| 1,000 % fällig am 11.03.2027 (b) | | 71.482.000 | 13.605 | 0,73 |
| 1,000 % fällig am 28.04.2028 (b) | | 6.436.000 | 1.210 | 0,07 |
| 1,000 % fällig am 09.07.2036 (b) | | 1.772.000 | 270 | 0,02 |
| | | | 162.248 | 8,76 |
| Summe Kolumbien | | | 164.005 | 8,86 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ GENS |
|---|---|---|---|---|
| **TSCHECHISCHE REPUBLIK** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Czech Republic Government International Bond** | | | | |
| 0,950 % fällig am 15.05.2030 | CZK | 281.440 | $ 8.848 | 0,48 |
| 1,200 % fällig am 13.03.2031 | | 235.000 | 7.373 | 0,40 |
| 2,000 % fällig am 13.10.2033 | | 6.100 | 196 | 0,01 |
| 4,200 % fällig am 04.12.2036 | | 149.900 | 5.916 | 0,32 |
| Summe Tschechische Republik | | | 22.333 | 1,21 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | DKK | 0 | 0 | 0,00 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 0 | 0 | 0,00 |
| Summe Dänemark | | | 0 | 0,00 |
| **DOMINIKANISCHE REPUBLIK** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Dominican Republic Government International Bond** | | | | |
| 8,900 % fällig am 15.02.2023 | DOP | 956.650 | 17.411 | 0,94 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 04.10.2023 (f)(h) | $ | 900 | 867 | 0,05 |
| 7,875 % fällig am 18.12.2023 (f)(h) | | 200 | 197 | 0,01 |
| Summe Frankreich | | | 1.064 | 0,06 |
| **UNGARN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Hungary Government International Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 23.05.2029 | HUF | 1.990.500 | 3.608 | 0,20 |
| 2,750 % fällig am 22.12.2026 | | 1.620.400 | 3.399 | 0,18 |
| 3,000 % fällig am 27.10.2038 | | 128.100 | 188 | 0,01 |
| 3,250 % fällig am 22.10.2031 | | 795.000 | 1.462 | 0,08 |
| 4,000 % fällig am 28.04.2051 | | 924.000 | 1.381 | 0,07 |
| Summe Ungarn | | | 10.038 | 0,54 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.04.2032 | IDR | 852.664.000 | 54.090 | 2,92 |
| 6,500 % fällig am 15.02.2031 | | 381.757.000 | 24.469 | 1,32 |
| 7,000 % fällig am 15.09.2030 | | 278.789.000 | 18.537 | 1,00 |
| 7,500 % fällig am 15.06.2035 | | 59.040.000 | 3.984 | 0,21 |
| Summe Indonesien | | | 101.080 | 5,45 |
| **IRLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Black Diamond CLO DAC** | | | | |
| 0,860 % fällig am 20.01.2032 | € | 899 | 927 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **BNPP AM Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,600 % fällig am 15.04.2031 | € | 500 | $ 508 | 0,03 |
| **Cairn CLO DAC** | | | | |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | | 3.700 | 3.770 | 0,20 |
| **Carlyle Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,700 % fällig am 15.01.2031 | | 4.600 | 4.698 | 0,25 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.11.2031 | | 1.900 | 1.951 | 0,11 |
| **Dryden Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,860 % fällig am 15.05.2034 | | 7.400 | 7.485 | 0,40 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 26.06.2030 | | 3.019 | 3.103 | 0,17 |
| **Oak Hill European Credit Partners Ltd.** | | | | |
| 0,900 % fällig am 22.07.2030 | | 936 | 972 | 0,05 |
| Summe Irland | | | 23.414 | 1,26 |
| **ELFENBEINKÜSTE** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Republik Côte d'Ivoire** | | | | |
| 5,000 % fällig am 19.03.2027 (b) | | 7.900 | 7.943 | 0,43 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Corsair International Ltd.** | | | | |
| 4,850 % fällig am 28.01.2027 | | 6.500 | 6.415 | 0,34 |
| 5,200 % fällig am 28.01.2029 | | 2.800 | 2.734 | 0,15 |
| Summe Jersey, Kanalinseln | | | 9.149 | 0,49 |
| **KASACHSTAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Development Bank of Kazakhstan JSC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 10.12.2022 | $ | 500 | 499 | 0,03 |
| 8,950 % fällig am 04.05.2023 | KZT | 2.290.000 | 4.271 | 0,23 |
| Summe Kasachstan | | | 4.770 | 0,26 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar oder 4,000 % PIK)** | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.12.2026 (b) | $ | 331 | 244 | 0,01 |
| **MALAYSIA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Malaysia Government International Bond** | | | | |
| 3,757 % fällig am 22.05.2040 | MYR | 44.100 | 8.742 | 0,47 |
| 3,828 % fällig am 05.07.2034 | | 14.090 | 2.974 | 0,16 |
| 3,844 % fällig am 15.04.2033 | | 19.000 | 4.060 | 0,22 |
| 3,885 % fällig am 15.08.2029 | | 32.500 | 7.209 | 0,39 |
| 4,065 % fällig am 15.06.2050 | | 49.140 | 9.668 | 0,52 |
| 4,254 % fällig am 31.05.2035 | | 67.200 | 14.676 | 0,79 |
| 4,642 % fällig am 07.11.2033 | | 20 | 5 | 0,00 |
| 4,762 % fällig am 07.04.2037 | | 7.700 | 1.779 | 0,10 |
| **Malaysia Government Investment Issue** | | | | |
| 4,130 % fällig am 09.07.2029 | | 20.100 | 4.527 | 0,24 |
| 4,369 % fällig am 31.10.2028 | | 175.800 | 40.254 | 2,17 |
| 4,417 % fällig am 30.09.2041 | | 39.000 | 8.423 | 0,46 |
| Summe Malaysia | | | 102.317 | 5,52 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **MEXIKO** | | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **Hipotecaria Su Casita S.A. (c)** | | 212.074 | 0 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **America Movil S.A.B. de C.V.** | | | | |
| 8,460 % fällig am 18.12.2036 | MYR | 1.800 | 77 | 0,01 |
| **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 |
| **Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V.** | | | | |
| 8,790 % fällig am 09.12.2014 ^ | | 29.700 | 0 | 0,00 |
| | | | 112 | 0,01 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 7,500 % fällig am 03.06.2027 | | 363.600 | 16.849 | 0,91 |
| 7,750 % fällig am 29.05.2031 | | 89.000 | 4.071 | 0,22 |
| 7,750 % fällig am 23.11.2034 | | 12.500 | 561 | 0,03 |
| 7,750 % fällig am 13.11.2042 | | 283.300 | 12.302 | 0,66 |
| 8,000 % fällig am 07.11.2047 | | 278.900 | 12.351 | 0,66 |
| 8,500 % fällig am 31.05.2029 | | 159.000 | 7.660 | 0,41 |
| 8,500 % fällig am 18.11.2038 | | 439.200 | 20.691 | 1,12 |
| 10,000 % fällig am 20.11.2036 | | 9.600 | 514 | 0,03 |
| | | | 74.999 | 4,04 |
| Summe Mexiko | | | 75.111 | 4,05 |
| **MAROKKO** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Morocco Government International Bond** | | | | |
| 4,250 % fällig am 11.12.2022 | $ | 300 | 300 | 0,02 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Republic of Angola Via Avenir BV** | | | | |
| 6,609 % fällig am 07.12.2023 | | 4.740 | 4.681 | 0,25 |
| 10,447 % fällig am 01.07.2023 | | 754 | 755 | 0,04 |
| Summe Niederlande | | | 5.436 | 0,29 |
| **NIGERIA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BOI Finance BV** | | | | |
| 7,500 % fällig am 16.02.2027 | € | 4.800 | 4.065 | 0,22 |
| **PERU** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,350 % fällig am 12.08.2040 | PEN | 6.500 | 1.282 | 0,07 |
| 5,400 % fällig am 12.08.2034 | | 36.800 | 7.823 | 0,42 |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | | 99.800 | 24.006 | 1,29 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 41.053 | 9.558 | 0,52 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 | | 3.500 | 869 | 0,05 |
| 6,900 % fällig am 12.08.2037 | | 35.900 | 8.561 | 0,46 |
| 8,200 % fällig am 12.08.2026 | | 24.828 | 6.833 | 0,37 |
| Summe Peru | | | 58.932 | 3,18 |
| **PHILIPPINEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Philippines Government International Bond** | | | | |
| 3,900 % fällig am 26.11.2022 | PHP | 943.000 | 16.812 | 0,91 |
| 6,250 % fällig am 14.01.2036 | | 52.000 | 915 | 0,05 |
| Summe Philippinen | | | 17.727 | 0,96 |
| **POLEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Poland Government International Bond** | | | | |
| 0,250 % fällig am 25.10.2026 | PLN | 67.200 | 11.186 | 0,60 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 1,750 % fällig am 25.04.2032 | | 62.100 | 8.865 | 0,48 |
| 2,500 % fällig am 25.07.2027 | | 19.800 | 3.533 | 0,19 |
| 2,750 % fällig am 25.04.2028 | | 216.800 | 38.698 | 2,09 |
| 2,750 % fällig am 25.10.2029 | | 56.100 | 9.582 | 0,52 |
| Summe Polen | | | 71.864 | 3,88 |
| **KATAR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Nakilat, Inc.** | | | | |
| 6,067 % fällig am 31.12.2033 | $ | 166 | 177 | 0,01 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 6,800 % fällig am 04.03.2030 | IDR | 951.700.000 | 58.827 | 3,18 |
| 6,900 % fällig am 23.01.2025 | IDR | 276.200.000 | $18.178 | 0,98 |
| Summe Katar | | | 77.182 | 4,17 |
| **RUMÄNIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Romania Government International Bond** | | | | |
| 3,650 % fällig am 28.07.2025 | RON | 42.200 | 7.747 | 0,42 |
| 3,700 % fällig am 25.11.2024 | | 9.700 | 1.836 | 0,10 |
| 4,150 % fällig am 26.01.2028 | | 46.800 | 7.944 | 0,43 |
| 4,500 % fällig am 17.06.2024 | | 212.500 | 41.650 | 2,25 |
| 4,750 % fällig am 11.10.2034 | | 18.200 | 2.687 | 0,14 |
| 4,850 % fällig am 25.07.2029 | | 6.600 | 1.117 | 0,06 |
| 5,000 % fällig am 12.02.2029 | | 12.600 | 2.176 | 0,12 |
| Summe Rumänien | | | 65.157 | 3,52 |
| **RUSSLAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Russia Government International Bond** | | | | |
| 1,125 % fällig am 20.11.2027 | € | 100 | 29 | 0,00 |
| 5,100 % fällig am 28.03.2035 ^ | $ | 1.200 | 318 | 0,02 |
| 5,700 % fällig am 17.05.2028 ^ | RUB | 1.794.100 | 2.949 | 0,16 |
| 6,900 % fällig am 23.07.2031 ^ | | 1.880.100 | 3.091 | 0,17 |
| 7,050 % fällig am 19.01.2028 ^ | | 998.500 | 1.641 | 0,09 |
| 7,100 % fällig am 16.10.2024 ^ | | 399.100 | 656 | 0,03 |
| 7,650 % fällig am 10.04.2030 ^ | | 1.153.700 | 1.897 | 0,10 |
| 7,700 % fällig am 23.03.2033 ^ | | 1.638.800 | 2.694 | 0,14 |
| 7,950 % fällig am 07.10.2026 ^ | | 2.103.200 | 3.457 | 0,19 |
| 8,500 % fällig am 17.09.2031 ^ | | 548.200 | 901 | 0,05 |
| Summe Russland | | | 17.633 | 0,95 |
| **SERBIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Serbia Government International Bond** | | | | |
| 4,500 % fällig am 20.08.2032 | RSD | 706.800 | 5.108 | 0,28 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Development Bank of Southern Africa** | | | | |
| 8,600 % fällig am 21.10.2024 (b) (i) | ZAR | 221.300 | 13.261 | 0,71 |
| **Eskom Holdings SOC Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 18.08.2027 (d) | | 100.100 | 2.781 | 0,15 |
| 0,000 % fällig am 31.12.2032 (d) | | 254.000 | 3.106 | 0,17 |
| 6,750 % fällig am 06.08.2023 | $ | 4.400 | 4.059 | 0,22 |
| **Transnet SOC Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 26.07.2022 | | 2.900 | 2.780 | 0,15 |
| | | | 25.987 | 1,40 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 6,500 % fällig am 28.02.2041 | ZAR | 401.900 | 15.070 | 0,81 |
| 7,000 % fällig am 28.02.2031 | | 106.446 | 5.113 | 0,28 |
| 8,000 % fällig am 31.01.2030 | | 478.927 | 25.417 | 1,37 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 8,250 % fällig am 31.03.2032 | ZAR | 454.180 | $ 23.226 | 1,25 |
| 8,500 % fällig am 31.01.2037 | | 697.900 | 33.686 | 1,82 |
| 8,750 % fällig am 31.01.2044 | | 68.700 | 3.257 | 0,18 |
| 8,875 % fällig am 28.02.2035 | | 320.000 | 16.380 | 0,88 |
| 9,000 % fällig am 31.01.2040 | | 152.100 | 7.490 | 0,41 |
| 10,500 % fällig am 21.12.2026 | | 1.507.632 | 97.453 | 5,26 |
| | | | 227.092 | 12,26 |
| Summe Südafrika | | | 253.079 | 13,66 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Export-Import Bank of Korea** | | | | |
| 7,250 % fällig am 07.12.2024 | IDR | 4.100.000 | 281 | 0,02 |
| 8,000 % fällig am 15.05.2024 | | 2.800.000 | 195 | 0,01 |
| Summe Südkorea | | | 476 | 0,03 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 ()(h) | € | 200 | 202 | 0,01 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 18.07.2022 (f)(h) | | 200 | 209 | 0,01 |
| Summe Spanien | | | 411 | 0,02 |
| **SUPRANATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Asian Development Bank** | | | | |
| 4,700 % fällig am 12.03.2024 | MXN | 68.600 | 3.105 | 0,17 |
| **Corp. Andina de Fomento** | | | | |
| 6,770 % fällig am 24.05.2028 | COP | 22.000.000 | 4.346 | 0,23 |
| **International Finance Corp.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 09.10.2023 | IDR | 6.900.000 | 478 | 0,03 |
| Summe Supranational | | | 7.929 | 0,43 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 7,125 % fällig am 29.07.2022 (f)(h) | $ | 700 | 700 | 0,04 |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (f)(h) | | 1.700 | 1.572 | 0,08 |
| 7,500 % fällig am 11.12.2023 (f)(h) | | 2.900 | 2.770 | 0,15 |
| Summe Schweiz | | | 5.042 | 0,27 |
| **TANSANIA** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **The Ministry of Finance and Planning, Government of the United Republic of Tanzania** | | | | |
| 5,400 % fällig am 26.04.2028 (b) | € | 12.100 | 12.682 | 0,68 |
| **THAILAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Thailand Government International Bond** | | | | |
| 1,585 % fällig am 17.12.2035 | THB | 388.850 | 8.914 | 0,48 |
| 1,600 % fällig am 17.06.2035 | | 190.200 | 4.399 | 0,24 |
| 2,000 % fällig am 17.06.2042 | | 55.400 | 1.182 | 0,06 |
| 2,875 % fällig am 17.12.2028 | | 400.000 | 11.449 | 0,62 |
| 2,875 % fällig am 17.06.2046 | THB | 73.500 | $ 1.722 | 0,09 |
| 3,300 % fällig am 17.06.2038 | | 641.950 | 17.479 | 0,94 |
| 3,400 % fällig am 17.06.2036 | | 220.500 | 6.150 | 0,33 |
| 3,775 % fällig am 25.06.2032 | | 519.210 | 15.820 | 0,86 |
| Summe Thailand | | | 67.115 | 3,62 |
| **TÜRKEI** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **SOCAR Turkey Enerji A/S** | | | | |
| 3,450 % fällig am 11.08.2026 (b) | € | 9.900 | 9.781 | 0,53 |
| **UGANDA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Republic of Uganda Government International Bond** | | | | |
| 14,250 % fällig am 23.08.2029 | UGX | 5.706.200 | 1.461 | 0,08 |
| 16,250 % fällig am 08.11.2035 | | 4.624.100 | 1.213 | 0,06 |
| Summe Uganda | | | 2.674 | 0,14 |
| **UKRAINE** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ukraine Government International Bond** | | | | |
| 7,375 % fällig am 25.09.2032 | $ | 1.600 | 404 | 0,02 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2022 | | 1.157 | 654 | 0,04 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2023 | | 3.900 | 1.267 | 0,07 |
| Summe Ukraine | | | 2.325 | 0,13 |
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ADCB Finance Cayman Ltd.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.10.2029 | IDR | 29.000.000 | 1.890 | 0,10 |
| 8,160 % fällig am 29.04.2029 | | 323.000.000 | 21.636 | 1,17 |
| | | | 23.526 | 1,27 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **NMC OpCo Ltd.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 25.03.2027 (b) | AED | 43.158 | 11.934 | 0,64 |
| Summe Vereinigte Arabische Emirate | | | 35.460 | 1,91 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (f)(h) | £ | 1.000 | 1.197 | 0,07 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (f)(h) | $ | 1.300 | 1.280 | 0,07 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2022 (f)(h) | £ | 800 | 970 | 0,05 |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 29.06.2027 | $ | 550 | 165 | 0,01 |
| 3,250 % fällig am 25.02.2030 | | 200 | 60 | 0,00 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 16.09.2022 (f)(h) | € | 200 | 207 | 0,01 |
| | | | 3.879 | 0,21 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Warwick Finance Residential Mortgages PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.12.2049 (d) | £ | 0 | 141 | 0,01 |
| Summe Großbritannien | | | 4.020 | 0,22 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.12.2036 | $ | 1.351 | $ 778 | 0,04 |
| 1,924 % fällig am 25.10.2036 | | 456 | 328 | 0,02 |
| **GSAMP Trust** | | | | |
| 1,674 % fällig am 25.12.2046 | | 472 | 251 | 0,01 |
| 1,714 % fällig am 25.01.2037 | | 928 | 597 | 0,03 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 5,111 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 1.697 | 1.589 | 0,09 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,774 % fällig am 25.08.2037 | | 689 | 634 | 0,03 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 1,854 % fällig am 25.11.2036 | | 7.543 | 4.812 | 0,26 |
| 1,924 % fällig am 25.06.2036 | | 176 | 154 | 0,01 |
| 2,779 % fällig am 25.01.2035 | | 1.732 | 1.599 | 0,09 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 1,794 % fällig am 25.01.2037 | | 1.801 | 673 | 0,04 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,844 % fällig am 25.04.2037 | | 519 | 385 | 0,02 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,359 % fällig am 25.08.2035 | | 100 | 98 | 0,01 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 3,274 % fällig am 25.07.2035 | | 2.345 | 2.293 | 0,12 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,844 % fällig am 25.10.2037 | | 5.560 | 3.746 | 0,20 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.07.2036 | | 1.300 | 1.211 | 0,06 |
| | | | 19.148 | 1,03 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **ENERGIE** | | | | |
| **Constellation Oil Services Holding S.A. (c)(i)** | | 376.971 | 41 | 0,00 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **DAE Funding LLC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 15.02.2024 | $ | 5.600 | 5.307 | 0,29 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 3,550 % fällig am 07.10.2022 | | 1.900 | 1.894 | 0,10 |
| 4,535 % fällig am 06.03.2025 | £ | 400 | 456 | 0,02 |
| **JPMorgan Structured Products BV** | | | | |
| 12,000 % fällig am 28.08.2026 (i) | ZMW | 61.760 | 2.494 | 0,14 |
| 12,000 % fällig am 04.01.2027 (i) | | 52.875 | 2.070 | 0,11 |
| 14,000 % fällig am 09.12.2031 (i) | | 59.100 | 2.066 | 0,11 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | | |
| 8,200 % fällig am 06.04.2028 | $ | 3.224 | 3.355 | 0,18 |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | | 1.455 | 1.509 | 0,08 |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027 | | 657 | 700 | 0,04 |
| | | | 19.851 | 1,07 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 3,562 % fällig am 25.09.2045 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | | |
| 2,733 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 1 | 1 | 0,00 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 3,148 % fällig am 26.05.2037 | | 3.605 | 3.413 | 0,18 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,951 % fällig am 25.03.2035 | | 8 | 8 | 0,00 |
| 2,961 % fällig am 25.01.2035 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 3,278 % fällig am 25.05.2047 ^ | | 13 | 13 | 0,00 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 2,593 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 306 | 273 | 0,01 |
| 2,985 % fällig am 25.04.2037 | | 6.965 | 5.461 | 0,29 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,360 % fällig am 25.03.2034 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 3,396 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 3.052 | 2.780 | 0,15 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,984 % fällig am 25.04.2046 | | 115 | 107 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| 2,252 % fällig am 20.12.2035 | $ 466 | $ 428 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 | 4.259 | 2.763 | 0,15 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 2,424 % fällig am 25.03.2035 | 42 | 39 | 0,00 |
| 3,093 % fällig am 25.11.2037 | 332 | 312 | 0,02 |
| **FWD Securitization Trust** | | | |
| 2,240 % fällig am 25.01.2050 | 699 | 679 | 0,04 |
| **GSMPS Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,974 % fällig am 25.01.2036 | 145 | 122 | 0,01 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,867 % fällig am 25.01.2036 ^ | 4 | 4 | 0,00 |
| **Impac CMB Trust** | | | |
| 2,264 % fällig am 25.03.2035 | 98 | 92 | 0,01 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,804 % fällig am 25.02.2037 | 411 | 406 | 0,02 |
| 1,964 % fällig am 25.11.2036 | 6.118 | 6.064 | 0,33 |
| 2,650 % fällig am 25.11.2037 | 227 | 193 | 0,01 |
| **JPMorgan Resecuritization Trust** | | | |
| 2,500 % fällig am 25.03.2056 | 225 | 215 | 0,01 |
| **Lehman XS Trust** | | | |
| 2,004 % fällig am 25.09.2046 | 1.673 | 1.561 | 0,08 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,535 % fällig am 25.06.2036 | 1 | 1 | 0,00 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.03.2037 ^ | 332 | 285 | 0,02 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | |
| 2,980 % fällig am 20.01.2038 ^ | 274 | 226 | 0,01 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | |
| 1,774 % fällig am 25.02.2037 | 675 | 620 | 0,03 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 1,994 % fällig am 25.05.2034 | 134 | 133 | 0,01 |
| 3,145 % fällig am 25.02.2037 ^ | 24 | 23 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,494 % fällig am 25.10.2036 | 311 | 297 | 0,02 |
| | | 26.521 | 1,43 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae** | | | |
| 1,979 % fällig am 01.07.2035 | $ 13 | $ 12 | 0,00 |
| Summe USA | | 65.573 | 3,53 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | |
| **Constellation Brands, Inc.** | | | |
| 2,437 % fällig am 15.07.2022 | 4.400 | 4.396 | 0,24 |
| **International Flavors & Fragrances, Inc.** | | | |
| 3,048 % fällig am 15.07.2022 | 2.800 | 2.798 | 0,15 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | |
| 1,271 % fällig am 12.07.2022 | 500 | 500 | 0,03 |
| | | 7.694 | 0,42 |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | |
| 51,049 % fällig am 30.09.2022 (d)(e) | ARS 220.700 | 740 | 0,04 |
| **ISRAEL TREASURY BILLS** | | | |
| (0,051) % fällig am 03.08.2022 (d)(e) | ILS 16.300 | 4.654 | 0,25 |
| (0,020) % fällig am 07.12.2022 (d)(e) | 9.000 | 2.563 | 0,14 |
| 0,000 % fällig am 07.12.2022 (d)(e) | 25.000 | 7.120 | 0,38 |
| | | 14.337 | 0,77 |
| **MALAYSIA TREASURY BILLS** | | | |
| 2,326 % fällig am 17.11.2022 (d) | MYR 211.600 | 47.523 | 2,56 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **U.S. TREASURY BILLS** | | | |
| 0,611 % fällig am 19.07.2022 (d)(e) | $ 2.900 | 2.898 | 0,16 |
| 1,089 % fällig am 23.08.2022 (d)(e)(j) | $ 9.700 | $ 9.679 | 0,52 |
| | | 12.577 | 0,68 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 82.871 | 4,47 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | **$ 1.654.989** | **89,32** |
| | **AKTIEN** | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (g)** | 250.000 | 2.123 | 0,12 |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Emerging Markets Opportunities Fund (g)** | 1.946.138 | 18.780 | 1,01 |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)** | 14.111.023 | 140.376 | 7,58 |
| **PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (g)** | 384.409 | 5.228 | 0,28 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$ 166.507** | **8,99** |

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

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

### FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month SOFR June Futures | Short | 09.2023 | 597 | $ 188 | 0,01 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 188** | **0,01** |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| General Electric Co. | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 1.100 | $ (10) | 0,00 |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Asia Ex-Japan 37 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2027 | $ 6.500 | $ (87) | (0,01) |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung[3] | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 5,750 % | 15.03.2024 | INR 24.184.600 | $ 545 | 0,03 |
| Erhalt | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 5,750 | 16.03.2027 | 306.400 | (53) | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 6,250 | 16.03.2032 | 3.032.700 | (990) | (0,05) |
| Erhalt | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 1,250 | 16.03.2024 | SGD 316.800 | 1.583 | 0,09 |
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 1,250 | 15.09.2031 | 2.160 | (36) | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 1,250 | 15.09.2031 | 2.160 | 206 | 0,00 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 2,250 % | 15.06.2027 | SGD | 29.200 | $ (263) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 2,250 | 15.06.2032 | | 50.890 | (966) | (0,05) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 4,030 | 02.01.2023 | BRL | 184.300 | (1.638) | (0,09) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 4,038 | 02.01.2023 | | 45.000 | (400) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 4,070 | 02.01.2023 | | 161.500 | (1.433) | (0,08) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 4,605 | 02.01.2023 | | 166.600 | 1.449 | 0,08 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 4,870 | 02.01.2024 | | 326.700 | (4.793) | (0,26) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,000 | 02.01.2023 | | 94.400 | (788) | (0,04) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 5,100 | 02.01.2024 | | 50.600 | 715 | 0,04 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 5,160 | 02.01.2024 | | 348.300 | 4.916 | 0,27 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 5,350 | 02.01.2023 | | 52.700 | 432 | 0,02 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 5,360 | 02.01.2023 | | 4.900 | 40 | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,440 | 02.01.2023 | | 19.900 | (161) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,660 | 02.01.2025 | | 183.200 | (2.992) | (0,16) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,680 | 02.01.2024 | | 19.200 | (262) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,710 | 02.01.2025 | | 66.100 | (1.052) | (0,06) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,745 | 02.01.2023 | | 66.700 | (533) | (0,03) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,780 | 02.01.2023 | | 9.800 | (78) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,920 | 02.01.2023 | | 2.600 | (21) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 6,010 | 02.01.2025 | | 34.000 | (533) | (0,03) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,020 | 04.01.2027 | | 36.800 | 751 | 0,04 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 6,030 | 02.01.2025 | | 76.700 | (1.198) | (0,06) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,050 | 02.01.2025 | | 102.500 | 1.605 | 0,09 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 6,140 | 04.01.2027 | | 528.200 | (10.931) | (0,58) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,180 | 04.01.2027 | | 79.900 | 1.603 | 0,09 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 6,230 | 02.01.2023 | | 141.800 | (1.094) | (0,06) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,245 | 04.01.2027 | | 10.400 | 210 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,250 | 04.01.2027 | | 27.100 | 541 | 0,03 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 6,375 | 02.01.2023 | | 48.800 | (373) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 6,410 | 04.01.2027 | | 80.000 | (1.580) | (0,09) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,450 | 04.01.2027 | | 21.800 | 432 | 0,02 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,500 | 04.01.2027 | | 62.500 | 1.244 | 0,07 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,510 | 04.01.2027 | | 66.800 | 1.319 | 0,07 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,520 | 04.01.2027 | | 93.600 | 1.838 | 0,10 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 6,675 | 02.01.2023 | | 157.400 | (1.181) | (0,06) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 6,710 | 02.01.2025 | | 13.900 | (210) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,745 | 02.01.2025 | | 231.100 | 3.485 | 0,19 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,810 | 02.01.2025 | | 147.200 | 2.213 | 0,12 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,910 | 02.01.2023 | | 80.000 | 685 | 0,04 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 6,950 | 04.01.2027 | | 800 | (15) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 6,990 | 04.01.2027 | | 59.200 | (1.133) | (0,06) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 7,115 | 04.01.2027 | | 82.200 | (1.564) | (0,08) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 7,160 | 02.01.2025 | | 9.100 | (142) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 7,170 | 02.01.2025 | | 11.900 | (186) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 7,170 | 04.01.2027 | | 108.700 | 2.060 | 0,11 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 7,195 | 02.01.2023 | | 319.800 | 2.535 | 0,14 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 7,305 | 04.01.2027 | | 37.400 | (705) | (0,04) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 7,310 | 02.01.2024 | | 46.400 | (729) | (0,04) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 7,480 | 02.01.2025 | | 119.400 | (1.735) | (0,09) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 7,770 | 04.01.2027 | | 166.100 | 3.215 | 0,17 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 7,775 | 02.01.2024 | | 117.500 | (1.655) | (0,09) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 7,800 | 04.01.2027 | | 27.000 | (495) | (0,03) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 8,075 | 02.01.2024 | | 120.000 | 1.621 | 0,09 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 8,300 | 02.01.2024 | | 65.600 | (832) | (0,05) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 8,355 | 04.01.2027 | | 54.900 | (1.212) | (0,07) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 8,450 | 04.01.2027 | | 102.700 | (2.222) | (0,12) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 8,635 | 04.01.2027 | | 65.500 | 1.150 | 0,06 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 8,640 | 04.01.2027 | | 105.900 | (1.858) | (0,10) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 8,675 | 04.01.2027 | | 19.900 | 348 | 0,02 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 8,750 | 04.01.2027 | | 282.400 | 5.395 | 0,29 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 8,805 | 04.01.2027 | | 37.700 | (738) | (0,04) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 9,020 | 02.01.2023 | | 98.600 | (582) | (0,03) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 9,490 | 04.01.2027 | | 104.000 | (1.734) | (0,09) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 9,600 | 04.01.2027 | | 48.900 | 798 | 0,04 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 9,750 | 02.01.2025 | | 17.400 | (216) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 9,760 | 02.01.2025 | | 51.200 | (637) | (0,03) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 9,780 | 02.01.2024 | | 110.500 | (920) | (0,05) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,120 | 04.01.2027 | | 2.100 | (26) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,206 | 04.01.2027 | | 8.900 | (108) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 10,240 | 04.01.2027 | | 67.300 | 1.075 | 0,06 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,300 | 02.01.2025 | | 50.300 | (605) | (0,03) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 10,300 | 04.01.2027 | | 77.600 | 1.236 | 0,07 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,665 | 02.01.2024 | | 5.500 | (35) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,755 | 02.01.2024 | | 20.900 | (127) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,833 | 02.01.2024 | | 82.000 | (482) | (0,03) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,860 | 02.01.2023 | | 115.200 | (543) | (0,03) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,898 | 02.01.2024 | | 160.100 | (927) | (0,05) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,995 | 02.01.2024 | | 12.900 | (69) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,995 | 04.01.2027 | | 54.800 | (421) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,020 | 04.01.2027 | | 43.300 | (327) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,045 | 04.01.2027 | | 53.100 | (393) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,048 | 04.01.2027 | | 82.500 | (610) | (0,03) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,050 | 04.01.2027 | | 58.600 | (432) | (0,02) |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,055 % | 04.01.2027 | BRL | 53.500 | $ (393) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,065 | 02.01.2024 | | 43.700 | (220) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,065 | 04.01.2027 | | 54.800 | (400) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,130 | 04.01.2027 | | 31.500 | (225) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,140 | 04.01.2027 | | 37.700 | (267) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,148 | 02.01.2024 | | 10.900 | (52) | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 11,505 | 02.01.2024 | | 102.300 | 414 | 0,02 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 11,535 | 02.01.2024 | | 111.800 | 443 | 0,02 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 11,540 | 02.01.2024 | | 101.600 | 401 | 0,02 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 11,543 | 02.01.2024 | | 102.300 | 403 | 0,02 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,290 | 02.01.2024 | | 111.700 | (79) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,425 | 02.01.2025 | | 172.800 | (147) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,850 | 02.01.2025 | | 184.200 | 103 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 1,955 | 16.09.2025 | CNY | 17.800 | 44 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,500 | 16.03.2027 | | 170.800 | (154) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,620 | 16.12.2025 | | 13.600 | 18 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,625 | 16.12.2025 | | 60.400 | 78 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,735 | 16.12.2025 | | 43.500 | (47) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,787 | 17.03.2025 | | 80.200 | (71) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 2,148 | 25.09.2022 | COP | 70.412.700 | 42 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 2,740 | 24.07.2024 | | 7.014.700 | (149) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 3,090 | 26.11.2025 | | 76.500.000 | 2.027 | 0,11 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 3,125 | 15.01.2026 | | 3.301.000 | 91 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 3,130 | 17.07.2025 | | 34.734.600 | 923 | 0,05 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 3,240 | 15.10.2025 | | 77.435.000 | (2.132) | (0,12) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 3,255 | 11.12.2025 | | 57.933.000 | 1.561 | 0,08 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 3,620 | 26.11.2025 | | 69.048.400 | (1.980) | (0,11) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 3,680 | 03.11.2027 | | 17.350.000 | 550 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 3,900 | 24.07.2024 | | 37.822.300 | 940 | 0,05 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 3,975 | 23.06.2027 | | 11.832.300 | 383 | 0,02 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,005 | 20.08.2028 | | 53.353.700 | (1.857) | (0,10) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,060 | 26.11.2025 | | 66.789.000 | 2.072 | 0,11 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,075 | 26.11.2025 | | 21.848.700 | 679 | 0,04 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,090 | 26.11.2025 | | 56.359.000 | 1.763 | 0,09 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,115 | 01.02.2031 | | 14.558.000 | 484 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,120 | 01.02.2031 | | 10.388.000 | 346 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,155 | 15.01.2031 | | 5.060.000 | 170 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,690 | 26.11.2025 | | 25.630.900 | 844 | 0,05 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,820 | 26.11.2025 | | 63.629.600 | (2.035) | (0,11) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,945 | 29.07.2026 | | 35.000.000 | 1.242 | 0,07 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,175 | 28.05.2027 | | 32.437.000 | (1.221) | (0,07) |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,670 | 26.11.2025 | | 23.575.500 | (609) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,675 | 18.06.2031 | | 20.000.000 | 925 | 0,05 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,780 | 04.10.2026 | | 35.370.900 | (1.033) | (0,06) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 6,130 | 26.10.2026 | | 10.907.100 | 287 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 6,140 | 03.11.2027 | | 6.325.300 | 189 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 6,260 | 03.11.2027 | | 17.357.500 | 496 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 6,290 | 03.11.2027 | | 17.357.500 | 490 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 6,355 | 18.11.2027 | | 9.235.100 | 256 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 6,380 | 03.11.2027 | | 11.709.000 | 320 | 0,02 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 6,560 | 26.03.2031 | | 7.731.000 | (271) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 6,630 | 07.10.2031 | | 12.820.000 | (447) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 6,640 | 11.01.2027 | | 31.028.800 | 691 | 0,04 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 6,650 | 03.11.2027 | | 26.004.000 | 637 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 6,660 | 07.10.2031 | | 6.347.000 | (219) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 6,670 | 11.01.2027 | | 47.000.000 | 1.034 | 0,06 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 6,690 | 07.10.2031 | | 6.347.000 | (216) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 6,885 | 31.01.2025 | | 40.172.000 | 563 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,040 | 25.01.2027 | | 30.993.600 | 580 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,080 | 02.02.2027 | | 9.610.900 | 177 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,090 | 28.04.2028 | | 1.944.500 | 41 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,130 | 31.01.2027 | | 14.472.000 | 260 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,130 | 28.04.2028 | | 687.200 | 14 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,140 | 01.02.2027 | | 29.583.000 | 529 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,140 | 28.04.2028 | | 2.061.800 | 42 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,380 | 21.01.2029 | | 9.688.000 | 182 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,490 | 15.02.2023 | | 61.656.000 | (57) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,500 | 15.02.2025 | | 22.196.000 | 237 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,560 | 14.02.2024 | | 79.115.000 | 545 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,585 | 14.02.2027 | | 35.037.000 | (489) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,855 | 22.02.2025 | | 13.754.500 | 120 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,860 | 26.08.2026 | | 12.602.700 | 140 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,880 | 08.04.2029 | | 26.708.900 | 340 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,890 | 08.04.2027 | | 21.093.600 | 226 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,913 | 08.04.2027 | | 32.467.300 | 340 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,940 | 08.04.2027 | | 16.342.600 | 167 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,020 | 08.04.2025 | | 53.651.900 | 391 | 0,02 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,200 | 11.03.2027 | | 45.342.000 | (394) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,240 | 15.03.2027 | | 15.813.700 | (132) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,320 | 31.03.2027 | | 10.203.000 | (80) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,360 | 02.06.2027 | | 58.618.000 | (413) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,560 | 30.03.2027 | | 4.356.600 | (25) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,610 | 26.11.2025 | | 15.715.400 | 73 | 0,00 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,686 % | 30.03.2027 | COP | 25.932.000 | $ (117) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,720 | 26.11.2025 | | 23.335.000 | 89 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,890 | 12.05.2029 | | 15.649.000 | (11) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,960 | 09.06.2025 | | 64.923.500 | (163) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 9,270 | 26.11.2025 | | 34.576.000 | 23 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 9,430 | 26.11.2025 | | 77.000.000 | 49 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 9,430 | 16.06.2027 | | 26.792.900 | (80) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 3,210 | 17.06.2025 | ILS | 7.100 | (15) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,750 | 15.12.2026 | KRW | 107.046.200 | (6.205) | (0,34) |
| Erhalt | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,750 | 15.12.2031 | | 53.394.300 | 5.238 | 0,28 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 5,750 | 02.03.2024 | ZAR | 771.100 | 954 | 0,05 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 5,757 | 14.04.2026 | | 335.500 | (1.238) | (0,07) |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 6,124 | 08.03.2024 | | 587.600 | 522 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 6,635 | 04.02.2027 | | 402.800 | (1.265) | (0,07) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 6,956 | 11.03.2027 | | 157.800 | (424) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 6,991 | 31.03.2027 | | 300.000 | (818) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,120 | 26.05.2030 | | 88.500 | (433) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,205 | 22.04.2027 | | 178.200 | 342 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,210 | 22.04.2027 | | 137.000 | 262 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,250 | 19.09.2023 | | 142.300 | (525) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,460 | 06.03.2030 | | 110.400 | 595 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,490 | 06.03.2030 | | 53.400 | 290 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,020 | 01.03.2025 | CLP | 6.193.000 | 769 | 0,04 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,025 | 01.03.2025 | | 6.451.000 | 802 | 0,04 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,030 | 01.03.2025 | | 8.262.000 | 1.028 | 0,06 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,150 | 24.07.2025 | | 290.500 | (35) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,165 | 14.07.2025 | | 6.564.000 | (898) | (0,05) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,170 | 14.07.2025 | | 6.564.000 | (899) | (0,05) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,220 | 03.12.2022 | | 6.483.000 | (596) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,220 | 14.07.2025 | | 13.854.000 | (1.915) | (0,10) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,265 | 03.12.2022 | | 5.015.000 | (461) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,470 | 01.03.2025 | | 12.050.000 | (1.641) | (0,09) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,582 | 02.02.2026 | | 9.746.000 | (1.401) | (0,08) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,684 | 04.06.2027 | | 18.963.600 | (2.302) | (0,12) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,715 | 04.06.2027 | | 3.782.600 | (464) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,740 | 09.12.2025 | | 7.836.000 | (1.056) | (0,06) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,780 | 17.02.2026 | | 7.036.000 | 1.032 | 0,06 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,785 | 17.02.2026 | | 3.197.000 | 469 | 0,03 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,790 | 17.02.2026 | | 12.255.000 | 1.801 | 0,10 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,840 | 13.03.2025 | | 457.000 | 64 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,910 | 01.03.2023 | | 3.500.000 | 302 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,935 | 10.03.2025 | | 9.206.000 | 1.354 | 0,07 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,940 | 10.03.2025 | | 4.602.900 | 677 | 0,04 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,947 | 23.11.2027 | | 9.776.000 | 1.306 | 0,07 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,950 | 05.05.2026 | | 5.894.100 | (806) | (0,04) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,965 | 24.11.2027 | | 8.553.000 | 1.148 | 0,06 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,005 | 01.03.2023 | | 3.465.090 | 305 | 0,02 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,080 | 01.06.2030 | | 3.688.000 | (455) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,110 | 01.03.2023 | | 4.250.000 | 382 | 0,02 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,110 | 01.06.2030 | | 1.385.000 | (169) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,120 | 01.03.2023 | | 5.320.000 | 479 | 0,03 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,120 | 14.07.2030 | | 7.000.000 | 980 | 0,05 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,170 | 14.07.2030 | | 7.199.000 | 1.024 | 0,06 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,245 | 10.12.2027 | | 1.305.000 | (186) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,255 | 10.12.2027 | | 6.892.000 | (988) | (0,05) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,260 | 10.09.2027 | | 7.948.100 | 1.181 | 0,06 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,300 | 05.09.2026 | | 4.789.900 | 752 | 0,04 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,305 | 10.03.2026 | | 2.958.700 | 470 | 0,03 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,325 | 10.03.2026 | | 1.972.500 | 314 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,335 | 03.09.2026 | | 2.007.400 | 319 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,340 | 08.10.2027 | | 2.970.700 | 435 | 0,02 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,393 | 05.02.2025 | | 4.113.000 | (679) | (0,04) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,565 | 27.11.2030 | | 2.740.000 | (411) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,580 | 05.02.2026 | | 5.159.000 | (897) | (0,05) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,585 | 27.11.2030 | | 2.730.000 | (413) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,640 | 01.03.2026 | | 10.523.000 | 1.798 | 0,10 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,740 | 10.12.2030 | | 5.395.000 | (846) | (0,05) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,770 | 12.02.2031 | | 2.650.000 | (435) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,000 | 07.01.2030 | | 4.970.000 | (927) | (0,05) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,030 | 19.07.2025 | | 12.024.100 | (1.764) | (0,10) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,060 | 08.01.2030 | | 4.500.000 | (852) | (0,05) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,120 | 05.02.2030 | | 1.679.000 | (313) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,215 | 14.01.2030 | | 9.767.400 | 1.910 | 0,10 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,420 | 01.09.2030 | | 3.448.000 | 650 | 0,03 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,470 | 15.06.2028 | | 17.495.300 | 2.952 | 0,16 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,475 | 19.07.2027 | | 8.288.650 | 1.367 | 0,07 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,520 | 14.06.2028 | | 2.761.600 | 459 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,530 | 06.07.2026 | | 5.681.000 | 835 | 0,04 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,530 | 06.08.2026 | | 6.336.400 | 922 | 0,05 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,640 | 30.04.2031 | | 4.264.000 | 829 | 0,04 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,725 | 19.07.2028 | | 2.502.900 | 424 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,731 | 20.07.2028 | | 13.716.000 | 2.309 | 0,12 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,920 | 06.08.2028 | | 9.384.500 | 1.471 | 0,08 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,990 % | 06.07.2028 | CLP | 5.482.000 | $ 846 | 0,05 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 4,000 | 06.07.2028 | | 2.901.000 | 445 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 4,410 | 01.09.2030 | | 2.839.400 | 420 | 0,02 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 4,660 | 14.09.2026 | | 3.793.000 | (369) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 4,690 | 14.09.2026 | | 1.821.600 | (170) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 4,870 | 15.11.2026 | | 3.806.000 | (332) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 4,870 | 01.10.2028 | | 3.460.000 | (352) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,015 | 13.09.2028 | | 1.869.500 | (171) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,030 | 13.09.2028 | | 6.500.000 | (601) | (0,03) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,045 | 14.12.2026 | | 2.269.200 | 177 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,100 | 15.11.2031 | | 731.000 | (75) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,120 | 15.11.2031 | | 731.000 | (69) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,130 | 01.03.2025 | | 4.395.000 | 323 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,180 | 01.10.2028 | | 1.905.000 | 160 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,240 | 01.09.2030 | | 3.103.000 | 275 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,260 | 01.03.2026 | | 4.550.000 | 325 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,370 | 01.10.2028 | | 1.735.700 | 124 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,400 | 01.10.2028 | | 949.000 | 63 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,420 | 01.10.2028 | | 2.094.000 | 143 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,470 | 01.09.2030 | | 3.420.000 | 247 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,570 | 01.10.2028 | | 1.925.000 | 117 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,610 | 08.02.2027 | | 9.105.000 | (527) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,720 | 28.01.2025 | | 4.599.000 | (24) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,755 | 08.03.2032 | | 4.456.700 | (235) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,770 | 08.02.2025 | | 28.752.000 | 1.594 | 0,09 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,835 | 12.10.2031 | | 1.482.900 | (67) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,865 | 14.01.2027 | | 3.024.900 | (141) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,880 | 14.01.2025 | | 2.616.200 | (138) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,890 | 17.03.2032 | | 1.533.000 | 62 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,910 | 21.01.2027 | | 5.517.100 | (245) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,920 | 08.10.2031 | | 973.000 | (37) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,930 | 17.03.2032 | | 1.533.100 | 57 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,940 | 01.03.2025 | | 4.450.000 | (222) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,975 | 11.02.2027 | | 8.621.000 | (353) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,000 | 11.02.2027 | | 16.819.000 | (669) | (0,04) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,000 | 01.10.2028 | | 5.006.600 | (187) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,010 | 16.02.2029 | | 2.164.000 | (73) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,020 | 02.03.2029 | | 1.250.400 | (43) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,030 | 10.02.2027 | | 6.830.000 | (263) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,055 | 10.02.2027 | | 4.654.000 | (174) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,100 | 01.04.2032 | | 1.225.000 | 31 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,110 | 01.09.2030 | | 3.599.900 | (100) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,115 | 01.04.2032 | | 1.273.000 | 31 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,120 | 08.03.2027 | | 10.373.600 | 352 | 0,02 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,130 | 16.02.2027 | | 2.866.000 | (97) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,140 | 28.06.2032 | | 623.200 | (12) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,195 | 04.03.2027 | | 3.008.200 | (91) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,195 | 04.04.2028 | | 4.230.000 | (115) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,250 | 01.10.2028 | | 1.580.100 | (36) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,255 | 08.04.2032 | | 3.198.000 | 41 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,260 | 08.04.2032 | | 3.004.000 | 37 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,270 | 02.03.2027 | | 2.736.000 | (70) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,299 | 08.04.2032 | | 3.373.000 | 31 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,300 | 11.03.2027 | | 10.495.100 | 269 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,315 | 11.02.2025 | | 13.638.000 | 538 | 0,03 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,333 | 05.04.2027 | | 3.323.000 | (81) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,335 | 10.02.2025 | | 7.160.000 | 279 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,350 | 10.02.2025 | | 10.795.000 | 416 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,350 | 11.02.2025 | | 26.468.000 | 1.018 | 0,05 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,350 | 15.03.2027 | | 1.288.500 | 26 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,350 | 04.04.2027 | | 3.495.000 | (83) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,360 | 25.05.2027 | | 3.858.600 | (84) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,370 | 29.06.2029 | | 4.532.000 | (52) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,380 | 03.06.2027 | | 9.491.000 | (164) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,386 | 24.05.2027 | | 11.557.400 | (239) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,420 | 24.03.2029 | | 1.107.000 | (8) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,470 | 28.06.2027 | | 8.573.100 | (130) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,480 | 01.04.2027 | | 2.449.000 | (40) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,495 | 01.04.2027 | | 2.228.000 | (35) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,550 | 15.06.2032 | | 2.352.600 | 31 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,590 | 16.06.2032 | | 6.916.000 | 113 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,610 | 17.06.2032 | | 2.813.000 | 50 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,625 | 04.04.2025 | | 11.033.000 | 337 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,628 | 04.04.2025 | | 16.183.000 | 493 | 0,03 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,635 | 23.03.2027 | | 3.805.000 | 40 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,670 | 05.04.2025 | | 10.709.000 | 312 | 0,02 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,670 | 14.06.2030 | | 1.602.000 | 19 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,765 | 09.06.2027 | | 12.547.900 | 36 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,850 | 01.03.2026 | | 1.660.000 | (18) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,030 | 28.03.2027 | | 2.697.100 | 20 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,040 | 10.05.2027 | | 3.264.700 | (27) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,110 | 15.06.2027 | | 4.107.000 | (55) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,150 | 15.06.2027 | | 9.495.000 | (145) | (0,01) |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,160 % | 16.06.2027 | CLP | 28.123.000 | $ (433) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,160 | 22.06.2027 | | 3.224.200 | 51 | 0,00 |
| Zahlung[3] | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,214 | 21.09.2025 | | 8.657.000 | (7) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,280 | 21.03.2025 | | 33.129.000 | (381) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,325 | 23.03.2025 | | 11.983.000 | (123) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,540 | 13.06.2025 | | 6.833.300 | (11) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,550 | 13.06.2025 | | 6.855.400 | (9) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,690 | 10.05.2025 | | 9.794.000 | 7 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,970 | 28.06.2024 | | 19.895.000 | 170 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 9,540 | 13.05.2023 | | 14.427.000 | 27 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 0,650 | 31.03.2030 | CZK | 31.300 | 233 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 0,800 | 11.05.2030 | | 468.900 | 3.548 | 0,19 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 0,929 | 13.03.2030 | | 266.700 | 2.085 | 0,11 |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,477 | 04.02.2030 | | 358.600 | (3.072) | (0,17) |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,733 | 08.03.2031 | | 66.300 | (622) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,872 | 05.08.2026 | | 65.000 | (203) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,890 | 15.01.2030 | | 353.500 | (3.205) | (0,17) |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 2,000 | 20.06.2028 | | 69.000 | (466) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 2,015 | 10.08.2026 | | 267.200 | (907) | (0,05) |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 2,250 | 19.12.2023 | | 669.100 | (2.186) | (0,12) |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 2,715 | 20.10.2031 | | 546.200 | (306) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 3,490 | 18.01.2032 | | 412.200 | 2.030 | 0,11 |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 3,530 | 27.12.2026 | | 106.100 | (213) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 3,770 | 11.02.2027 | | 136.000 | (393) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 3,930 | 18.01.2027 | | 772.500 | (2.174) | (0,12) |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 4,164 | 14.03.2027 | | 628.700 | 1.455 | 0,08 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 4,220 | 14.03.2027 | | 629.100 | 1.391 | 0,07 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 4,310 | 15.03.2027 | | 103.600 | 212 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 4,320 | 15.03.2027 | | 39.100 | 79 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 4,490 | 25.03.2027 | | 157.050 | 267 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 4,560 | 25.03.2027 | | 157.050 | 247 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 4,700 | 29.03.2027 | | 188.300 | 249 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 5,606 | 28.06.2027 | | 181.200 | 34 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 6,221 | 17.06.2027 | | 354.500 | 490 | 0,03 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2027 | € | 106.200 | 5.805 | 0,31 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,700 | 11.04.2027 | | 99.000 | (4.409) | (0,24) |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 1,500 | 19.06.2024 | HUF | 8.026.600 | (2.701) | (0,15) |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 1,770 | 24.02.2026 | | 3.010.400 | (1.575) | (0,09) |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 2,420 | 02.08.2026 | | 3.964.700 | (2.167) | (0,12) |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 2,680 | 29.06.2031 | | 1.938.800 | (1.274) | (0,07) |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 4,790 | 17.01.2027 | | 7.857.000 | (2.578) | (0,14) |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 0,663 | 25.06.2027 | PLN | 21.300 | 575 | 0,03 |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 0,925 | 16.10.2030 | | 1.500 | (83) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 1,097 | 25.02.2027 | | 136.300 | (5.837) | (0,32) |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 1,163 | 03.12.2030 | | 32.800 | (1.874) | (0,10) |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 1,280 | 08.02.2031 | | 23.500 | 1.432 | 0,08 |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 1,460 | 28.05.2026 | | 44.900 | (1.897) | (0,10) |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 1,490 | 29.08.2029 | | 57.400 | 3.154 | 0,17 |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 1,930 | 05.10.2026 | | 59.500 | (2.244) | (0,12) |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 2,585 | 14.10.2029 | | 15.200 | 664 | 0,04 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 2,920 | 13.12.2031 | | 31.400 | 1.671 | 0,09 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 4,075 | 07.03.2027 | | 82.000 | 1.954 | 0,11 |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 4,135 | 08.02.2027 | | 48.000 | (1.100) | (0,06) |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 4,320 | 09.03.2027 | | 20.100 | 436 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 4,350 | 09.03.2027 | | 20.100 | 430 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 4,885 | 22.03.2027 | | 52.300 | 888 | 0,05 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 5,175 | 24.03.2027 | | 38.700 | 554 | 0,03 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 5,285 | 25.03.2027 | | 41.900 | 559 | 0,03 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 5,290 | 25.03.2027 | | 42.300 | 562 | 0,03 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 5,340 | 28.03.2027 | | 20.800 | 268 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 5,470 | 08.04.2027 | | 64.800 | 771 | 0,04 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 5,550 | 08.04.2027 | | 40.400 | 451 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 5,575 | 08.04.2027 | | 40.400 | 441 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 5,870 | 22.04.2027 | | 53.800 | 472 | 0,03 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 5,960 | 25.04.2027 | | 67.900 | 541 | 0,03 |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 5,980 | 13.04.2027 | | 58.600 | (449) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 5,985 | 13.04.2027 | | 59.400 | (453) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 6,010 | 13.04.2027 | | 59.500 | (440) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 6,210 | 26.04.2027 | | 19.800 | 112 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 6,725 | 27.06.2027 | | 17.900 | 28 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 6,755 | 10.05.2027 | | 47.000 | (54) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 6,843 | 28.06.2027 | | 52.600 | (27) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 6,940 | 09.06.2027 | | 95.100 | 42 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 7,725 | 23.06.2027 | | 43.700 | 329 | 0,02 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 4,610 | 27.06.2024 | MXN | 496.500 | (1.264) | (0,07) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 5,405 | 26.12.2030 | | 740.000 | 3.398 | 0,18 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,445 | 05.12.2030 | | 199.200 | (941) | (0,05) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,540 | 31.12.2030 | | 143.700 | (675) | (0,04) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 5,590 | 03.07.2030 | | 172.600 | 818 | 0,04 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 5,610 | 03.07.2030 | | 393.000 | 1.868 | 0,10 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,865 | 13.06.2030 | | 226.900 | (1.113) | (0,06) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,870 | 12.06.2030 | | 116.800 | (573) | (0,03) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,880 | 13.06.2030 | | 140.000 | (688) | (0,04) |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 5,893 % | 05.06.2030 | MXN | 282.900 | $ | 1.398 | 0,08 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 5,940 | 23.05.2030 | | 82.600 | | 410 | 0,02 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,980 | 12.02.2031 | | 111.200 | | (558) | (0,03) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,990 | 12.02.2031 | | 264.600 | | (1.329) | (0,07) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,040 | 02.05.2030 | | 87.300 | | 441 | 0,02 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,040 | 12.02.2031 | | 951.600 | | (4.814) | (0,26) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,060 | 16.05.2030 | | 102.300 | | 515 | 0,03 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,095 | 29.05.2030 | | 18.700 | | 95 | 0,01 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,260 | 07.06.2040 | | 139.400 | | 671 | 0,04 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,288 | 25.04.2030 | | 230.700 | | 1.199 | 0,06 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,380 | 25.02.2025 | | 89.900 | | (359) | (0,02) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,380 | 05.06.2040 | | 146.300 | | 721 | 0,04 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,430 | 04.06.2040 | | 88.600 | | 441 | 0,02 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,435 | 18.05.2040 | | 61.000 | | 305 | 0,02 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,463 | 18.05.2040 | | 76.000 | | 381 | 0,02 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,465 | 26.09.2040 | | 94.900 | | 474 | 0,03 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,480 | 28.05.2040 | | 342.800 | | 1.719 | 0,09 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,510 | 24.02.2025 | | 692.800 | | (2.817) | (0,15) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,540 | 31.05.2040 | | 240.300 | | 1.217 | 0,07 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,545 | 30.05.2040 | | 75.100 | | 381 | 0,02 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,550 | 04.04.2031 | | 160.200 | | 869 | 0,05 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,600 | 13.01.2025 | | 341.200 | | (1.389) | (0,08) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,600 | 26.02.2030 | | 41.200 | | 223 | 0,01 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,623 | 17.05.2040 | | 132.400 | | 684 | 0,04 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,630 | 31.03.2031 | | 272.600 | | 1.496 | 0,08 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,635 | 31.03.2031 | | 330.000 | | 1.812 | 0,10 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,678 | 29.05.2031 | | 445.400 | | (3.030) | (0,16) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,715 | 30.05.2031 | | 473.100 | | (3.163) | (0,17) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,755 | 29.04.2031 | | 226.900 | | 1.265 | 0,07 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,065 | 26.12.2039 | | 142.800 | | 797 | 0,04 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,070 | 27.08.2031 | | 283.800 | | 1.611 | 0,09 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,100 | 13.06.2031 | | 316.400 | | 1.975 | 0,11 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,127 | 10.08.2039 | | 204.800 | | (1.158) | (0,06) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,180 | 31.10.2039 | | 118.500 | | 675 | 0,04 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,200 | 31.10.2039 | | 102.500 | | 585 | 0,03 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,210 | 28.10.2039 | | 49.700 | | 284 | 0,02 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,253 | 28.10.2039 | | 99.600 | | 574 | 0,03 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,418 | 27.10.2031 | | 52.300 | | (242) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,525 | 26.09.2031 | | 214.200 | | (914) | (0,05) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,533 | 07.01.2027 | | 173.300 | | (478) | (0,03) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,600 | 08.10.2031 | | 66.300 | | (269) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,625 | 12.07.2039 | | 163.200 | | (995) | (0,05) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,640 | 13.07.2039 | | 117.200 | | (716) | (0,04) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,643 | 18.11.2031 | | 158.900 | | 625 | 0,03 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,650 | 24.09.2031 | | 32.600 | | (126) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,650 | 29.09.2031 | | 30.420 | | (118) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,675 | 09.06.2039 | | 438.200 | | (2.702) | (0,15) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,690 | 16.10.2031 | | 90.000 | | (338) | (0,02) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,784 | 13.11.2031 | | 445.300 | | 1.548 | 0,08 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,800 | 13.11.2031 | | 120.600 | | 413 | 0,02 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,875 | 17.02.2032 | | 189.800 | | (617) | (0,03) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,885 | 27.05.2039 | | 470.900 | | (2.983) | (0,16) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,895 | 21.02.2040 | | 200.000 | | (1.263) | (0,07) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,900 | 19.02.2032 | | 144.300 | | (458) | (0,02) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,950 | 20.02.2032 | | 151.500 | | (456) | (0,02) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,990 | 17.02.2040 | | 15.800 | | (101) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,050 | 24.02.2032 | | 237.500 | | (644) | (0,04) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,103 | 04.01.2038 | | 6.300 | | 41 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,300 | 17.02.2040 | | 123.300 | | (823) | (0,04) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,320 | 07.01.2032 | | 195.200 | | (1.308) | (0,07) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,431 | 24.05.2027 | | 575.800 | | 644 | 0,03 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,680 | 30.03.2032 | | 234.300 | | (146) | (0,01) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,750 | 05.04.2024 | | 914.300 | | 197 | 0,01 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,940 | 22.05.2024 | | 1.038.700 | | 476 | 0,03 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,975 | 03.06.2027 | | 238.800 | | 3 | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 9,060 | 18.06.2027 | | 319.300 | | (52) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 9,070 | 04.06.2026 | | 86.800 | | 2 | 0,00 |
| | | | | | | $ | (6.499) | (0,35) |
| | | | **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | **$** | **(6.596)** | **(0,36)** |

(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

### DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC USD versus INR | INR 92,600 | 16.06.2025 | 2.200 | $ 132 | $ 52 | 0,00 |
| | Put - OTC USD versus INR | 92,600 | 16.06.2025 | 2.200 | 132 | 175 | 0,01 |
| MYI | Call - OTC EUR versus CZK | CZK 26,330 | 10.05.2023 | 2.435 | 77 | 60 | 0,00 |
| | Put - OTC EUR versus CZK | 26,330 | 10.05.2023 | 2.435 | 77 | 83 | 0,01 |
| | Put - OTC EUR versus USD | $ 0,950 | 29.07.2022 | 28.961 | 60 | 5 | 0,00 |
| | Put - OTC GBP versus USD | 1,170 | 15.08.2022 | 30.379 | 314 | 180 | 0,01 |
| SOG | Call - OTC EUR versus CZK | CZK 26,000 | 08.05.2023 | 2.464 | 74 | 73 | 0,00 |
| | Put - OTC EUR versus CZK | 26,000 | 08.05.2023 | 2.464 | 70 | 63 | 0,00 |
| UAG | Call - OTC EUR versus CZK | 25,975 | 08.05.2023 | 2.464 | 75 | 74 | 0,01 |
| | Put - OTC EUR versus CZK | 25,975 | 08.05.2023 | 2.464 | 69 | 62 | 0,00 |
| | Call - OTC EUR versus CZK | 26,200 | 08.05.2023 | 2.464 | 84 | 65 | 0,00 |
| | Put - OTC EUR versus CZK | 26,200 | 08.05.2023 | 2.464 | 75 | 76 | 0,01 |
| | | | | | $ 1.239 | $ 968 | 0,05 |

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month JPY-LIBOR | Erhalt | 1,000 % | 26.04.2024 | 6.640.000 | $ 282 | $ 174 | 0,01 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | Call - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Kauf | 0,700 % | 17.08.2022 | 168.100 | $ (102) | $ (20) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,300 | 17.08.2022 | 168.100 | (143) | (268) | (0,02) |
| | | | | | | $ (245) | $ (288) | (0,02) |

### DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYI | Put - OTC GBP versus USD | $ 1,100 | 15.08.2022 | 45.569 | $ (135) | $ (46) | 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 | Brazil Government International Bond | (1,000) % | 20.12.2024 | $ 21.400 | $ (34) | $ 412 | $ 378 | 0,02 |
| BRC | Brazil Government International Bond | (1,000) | 20.06.2025 | 6.900 | 358 | (177) | 181 | 0,01 |
| | | | | | $ 324 | $ 235 | $ 559 | 0,03 |

## 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 | Montenegro Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2023 | € 800 | $ (62) | $ 38 | $ (24) | 0,00 |
| JPM | Ghana Government International Bond | 5,000 | 20.06.2024 | $ 1.400 | 3 | (467) | (464) | (0,03) |
| | | | | | $ (59) | $ (429) | $ (488) | (0,03) |

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

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

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

## CROSS-CURRENCY SWAPS

| Kontrahent | Erhalt | Zahlung | Fälligkeits-datum | | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month IDR-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR zzgl. 0,047 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 01.07.2023 | IDR | 2.226.750.000 | $ 150.000 | $ 45 | $ (528) | $ (483) | (0,03) |
| GLM | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month IDR-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR zzgl. 0,047 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 01.07.2023 | | 1.486.000.000 | 100.000 | (70) | (252) | (322) | (0,02) |
| | Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,330 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 28.05.2024 | ARS | 85.633 | 1.900 | 0 | 1.631 | 1.631 | 0,09 |
| | Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,333 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 30.05.2024 | | 214.249 | 4.820 | (15) | 4.159 | 4.144 | 0,23 |
| | Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,282 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 07.06.2027 | | 93.789 | 2.090 | (3) | 1.813 | 1.810 | 0,10 |
| | | | | | | | $ (43) | $ 6.823 | $ 6.780 | 0,37 |

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,295 % | 08.09.2025 | ILS | 89.000 | $ 0 | $ 1.773 | $ 1.773 | 0,10 |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,680 | 08.09.2030 | | 44.500 | 0 | (1.954) | (1.954) | (0,11) |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,800 | 24.04.2028 | | 153.200 | 0 | 4.431 | 4.431 | 0,24 |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 1,963 | 16.02.2028 | | 21.300 | (2) | (190) | (192) | (0,01) |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 1,998 | 20.06.2028 | | 13.700 | 0 | (155) | (155) | (0,01) |
| | Erhalt | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,197 | 18.03.2025 | KRW | 96.335.000 | 0 | 4.617 | 4.617 | 0,25 |
| | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,750 | 15.06.2025 | MYR | 159.000 | 0 | 115 | 115 | 0,01 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,000 | 15.06.2032 | THB | 314.970 | 51 | 37 | 88 | 0,01 |
| BPS | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,450 | 23.01.2025 | KRW | 101.061.200 | 0 | (4.041) | (4.041) | (0,22) |
| BRC | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,795 | 20.06.2028 | ILS | 32.000 | 0 | 965 | 965 | 0,05 |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 1,950 | 20.06.2028 | | 34.500 | 0 | (416) | (416) | (0,02) |
| BSH | Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,300 | 21.06.2029 | CLP | 3.450.000 | 0 | 738 | 738 | 0,04 |
| | Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,750 | 22.03.2026 | | 8.000.000 | 0 | (1.010) | (1.010) | (0,05) |
| | Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,790 | 14.03.2026 | | 3.885.000 | 7 | (490) | (483) | (0,03) |
| CBK | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,155 | 05.07.2022 | COP | 81.320.800 | 0 | 68 | 68 | 0,00 |
| | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,960 | 10.05.2029 | | 27.236.900 | 0 | 1.013 | 1.013 | 0,05 |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,485 | 09.08.2024 | ILS | 68.500 | 0 | 783 | 783 | 0,04 |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,950 | 23.05.2024 | | 122.500 | 0 | 1.045 | 1.045 | 0,06 |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 1,041 | 15.05.2024 | | 101.800 | 0 | (807) | (807) | (0,04) |
| | Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,763 | 24.05.2029 | CLP | 1.841.700 | 11 | (325) | (314) | (0,02) |
| | Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,770 | 19.03.2026 | | 64.800 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,500 | 15.06.2027 | THB | 207.000 | (21) | (31) | (52) | 0,00 |
| CKL | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 2,100 | 20.06.2028 | ILS | 14.000 | (46) | (90) | (136) | (0,01) |
| DUB | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,690 | 27.09.2027 | | 20.100 | 0 | 527 | 527 | 0,03 |
| GLM | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,235 | 15.01.2023 | | 198.900 | 0 | (474) | (474) | (0,03) |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,520 | 12.08.2024 | | 93.500 | 0 | 1.047 | 1.047 | 0,06 |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,540 | 11.05.2027 | | 11.600 | 0 | (318) | (318) | (0,02) |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,720 | 20.06.2028 | | 8.800 | 0 | 276 | 276 | 0,02 |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,820 | 15.01.2030 | | 43.800 | 0 | 1.661 | 1.661 | 0,09 |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,950 | 23.05.2024 | | 75.700 | 0 | 646 | 646 | 0,04 |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,960 | 24.05.2024 | | 70.700 | 0 | 600 | 600 | 0,03 |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 1,048 | 27.02.2024 | | 132.400 | 0 | (827) | (827) | (0,04) |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 1,883 | 21.03.2028 | | 28.100 | 0 | (311) | (311) | (0,02) |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 1,898 | 17.12.2025 | | 57.400 | 0 | (260) | (260) | (0,01) |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 1,971 | 16.02.2028 | | 43.600 | (3) | (385) | (388) | (0,02) |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 1,998 | 20.06.2028 | | 28.300 | 0 | (320) | (320) | (0,02) |
| | Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,990 | 01.08.2029 | CLP | 2.813.100 | 0 | (639) | (639) | (0,03) |
| | Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,015 | 20.06.2026 | | 5.555.000 | 0 | 951 | 951 | 0,05 |
| | Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,265 | 14.06.2029 | | 4.122.200 | 0 | (820) | (820) | (0,04) |
| | Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,535 | 14.11.2022 | | 3.595.100 | 0 | (106) | (106) | (0,01) |
| | Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,830 | 22.05.2029 | | 7.729.900 | 0 | (1.285) | (1.285) | (0,07) |
| | Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 4,095 | 01.06.2027 | | 12.230.000 | 0 | (1.518) | (1.518) | (0,08) |
| | Zahlung[1] | 6-Month CLP-CHILIBOR | 4,319 | 22.05.2029 | | 19.808.000 | 0 | (1.102) | (1.102) | (0,06) |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,000 | 15.06.2032 | THB | 792.400 | 223 | (1) | 222 | 0,01 |
| GST | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,250 | 15.06.2032 | | 176.600 | 41 | 123 | 164 | 0,01 |
| HUS | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 1,018 | 11.03.2024 | ILS | 82.600 | 0 | (552) | (552) | (0,03) |

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 1,018 % | 15.05.2024 | ILS | 91.500 | $ 0 | $ (737) | $ (737) | (0,04) |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 1,998 | 20.06.2028 | | 14.900 | 1 | (170) | (169) | (0,01) |
| JPM | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,475 | 09.08.2024 | | 71.500 | 0 | 823 | 823 | 0,04 |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,813 | 20.06.2028 | | 18.100 | 0 | 541 | 541 | 0,03 |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 1,027 | 19.03.2024 | | 37.000 | 0 | (253) | (253) | (0,01) |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 1,095 | 10.05.2024 | | 19.800 | 0 | (152) | (152) | (0,01) |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 2,078 | 20.06.2028 | | 12.600 | 0 | (127) | (127) | (0,01) |
| | Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,540 | 04.06.2029 | CLP | 4.115.000 | 0 | 753 | 753 | 0,04 |
| MBC | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,000 | 15.06.2032 | THB | 243.500 | 62 | 6 | 68 | 0,00 |
| MYC | Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 7,800 | 04.01.2027 | BRL | 12.200 | 17 | (196) | (179) | (0,01) |
| | Erhalt | 3-Month THB-THORON Compounded-OIS | 1,500 | 15.06.2023 | THB | 5.423.700 | (100) | 65 | (35) | 0,00 |
| | Zahlung | 3-Month THB-THORON Compounded-OIS | 2,500 | 15.06.2024 | | 2.728.100 | 298 | 187 | 485 | 0,03 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,500 | 15.06.2027 | | 198.800 | (20) | (30) | (50) | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,750 | 15.06.2032 | | 18.000 | (9) | 2 | (7) | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,000 | 15.06.2029 | | 917.500 | (101) | 374 | 273 | 0,01 |
| SCX | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,750 | 15.06.2025 | MYR | 85.160 | (56) | 117 | 61 | 0,00 |
| | | | | | | | $ 353 | $ 4.184 | $ 4.537 | 0,25 |

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

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | £ | 22.858 | $ | 27.914 | $ 154 | $ 0 | $ 154 | 0,01 |
| | 07.2022 | HUF | 1.140.946 | | 3.145 | 147 | 0 | 147 | 0,01 |
| | 07.2022 | MXN | 40.394 | | 1.967 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2.201 | CLP | 1.916.587 | 0 | (160) | (160) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 3.544 | COP | 13.555.800 | 0 | (286) | (286) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 1.156 | HUF | 440.842 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.956 | MXN | 40.410 | 43 | 0 | 43 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 18.747 | MYR | 82.511 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 26.883 | PEN | 101.195 | 163 | (450) | (287) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 501 | ZAR | 7.690 | 0 | (32) | (32) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 69.886 | $ | 74.861 | 1.610 | (22) | 1.588 | 0,09 |
| | 08.2022 | MXN | 79.566 | | 3.649 | 0 | (270) | (270) | (0,01) |
| | 08.2022 | PEN | 33.719 | | 8.804 | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 60.286 | € | 57.004 | 0 | (519) | (519) | (0,03) |
| | 08.2022 | | 150.000 | IDR | 2.226.750.000 | 0 | (1.246) | (1.246) | (0,07) |
| | 08.2022 | | 2.295 | PEN | 8.585 | 0 | (45) | (45) | 0,00 |
| | 09.2022 | EGP | 49.568 | $ | 2.550 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 09.2022 | IDR | 162.967.055 | | 11.022 | 157 | 0 | 157 | 0,01 |
| | 09.2022 | $ | 227 | PEN | 875 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 10.2022 | | 7.477 | ZAR | 116.367 | 0 | (446) | (446) | (0,02) |
| | 11.2022 | MYR | 142.460 | $ | 32.407 | 122 | 0 | 122 | 0,01 |
| | 11.2022 | ZAR | 25.657 | | 1.616 | 70 | 0 | 70 | 0,00 |
| | 12.2022 | IDR | 1.457.900.000 | | 100.000 | 3.168 | 0 | 3.168 | 0,17 |
| | 12.2022 | $ | 300.000 | IDR | 4.435.500.000 | 0 | (5.399) | (5.399) | (0,29) |
| | 12.2022 | | 4.123 | PEN | 15.755 | 0 | (38) | (38) | 0,00 |
| | 12.2022 | ZAR | 10.618 | $ | 681 | 44 | 0 | 44 | 0,00 |
| | 01.2023 | CNH | 297.323 | | 46.075 | 1.702 | 0 | 1.702 | 0,09 |
| | 01.2023 | PEN | 90.352 | | 23.785 | 417 | 0 | 417 | 0,02 |
| | 02.2023 | $ | 46.029 | CNH | 297.323 | 0 | (1.639) | (1.639) | (0,09) |
| | 04.2023 | PLN | 69.105 | € | 13.725 | 0 | (115) | (115) | (0,01) |
| | 03.2030 | $ | 12.534 | IDR | 246.110.438 | 0 | (74) | (74) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | BRL | 14.850 | $ | 3.099 | 259 | 0 | 259 | 0,01 |
| | 07.2022 | CLP | 10.294.550 | | 11.887 | 922 | 0 | 922 | 0,05 |
| | 07.2022 | CZK | 48.756 | | 2.057 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 8 | | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | HUF | 5.022.949 | | 13.179 | 2 | (24) | (22) | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 2.454.700 | | 18.267 | 199 | 0 | 199 | 0,01 |
| | 07.2022 | PLN | 120.187 | | 26.870 | 174 | 0 | 174 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 2.545 | BRL | 13.238 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 15.381 | CLP | 13.161.506 | 0 | (1.364) | (1.364) | (0,07) |
| | 07.2022 | | 2.625 | £ | 2.169 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 319 | MXN | 6.408 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 10.350 | MYR | 45.545 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 5.373 | $ | 335 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 297.323 | | 44.639 | 312 | 0 | 312 | 0,02 |
| | 08.2022 | COP | 55.321.202 | | 14.258 | 1.074 | 0 | 1.074 | 0,06 |
| | 08.2022 | € | 144 | | 152 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 60.031.675 | | 4.086 | 77 | 0 | 77 | 0,00 |
| | 08.2022 | INR | 42.672 | | 547 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 08.2022 | MXN | 312.687 | | 14.235 | 0 | (1.165) | (1.165) | (0,06) |
| | 08.2022 | THB | 1.901 | | 55 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 191.125 | | 6.507 | 68 | 0 | 68 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 7.011 | CLP | 6.108.383 | 0 | (537) | (537) | (0,03) |
| | 08.2022 | | 5.230 | IDR | 76.218.516 | 0 | (140) | (140) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 5.692 | TRY | 101.104 | 211 | 0 | 211 | 0,01 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08.2022 | $ | 264 | ZAR | 4.209 | $ 0 | $ (9) | $ (9) | 0,00 |
| | 09.2022 | CNH | 297.323 | $ | 44.888 | 567 | 0 | 567 | 0,03 |
| | 09.2022 | IDR | 349.830.975 | | 23.750 | 427 | 0 | 427 | 0,02 |
| | 09.2022 | MXN | 6.408 | | 314 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09.2022 | MYR | 22.705 | | 5.215 | 67 | 0 | 67 | 0,00 |
| | 09.2022 | TWD | 42.111 | | 1.516 | 92 | 0 | 92 | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 5.201 | CLP | 4.796.630 | 0 | (155) | (155) | (0,01) |
| | 09.2022 | | 44.530 | CNH | 297.323 | 0 | (209) | (209) | (0,01) |
| | 09.2022 | | 10.696 | IDR | 157.548.532 | 0 | (192) | (192) | (0,01) |
| | 10.2022 | CNH | 297.323 | $ | 44.798 | 472 | 0 | 472 | 0,03 |
| | 10.2022 | $ | 44.790 | CNH | 297.323 | 0 | (464) | (464) | (0,03) |
| | 10.2022 | | 3.325 | COP | 12.902.895 | 0 | (281) | (281) | (0,02) |
| | 10.2022 | | 23.533 | PEN | 96.062 | 1.511 | 0 | 1.511 | 0,08 |
| | 11.2022 | CNH | 297.323 | $ | 45.435 | 1.093 | 0 | 1.093 | 0,06 |
| | 11.2022 | MYR | 66.714 | | 15.174 | 56 | 0 | 56 | 0,00 |
| | 11.2022 | $ | 44.704 | CNH | 297.323 | 0 | (362) | (362) | (0,02) |
| | 11.2022 | | 184 | ZAR | 2.969 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 28.248 | $ | 1.773 | 71 | 0 | 71 | 0,00 |
| | 12.2022 | CNH | 297.323 | | 45.553 | 1.195 | 0 | 1.195 | 0,06 |
| | 12.2022 | TRY | 141.219 | | 10.856 | 3.690 | 0 | 3.690 | 0,20 |
| | 12.2022 | $ | 45.355 | CNH | 297.323 | 0 | (997) | (997) | (0,05) |
| | 01.2023 | | 45.468 | | 297.323 | 0 | (1.095) | (1.095) | (0,06) |
| | 05.2023 | € | 1.122 | CZK | 29.415 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | CZK | 52.096 | $ | 2.210 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 07.2022 | MYR | 82.449 | | 18.747 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2.900 | BRL | 14.225 | 0 | (180) | (180) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 40.845 | MYR | 178.963 | 0 | (208) | (208) | (0,01) |
| | 08.2022 | TRY | 53.417 | $ | 3.143 | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 4.086 | SGD | 5.642 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| | 09.2022 | MYR | 11.311 | $ | 2.564 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 1.851 | CLP | 1.683.614 | 0 | (80) | (80) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 8.854 | TRY | 157.614 | 29 | 0 | 29 | 0,00 |
| | 10.2022 | | 72 | COP | 280.080 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 12.2022 | IDR | 1.458.500.000 | $ | 100.000 | 3.129 | 0 | 3.129 | 0,17 |
| BSS | 07.2022 | CLP | 1.286.693 | | 1.549 | 176 | 0 | 176 | 0,01 |
| | 09.2022 | $ | 6.048 | CLP | 5.024.939 | 0 | (756) | (756) | (0,04) |
| CBK | 07.2022 | BRL | 13.238 | $ | 2.523 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 07.2022 | EGP | 82.750 | | 5.000 | 598 | 0 | 598 | 0,03 |
| | 07.2022 | MXN | 80.270 | | 3.960 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07.2022 | PEN | 86.023 | | 21.691 | 0 | (921) | (921) | (0,05) |
| | 07.2022 | $ | 127.663 | BRL | 619.676 | 0 | (9.165) | (9.165) | (0,49) |
| | 07.2022 | | 13.648 | CLP | 11.704.038 | 0 | (1.181) | (1.181) | (0,06) |
| | 07.2022 | | 5 | HUF | 1.762 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 923 | PEN | 3.450 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 07.2022 | VND | 82.632.940 | $ | 3.537 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 58.874 | | 3.921 | 333 | 0 | 333 | 0,02 |
| | 08.2022 | AUD | 294 | | 207 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08.2022 | ILS | 189.362 | | 57.567 | 3.420 | 0 | 3.420 | 0,18 |
| | 08.2022 | MXN | 52.706 | | 2.540 | 0 | (56) | (56) | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN | 159.770 | | 42.156 | 355 | (30) | 325 | 0,02 |
| | 08.2022 | PHP | 10.152 | | 193 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 2.504 | BRL | 13.238 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.054 | COP | 4.267.768 | 0 | (37) | (37) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 42.074 | PEN | 159.749 | 213 | (426) | (213) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 7.473 | RUB | 638.194 | 3.650 | 0 | 3.650 | 0,20 |
| | 08.2022 | | 1.256 | THB | 44.558 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08.2022 | ZAR | 63.925 | $ | 4.071 | 189 | 0 | 189 | 0,01 |
| | 09.2022 | COP | 56.539.477 | | 14.631 | 1.210 | 0 | 1.210 | 0,07 |
| | 09.2022 | $ | 6.168 | COP | 23.676.842 | 0 | (554) | (554) | (0,03) |
| | 09.2022 | | 8.423 | PEN | 32.020 | 0 | (56) | (56) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 3.287 | UYU | 133.920 | 55 | 0 | 55 | 0,00 |
| | 10.2022 | COP | 53.310.968 | $ | 12.845 | 282 | 0 | 282 | 0,02 |
| | 10.2022 | MXN | 52.906 | | 2.520 | 0 | (57) | (57) | 0,00 |
| | 10.2022 | $ | 15.570 | COP | 61.571.486 | 0 | (1.042) | (1.042) | (0,06) |
| | 11.2022 | PEN | 32.051 | $ | 8.132 | 0 | (205) | (205) | (0,01) |
| | 11.2022 | $ | 752 | PEN | 2.983 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 11.2022 | | 4.128 | PKR | 945.071 | 407 | 0 | 407 | 0,02 |
| | 12.2022 | IDR | 1.677.295.050 | $ | 115.000 | 3.596 | 0 | 3.596 | 0,19 |
| | 12.2022 | ILS | 34.002 | | 10.877 | 1.058 | 0 | 1.058 | 0,06 |
| | 12.2022 | PEN | 113.259 | | 29.100 | 0 | (234) | (234) | (0,01) |
| | 12.2022 | $ | 10.356 | PEN | 43.432 | 909 | 0 | 909 | 0,05 |
| | 12.2022 | | 3.701 | TRY | 59.156 | 0 | (699) | (699) | (0,04) |
| | 12.2022 | | 7.390 | VND | 174.949.948 | 94 | 0 | 94 | 0,01 |
| | 05.2023 | PEN | 125.393 | $ | 31.693 | 0 | (437) | (437) | (0,02) |
| | 07.2023 | $ | 4.787 | EGP | 90.000 | 0 | (668) | (668) | (0,04) |
| DUB | 07.2022 | MXN | 79.572 | $ | 4.038 | 101 | 0 | 101 | 0,01 |
| | 07.2022 | RON | 52.712 | | 11.251 | 129 | 0 | 129 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 56.147 | PLN | 244.956 | 0 | (1.736) | (1.736) | (0,09) |
| | 08.2022 | € | 105.452 | $ | 111.975 | 1.411 | 0 | 1.411 | 0,08 |
| | 08.2022 | TWD | 2.200 | | 74 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 172 | MXN | 3.438 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 35.199 | THB | 1.222.313 | 0 | (576) | (576) | (0,03) |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 09.2022 | COP | 7.995.040 | $ | 2.008 | $ 112 | $ 0 | $ 112 | 0,01 |
| | 12.2022 | $ | 676 | ZAR | 10.618 | 0 | (38) | (38) | 0,00 |
| | 02.2023 | ZAR | 111.056 | $ | 6.650 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | BRL | 596.611 | | 115.130 | 1.043 | 0 | 1.043 | 0,06 |
| | 07.2022 | CLP | 3.561.895 | | 4.128 | 334 | 0 | 334 | 0,02 |
| | 07.2022 | MYR | 45.556 | | 10.350 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07.2022 | PLN | 2.245 | | 502 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 289 | CLP | 235.940 | 0 | (38) | (38) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 105 | CZK | 2.475 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 6.939 | MXN | 139.326 | 38 | (83) | (45) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 6.344 | MYR | 27.770 | 0 | (38) | (38) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 8.488 | PEN | 31.455 | 0 | (231) | (231) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 822 | PLN | 3.647 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.034 | RON | 9.683 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 3.046 | ZAR | 49.129 | 0 | (52) | (52) | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 1.905 | $ | 118 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 12.202 | | 1.814 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 08.2022 | COP | 60.599.789 | | 14.891 | 449 | 0 | 449 | 0,02 |
| | 08.2022 | DOP | 724.275 | | 12.553 | 0 | (562) | (562) | (0,03) |
| | 08.2022 | PEN | 11.935 | | 3.186 | 57 | 0 | 57 | 0,00 |
| | 08.2022 | RUB | 990.466 | | 10.437 | 0 | (6.826) | (6.826) | (0,37) |
| | 08.2022 | TRY | 36.172 | | 2.058 | 0 | (52) | (52) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 111.482 | BRL | 582.428 | 0 | (1.068) | (1.068) | (0,06) |
| | 08.2022 | | 36.501 | CNH | 242.586 | 0 | (334) | (334) | (0,02) |
| | 08.2022 | | 100.000 | IDR | 1.486.500.000 | 0 | (697) | (697) | (0,04) |
| | 08.2022 | | 52.492 | ILS | 171.837 | 0 | (3.357) | (3.357) | (0,18) |
| | 08.2022 | | 4.239 | PEN | 15.907 | 0 | (69) | (69) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.091 | THB | 38.434 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 607 | TRY | 10.414 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | ZAR | 2.531 | $ | 163 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 09.2022 | COP | 39.434.228 | | 9.849 | 499 | 0 | 499 | 0,03 |
| | 09.2022 | EGP | 53.468 | | 2.725 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 09.2022 | IDR | 246.464.709 | | 16.671 | 239 | 0 | 239 | 0,01 |
| | 09.2022 | $ | 255 | HKD | 1.999 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 40.826 | IDR | 601.714.208 | 0 | (710) | (710) | (0,04) |
| | 09.2022 | | 153 | MXN | 3.098 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 20.459 | MYR | 90.447 | 54 | (3) | 51 | 0,00 |
| | 10.2022 | $ | 121.041 | MXN | 2.479.539 | 0 | (276) | (276) | (0,02) |
| | 10.2022 | ZAR | 116.367 | $ | 7.384 | 353 | 0 | 353 | 0,02 |
| | 11.2022 | | 27.168 | | 1.692 | 55 | 0 | 55 | 0,00 |
| | 12.2022 | IDR | 5.874.000.000 | | 400.000 | 9.858 | 0 | 9.858 | 0,53 |
| | 12.2022 | $ | 307.677 | IDR | 4.552.995.050 | 0 | (5.272) | (5.272) | (0,28) |
| | 05.2023 | ZAR | 124.117 | $ | 7.427 | 86 | 0 | 86 | 0,00 |
| HUS | 07.2022 | $ | 25.000 | EGP | 432.250 | 0 | (2.008) | (2.008) | (0,11) |
| | 07.2023 | EGP | 469.250 | $ | 25.000 | 3.521 | 0 | 3.521 | 0,19 |
| IND | 07.2022 | ZAR | 556.151 | | 36.321 | 2.433 | 0 | 2.433 | 0,13 |
| | 08.2022 | $ | 8.252 | CLP | 7.289.109 | 0 | (526) | (526) | (0,03) |
| | 08.2022 | ZAR | 4.209 | $ | 283 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| | 06.2024 | $ | 7.206 | TWD | 185.403 | 0 | (631) | (631) | (0,03) |
| JPM | 07.2022 | CLP | 40.100.419 | $ | 46.631 | 3.918 | 0 | 3.918 | 0,21 |
| | 07.2022 | EGP | 82.888 | | 4.283 | 0 | (65) | (65) | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 64.096 | | 3.209 | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 63.403 | CZK | 1.486.085 | 0 | (664) | (664) | (0,04) |
| | 07.2022 | | 211 | MXN | 4.287 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 5.404 | PEN | 19.816 | 0 | (202) | (202) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 3.538 | VND | 82.081.600 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 07.2022 | VND | 82.081.600 | $ | 3.520 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 08.2022 | KRW | 282.879 | | 222 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | PHP | 5.769 | | 109 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | SGD | 3.752 | | 2.700 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08.2022 | TRY | 52.760 | $ | 3.110 | $ 35 | $ 0 | $ 35 | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 25.637 | | 870 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 1.344 | CNH | 9.039 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 3.167 | IDR | 47.140.795 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 11.820 | PEN | 44.961 | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 33.986 | SGD | 46.734 | 0 | (403) | (403) | (0,02) |
| | 08.2022 | ZMW | 23.839 | $ | 975 | 0 | (434) | (434) | (0,02) |
| | 09.2022 | COP | 18.417.624 | | 4.777 | 410 | 0 | 410 | 0,02 |
| | 09.2022 | TWD | 49.865 | | 1.794 | 108 | 0 | 108 | 0,01 |
| | 10.2022 | COP | 41.647.430 | | 10.272 | 446 | 0 | 446 | 0,02 |
| | 10.2022 | $ | 2.174 | COP | 8.456.860 | 0 | (179) | (179) | (0,01) |
| | 11.2022 | | 1.243 | PKR | 274.703 | 78 | 0 | 78 | 0,00 |
| | 12.2022 | | 100.000 | IDR | 1.479.200.000 | 0 | (1.755) | (1.755) | (0,09) |
| | 12.2022 | | 9.537 | TRY | 162.938 | 0 | (1.270) | (1.270) | (0,07) |
| | 12.2022 | | 3.482 | VND | 82.081.600 | 29 | 0 | 29 | 0,00 |
| | 06.2023 | | 238 | | 5.712.000 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 03.2030 | IDR | 252.540.875 | $ | 12.118 | 0 | (668) | (668) | (0,04) |
| | 03.2030 | $ | 11.598 | IDR | 246.110.438 | 862 | 0 | 862 | 0,05 |
| MBC | 07.2022 | CLP | 259.361 | $ | 313 | 37 | 0 | 37 | 0,00 |
| | 07.2022 | HUF | 629.874 | | 1.688 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 6.408 | | 311 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07.2022 | PLN | 16.421 | | 3.698 | 51 | 0 | 51 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 13.631 | CLP | 11.696.153 | 0 | (1.183) | (1.183) | (0,06) |
| | 07.2022 | | 220 | ILS | 760 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 18.403 | ¥ | 2.443.500 | 0 | (417) | (417) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 3.358 | MXN | 69.087 | 60 | 0 | 60 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 4 | PLN | 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 75.735.162 | $ | 5.140 | 81 | 0 | 81 | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN | 8.603 | | 2.210 | 0 | (45) | (45) | 0,00 |
| | 08.2022 | THB | 83.746 | | 2.363 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 40.133 | CLP | 33.692.954 | 0 | (4.419) | (4.419) | (0,24) |
| | 08.2022 | | 3.062 | CNH | 20.561 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 27.039 | € | 25.561 | 10 | (253) | (243) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 4.124 | RUB | 352.272 | 2.016 | 0 | 2.016 | 0,11 |
| | 08.2022 | ZAR | 163.737 | $ | 11.001 | 1.058 | 0 | 1.058 | 0,06 |
| | 09.2022 | MYR | 19.058 | | 4.373 | 52 | 0 | 52 | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 1.990 | MXN | 40.581 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 10.2022 | COP | 23.339.444 | $ | 5.608 | 101 | 0 | 101 | 0,01 |
| | 12.2022 | TRY | 4.806 | | 238 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 05.2023 | $ | 9.495 | CNH | 63.720 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | CLP | 2.681.753 | $ | 3.080 | 221 | 0 | 221 | 0,01 |
| | 07.2022 | COP | 13.555.800 | | 3.392 | 135 | 0 | 135 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 1.742 | CLP | 1.546.053 | 0 | (92) | (92) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 429 | ZAR | 6.847 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 34.593 | $ | 2.153 | 45 | 0 | 45 | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 4.579 | | 4.897 | 96 | 0 | 96 | 0,01 |
| | 08.2022 | INR | 71.670 | | 917 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 08.2022 | KRW | 366.131 | | 287 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08.2022 | TRY | 90.154 | | 5.414 | 169 | (15) | 154 | 0,01 |
| | 08.2022 | TWD | 7.624 | | 259 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 5.553 | CNY | 37.278 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 3.363 | COP | 13.555.800 | 0 | (134) | (134) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 77.471 | THB | 2.670.661 | 0 | (1.823) | (1.823) | (0,10) |
| | 08.2022 | | 10.216 | ZAR | 163.737 | 0 | (273) | (273) | (0,01) |
| | 09.2022 | CLP | 3.215.637 | $ | 3.657 | 274 | 0 | 274 | 0,01 |
| | 09.2022 | MYR | 917 | | 208 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | TRY | 51.207 | | 2.882 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 09.2022 | TWD | 20.355 | | 729 | 41 | 0 | 41 | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 15.279 | MYR | 67.145 | 0 | (53) | (53) | 0,00 |
| | 10.2022 | COP | 7.456.220 | $ | 1.796 | 37 | 0 | 37 | 0,00 |
| | 10.2022 | $ | 141 | COP | 546.093 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 12.2022 | TRY | 126.489 | $ | 10.011 | 3.592 | 0 | 3.592 | 0,19 |
| | 05.2023 | CZK | 11.554 | € | 438 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| RBC | 08.2022 | $ | 5.030 | BRL | 26.545 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 425 | MXN | 8.768 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 09.2022 | ZAR | 9.683 | $ | 627 | 40 | 0 | 40 | 0,00 |
| | 10.2022 | MXN | 234.728 | | 11.717 | 284 | 0 | 284 | 0,02 |
| | 10.2022 | $ | 39.087 | MXN | 782.881 | 0 | (957) | (957) | (0,05) |
| RYL | 07.2022 | CLP | 1.916.412 | $ | 2.175 | 134 | 0 | 134 | 0,01 |
| | 08.2022 | NOK | 36.640 | | 3.695 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | BRL | 11.267 | | 2.189 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| | 07.2022 | ILS | 19.037 | | 5.647 | 209 | 0 | 209 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 4.069 | CLP | 3.324.292 | 0 | (528) | (528) | (0,03) |
| | 07.2022 | | 0 | COP | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.019 | PEN | 3.850 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 3.571 | VND | 82.632.940 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 16.214 | $ | 17.393 | 393 | 0 | 393 | 0,02 |
| | 08.2022 | $ | 1.183 | CHF | 1.182 | 55 | 0 | 55 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 13.601 | CNH | 91.210 | 5 | (7) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 8.916 | CNY | 59.670 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 345 | IDR | 5.035.377 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 21.562 | NOK | 214.165 | 133 | 0 | 133 | 0,01 |
| | 08.2022 | | 5.905 | THB | 204.397 | 0 | (115) | (115) | (0,01) |
| | 09.2022 | COP | 27.235.035 | $ | 6.780 | 322 | 0 | 322 | 0,02 |
| | 09.2022 | MYR | 14.508 | | 3.321 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 13.363 | MYR | 56.272 | 0 | (604) | (604) | (0,03) |
| | 09.2022 | | 626 | ZAR | 9.683 | 0 | (39) | (39) | 0,00 |
| | 11.2022 | COP | 41.698.718 | $ | 9.811 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 11.2022 | $ | 2.492 | PEN | 10.319 | 188 | 0 | 188 | 0,01 |
| | 11.2022 | | 1.587 | PKR | 346.385 | 78 | 0 | 78 | 0,00 |
| | 12.2022 | | 3.627 | VND | 86.001.361 | 52 | 0 | 52 | 0,00 |
| | 04.2023 | KES | 101.841 | $ | 764 | 0 | (65) | (65) | 0,00 |
| | 03.2030 | IDR | 239.680.000 | | 10.700 | 0 | (1.435) | (1.435) | (0,08) |
| SOG | 07.2022 | $ | 25.179 | £ | 20.689 | 0 | (53) | (53) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 126 | HUF | 46.928 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | £ | 20.689 | $ | 25.190 | 52 | 0 | 52 | 0,00 |
| | 03.2023 | KES | 79.902 | | 617 | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| | 05.2023 | CZK | 19.582 | € | 752 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | HUF | 4.775.205 | $ | 12.950 | 401 | 0 | 401 | 0,02 |
| | 07.2022 | ILS | 24 | | 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 43 | € | 41 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | BRL | 11.172 | $ | 2.311 | 175 | 0 | 175 | 0,01 |
| | 07.2022 | ILS | 427 | | 124 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 3.394 | | 173 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07.2022 | $ | 2.943 | CLP | 2.492.564 | $ 0 | $ (286) | $ (286) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 67.614 | HUF | 23.712.994 | 0 | (5.294) | (5.294) | (0,29) |
| | 07.2022 | | 274 | ILS | 945 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 3.635 | MXN | 71.901 | 2 | (79) | (77) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 5.447 | ZAR | 87.691 | 0 | (104) | (104) | (0,01) |
| | 07.2022 | ZAR | 2.294 | $ | 143 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | CLP | 20.653.255 | | 23.624 | 1.784 | 0 | 1.784 | 0,10 |
| | 08.2022 | PEN | 5.572 | | 1.454 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 08.2022 | PHP | 906.682 | | 17.283 | 832 | 0 | 832 | 0,04 |
| | 08.2022 | TRY | 113.559 | | 6.941 | 314 | 0 | 314 | 0,02 |
| | 08.2022 | $ | 657 | TRY | 11.285 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 09.2022 | CLP | 585.621 | $ | 631 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 09.2022 | MXN | 661.290 | | 33.187 | 797 | 0 | 797 | 0,04 |
| | 09.2022 | TRY | 326.888 | | 18.465 | 186 | (159) | 27 | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 12.039 | CLP | 10.009.611 | 0 | (1.497) | (1.497) | (0,08) |
| | 09.2022 | | 11.919 | MXN | 244.880 | 59 | 0 | 59 | 0,00 |
| | 10.2022 | | 3.550 | ZAR | 52.495 | 0 | (378) | (378) | (0,02) |
| | 10.2022 | ZAR | 52.495 | $ | 3.505 | 333 | 0 | 333 | 0,02 |
| | 11.2022 | $ | 8.854 | ZAR | 138.170 | 0 | (527) | (527) | (0,03) |
| | 11.2022 | ZAR | 196.828 | $ | 12.200 | 342 | 0 | 342 | 0,02 |
| | 12.2022 | TRY | 18.313 | | 826 | 0 | (107) | (107) | (0,01) |
| | 12.2022 | $ | 3.073 | TRY | 49.423 | 0 | (565) | (565) | (0,03) |
| | 01.2023 | | 5.652 | TWD | 146.785 | 0 | (629) | (629) | (0,03) |
| | 02.2023 | CNH | 297.323 | $ | 46.242 | 1.852 | 0 | 1.852 | 0,10 |
| | 05.2023 | € | 68 | CZK | 1.795 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | | | $ 84.316 | $ (88.177) | $ (3.861) | (0,21) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 8.335** | **0,45** |
| **Summe Anlagen** | **$ 1.823.423** | **98,41** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ 29.460** | **1,59** |
| **Nettovermögen** | **$ 1.852.883** | **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**

**^** **Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a)** **Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

**(b)** **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

**(c)** **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

**(d)** **Nullkuponwertpapier.**

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

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

**(g)** **Mit dem Fonds verbunden.**

**(h)** **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(i)** **Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|
| Constellation Oil Services Holding S.A. | 10.06.2022 | $ 41 | $ 41 | 0,00 |
| Development Bank of Southern Africa 8,600 % fällig am 21.10.2024 | 07.10.2021 | 14.861 | 13.261 | 0,71 |
| Flourish Century 6,600 % fällig am 04.02.2049 | 25.08.2021 | 2.759 | 308 | 0,02 |
| JPMorgan Structured Products BV 12,000 % fällig am 28.08.2026 | 15.06.2021 | 1.638 | 2.494 | 0,14 |
| JPMorgan Structured Products BV 12,000 % fällig am 04.01.2027 | 15.06.2021 | 1.401 | 2.070 | 0,11 |
| JPMorgan Structured Products BV 14,000 % fällig am 09.12.2031 | 24.05.2021 | 1.360 | 2.066 | 0,11 |
| | | $ 22.060 | $ 20.240 | 1,09 |

**(j)** **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurde zum 30. Juni 2022 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von USD 857 und Barmittel in Höhe von USD 9.653 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von USD 19.742 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)[3] | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 1.498.316 | $ 156.673 | $ 1.654.989 |
| Investmentfonds | 166.507 | 0 | 0 | 166.507 |
| Finanzderivate[4] | 0 | 1.951 | (24) | 1.927 |
| **Summen** | **$ 166.507** | **$ 1.500.267** | **$ 156.649** | **$ 1.823.423** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 2.063.357 | $ 260.952 | $ 2.324.309 |
| Investmentfonds | 171.278 | 0 | 0 | 171.278 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 591 | 0 | 591 |
| Finanzderivate[4] | 0 | 26.571 | (49) | 26.522 |
| **Summen** | **$ 171.278** | **$ 2.090.519** | **$ 260.903** | **$ 2.522.700** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

(3) Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022 sind keine Angaben enthalten, da der Gesamtmarktwert der Wertpapiere der Stufe 3 unter 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds liegt.

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

Es folgt eine Zusammenfassung der wesentlichen nicht beobachtbaren Inputfaktoren, die bei der marktgerechten Bewertung der in Stufe 3 der Zeitwerthierarchie eingeordneten Vermögenswerte und Verbindlichkeiten verwendet wurden:

| Kategorie und Unterkategorie | Marktwert zum 31. Dez. 2021 | Bewertungstechnik | nicht beobachtbare Daten | Eingangswert(e) (% Sofern nicht anders angegeben) |
|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere** | | | | |
| Stammaktien | $ 0 | Indikative Marktquotierung | Broker-Quotierung | $ 0,00 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 17.225 | Indikative Marktquotierung | Broker-Quotierung | $ 6,25-74,36 |
| | 8.338 | Referenzinstrument | Gewichtet durchschnittlich | BRL 50,47 |
| | 215.282 | Referenzinstrument | Rendite | 5,52-6,66 |
| | 34 | Proxy Pricing | Basispreis | $ 0,15 |
| | — | Proxy Pricing | Basispreis | $ 0,00 |
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 20.073 | Indikative Marktquotierung | Broker-Quotierung | $ 112,01-113,72 |
| Credit Default Swaps – Schutzverkauf | (49) | Indikative Marktquotierung | Broker-Quotierung | $ (0,44)-(5,24) |
| **Summen** | **$ 260.903** | | | |

Die folgende Tabelle zeigt die Sensitivität der Änderungen des Marktwerts der als Anlagen der Stufe 3 eingestuften Wertpapieranlagen gegenüber einer nach vernünftigem Ermessen möglichen Änderung des Marktwerts, sollte sich der Markt um 10 % nach oben oder unten bewegt haben, unter der Annahme, dass alle anderen Variablen konstant bleiben:

| Kategorie und Unterkategorie | 31. Dez. 2021 Sensitivität gegenüber Änderungen des Marktwerts der Anlagen Zunahme/(Abnahme) |
|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere** | |
| Stammaktien | $ 0 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 24.088 |
| Gewerbeimmobilien-Aktien | 2.007 |
| Credit Default Swaps – Schutzverkauf | (5) |
| **Summen** | **$ 26.090** |

| Level 3 Roll-forward | 31. Dez. 2021 |
|---|---|
| Marktwert zu Beginn des Geschäftsjahrs | $ 289.170 |
| Käufe während des Geschäftsjahres | 57.544 |
| Verkäufe während des Geschäftsjahres | (23.163) |
| Übertragungen in | — |
| Übertragungen aus | (38.524) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) | (1.013) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) | (23.111) |
| **Marktwert zum Ende des Geschäftsjahrs** | **$ 260.903** |

**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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 5.435 | $ (9.210) | $ (3.775) |
| BPS | 1.887 | (1.570) | 317 |
| BRC | 3.448 | (2.730) | 718 |
| BSH | (755) | 0 | (755) |
| BSS | (580) | 1.230 | 650 |
| CBK | 2.502 | 485 | 2.987 |
| CKL | (136) | 0 | (136) |
| DUB | (51) | 0 | (51) |
| GLM | (2.316) | 1.530 | (786) |
| GST | (124) | 260 | 136 |
| HUS | 55 | 340 | 395 |
| IND | 1.303 | (1.190) | 113 |
| JPM | 1.359 | (1.390) | (31) |
| MBC | 2,750 | 2.120 | 630 |

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| MYC | $ 487 | $ (914) | $ (427) |
| MYI | 2.495 | (3.020) | (525) |
| RBC | (624) | 600 | (24) |
| RYL | 117 | 0 | 117 |
| SCX | (1.263) | 1.525 | 262 |
| SOG | 100 | (40) | 60 |
| TOR | 401 | (470) | (69) |
| UAG | (2.655) | 2.420 | (235) |

[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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 62,77 | 73,96 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 23,32 | 32,81 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 3,23 | 1,27 |
| Investmentfonds | 8,99 | 7,96 |
| Pensionsgeschäfte | k. A. | 0,03 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,01 | k. A. |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,36) | (0,41) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,45 | 1,65 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | k. A. | (17,42) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Argentinien | 0,14 | 0,20 |
| Aserbaidschan | 0,23 | k. A. |
| Bahamas | 0,13 | k. A. |
| Brasilien | 4,69 | 4,08 |
| Cayman-Inseln | 1,03 | 0,50 |
| Chile | 0,75 | 4,74 |
| China | 6,16 | 14,54 |
| Kolumbien | 8,86 | 6,44 |
| Tschechische Republik | 1,21 | 2,23 |
| Dänemark | 0,00 | 0,23 |
| Dominikanische Republik | 0,94 | 0,87 |
| Ägypten | k. A. | 2,32 |
| Frankreich | 0,06 | 1,37 |
| Deutschland | k. A. | 2,23 |
| Ungarn | 0,54 | 1,08 |
| Indien | k. A. | 0,25 |
| Indonesien | 5,45 | 1,44 |
| Irland | 1,26 | 1,49 |
| Israel | k. A. | 0,47 |
| Italien | k. A. | 0,29 |
| Elfenbeinküste | 0,43 | 0,42 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,49 | k. A. |
| Kasachstan | 0,26 | 0,26 |
| Luxemburg | 0,01 | 0,01 |
| Malaysia | 5,52 | 8,39 |
| Mexiko | 4,05 | 3,56 |
| Marokko | 0,02 | k. A. |
| Niederlande | 0,29 | 0,35 |
| Nigeria | 0,22 | 0,24 |
| Peru | 3,18 | 3,41 |
| Philippinen | 0,96 | 0,90 |
| Polen | 3,88 | 1,81 |
| Katar | 4,17 | 5,22 |
| Rumänien | 3,52 | 3,08 |
| Russland | 0,95 | 5,87 |
| Serbien | 0,28 | 0,33 |
| Singapur | k. A. | 1,63 |
| Südafrika | 13,66 | 12,47 |
| Südkorea | 0,03 | 0,02 |
| Spanien | 0,02 | 0,03 |
| Supranational | 0,43 | 0,47 |
| Schweiz | 0,27 | 0,26 |
| Tansania | 0,68 | 0,64 |
| Thailand | 3,62 | 5,88 |
| Türkei | 0,53 | 1,33 |
| Uganda | 0,14 | k. A. |
| Ukraine | 0,13 | 0,22 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 1,91 | 1,25 |
| Großbritannien | 0,22 | 0,27 |
| USA | 3,53 | 3,93 |
| Sambia | k. A. | 0,16 |
| Kurzfristige Instrumente | 4,47 | 0,86 |
| Investmentfonds | 8,99 | 7,96 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Pensionsgeschäfte | k. A. | 0,03 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,01 | k. A. |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,00 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,01) | 0,00 |
| Zinsswaps | (0,35) | (0,41) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Devisenoptionen | 0,05 | 0,10 |
| Zinsswapoptionen | 0,01 | k. A. |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,02) | k. A. |
| Devisenoptionen | 0,00 | (0,01) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf | 0,03 | 0,02 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,03) | (0,01) |
| Cross-Currency Swaps | 0,37 | 0,33 |
| Zinsswaps | 0,25 | 0,30 |
| Volatilitätsswaps | k. A. | 0,01 |
| Devisenterminkontrakte | (0,21) | 0,91 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 1,59 | (17,27) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **ANGOLA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Angolan Government International Bond** | | | | |
| 8,750 % fällig am 14.04.2032 | $ | 300 | $ 241 | 0,01 |
| 9,125 % fällig am 26.11.2049 | | 11.800 | 8.395 | 0,26 |
| Summe Angola | | | 8.636 | 0,27 |
| **ARGENTINIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 09.07.2030 | | 37.400 | 8.265 | 0,26 |
| 1,000 % fällig am 09.07.2029 | | 6.437 | 1.518 | 0,05 |
| 1,125 % fällig am 09.07.2035 | | 109.867 | 23.237 | 0,72 |
| 2,000 % fällig am 09.01.2038 | | 26.056 | 7.621 | 0,24 |
| 2,500 % fällig am 09.07.2041 | | 24.055 | 6.254 | 0,19 |
| **Provincia de Buenos Aires** | | | | |
| 3,900 % fällig am 01.09.2037 | | 3.800 | 1.173 | 0,04 |
| **Provincia de Cordoba** | | | | |
| 6,875 % fällig am 10.12.2025 ^ | | 2.290 | 1.755 | 0,05 |
| **Provincia de Entre Rios Argentina** | | | | |
| 5,000 % fällig am 08.08.2028 ^ | | 2.372 | 1.637 | 0,05 |
| **Provincia de la Rioja** | | | | |
| 4,750 % fällig am 24.02.2028 ^ | | 6.321 | 3.855 | 0,12 |
| **Provincia de Neuquen** | | | | |
| 4,625 % fällig am 27.04.2030 ^ | | 2.210 | 1.326 | 0,04 |
| Summe Argentinien | | | 56.641 | 1,76 |
| **ASERBAIDSCHAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Southern Gas Corridor CJSC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 24.03.2026 | | 34.100 | 33.561 | 1,04 |
| **State Oil Co. of the Azerbaijan Republic** | | | | |
| 4,750 % fällig am 13.03.2023 | | 700 | 698 | 0,02 |
| **Steas Funding DAC** | | | | |
| 7,230 % fällig am 17.03.2026 | | 12.500 | 11.719 | 0,37 |
| | | | 45.978 | 1,43 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Azerbaijan Government International Bond** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.09.2032 | | 700 | 560 | 0,02 |
| 4,750 % fällig am 18.03.2024 | | 4.400 | 4.347 | 0,13 |
| | | | 4.907 | 0,15 |
| Summe Aserbaidschan | | | 50.885 | 1,58 |
| **BAHAMAS** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Bahamas Government International Bond** | | | | |
| 6,000 % fällig am 21.11.2028 | | 12.500 | 8.886 | 0,28 |
| **BAHRAIN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Bahrain Government International Bond** | | | | |
| 4,250 % fällig am 25.01.2028 | | 12.200 | 10.980 | 0,34 |
| 5,625 % fällig am 30.09.2031 | | 4.600 | 3.976 | 0,12 |
| 6,125 % fällig am 05.07.2022 | | 6.100 | 6.108 | 0,19 |
| Summe Bahrain | | | 21.064 | 0,65 |
| **WEISSRUSSLAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Belarus Government International Bond** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.02.2026 | | 1.072 | 166 | 0,01 |
| 7,625 % fällig am 29.06.2027 | | 800 | 124 | 0,00 |
| Summe Belarus | | | 290 | 0,01 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco BTG Pactual S.A.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 10.01.2025 | | 5.800 | 5.594 | 0,17 |
| **Banco do Brasil S.A.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 30.09.2026 | | 12.700 | 11.495 | 0,36 |
| 3,875 % fällig am 10.10.2022 | | 452 | 453 | 0,01 |
| **Banco Votorantim S.A.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 24.09.2022 | $ | 600 | $ 600 | 0,02 |
| 4,500 % fällig am 24.09.2024 | | 1.100 | 1.089 | 0,03 |
| **Brazil Minas SPE Via State of Minas Gerais** | | | | |
| 5,333 % fällig am 15.02.2028 | | 26.334 | 25.854 | 0,81 |
| **BRF S.A.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 21.09.2050 | | 11.300 | 7.541 | 0,24 |
| **Centrais Eletricas Brasileiras S.A.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 04.02.2030 | | 3.200 | 2.716 | 0,09 |
| **CSN Inova Ventures** | | | | |
| 6,750 % fällig am 28.01.2028 | | 20.300 | 17.741 | 0,55 |
| **Globo Comunicacao e Participacoes S.A.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 22.01.2030 | | 1.100 | 862 | 0,03 |
| **Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.08.2022 (c)(e) | | 14.563 | 62 | 0,00 |
| **Vale Overseas Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 21.11.2036 | | 980 | 1.054 | 0,03 |
| **Vale S.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 29.12.2049 (e) | BRL | 188.860 | 15.195 | 0,47 |
| | | | 90.256 | 2,81 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Brazil Government International Bond** | | | | |
| 4,750 % fällig am 14.01.2050 | $ | 9.329 | 6.349 | 0,20 |
| Summe Brasilien | | | 96.605 | 3,01 |
| **KAMERUN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Republic of Cameroon Government International Bond** | | | | |
| 5,950 % fällig am 07.07.2032 | € | 7.600 | 5.921 | 0,18 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AAC Technologies Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 02.06.2026 | $ | 4.600 | 3.951 | 0,12 |
| **Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 05.06.2034 (c) | | 13.387 | 8.500 | 0,27 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 12.07.2026 | | 500 | 235 | 0,01 |
| 3,125 % fällig am 22.10.2025 | | 400 | 197 | 0,01 |
| 5,400 % fällig am 27.05.2025 | | 1.300 | 705 | 0,02 |
| 6,150 % fällig am 17.09.2025 | | 900 | 486 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 08.04.2024 | | 600 | 361 | 0,01 |
| **Fab Sukuk Co. Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 05.03.2023 | | 1.700 | 1.704 | 0,05 |
| **Geely Automobile Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 09.12.2024 (e) | | 2.200 | 2.087 | 0,07 |
| **HPHT Finance Ltd.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 19.03.2026 | | 9.200 | 8.527 | 0,27 |
| **ICD Funding Ltd.** | | | | |
| 3,223 % fällig am 28.04.2026 | | 1.830 | 1.727 | 0,05 |
| **ICD Sukuk Co. Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.02.2027 | | 2.200 | 2.217 | 0,07 |
| **Interoceanica Finance Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 30.11.2025 (c) | | 121 | 107 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 30.11.2025 (c) | | 862 | 761 | 0,02 |
| 0,000 % fällig am 15.05.2030 (c) | | 421 | 334 | 0,01 |
| 0,000 % fällig am 15.05.2030 (c) | | 7.077 | 5.626 | 0,18 |
| **Kaisa Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 30.06.2049 ^ | | 600 | 84 | 0,00 |
| 9,375 % fällig am 30.06.2024 ^ | | 4.100 | 572 | 0,02 |
| 9,750 % fällig am 28.09.2023 ^ | | 3.200 | 444 | 0,01 |
| 11,250 % fällig am 09.04.2022 ^ | | 1.100 | 154 | 0,01 |
| 11,500 % fällig am 30.01.2023 ^ | | 200 | 28 | 0,00 |
| 11,700 % fällig am 11.11.2025 ^ | | 3.300 | 460 | 0,01 |
| 11,950 % fällig am 12.11.2023 ^ | | 2.600 | 363 | 0,01 |
| **Lima Metro Line Finance Ltd.** | | | | |
| 4,350 % fällig am 05.04.2036 | | 381 | 343 | 0,01 |
| 5,875 % fällig am 05.07.2034 | | 1.100 | 1.087 | 0,03 |
| **MAF Sukuk Ltd.** | | | | |
| 4,638 % fällig am 14.05.2029 | | 15.000 | 15.072 | 0,47 |
| **Melco Resorts Finance Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 26.04.2026 | | 750 | 530 | 0,02 |
| 5,750 % fällig am 21.07.2028 | | 7.200 | 4.644 | 0,14 |
| **MGM China Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.02.2027 | $ | 7.200 | $ 5.098 | 0,16 |
| 5,875 % fällig am 15.05.2026 | | 6.000 | 4.545 | 0,14 |
| **New Metro Global Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 02.05.2026 | | 3.400 | 1.573 | 0,05 |
| 6,800 % fällig am 05.08.2023 | | 200 | 137 | 0,00 |
| **Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar und 1,000 % PIK)** | | | | |
| 7,350 % fällig am 01.12.2026 (a)^ | | 12.801 | 7.898 | 0,25 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | | |
| 6,720 % fällig am 01.12.2022 ^ | | 952 | 919 | 0,03 |
| **Poinsettia Finance Ltd.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 17.06.2031 | | 12.947 | 11.748 | 0,37 |
| **S.A. Global Sukuk Ltd.** | | | | |
| 1,602 % fällig am 17.06.2026 | | 9.200 | 8.402 | 0,26 |
| 2,694 % fällig am 17.06.2031 | | 4.400 | 3.876 | 0,12 |
| 2,694 % fällig am 17.06.2031 (i) | | 4.600 | 4.052 | 0,13 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028 | | 5.400 | 4.172 | 0,13 |
| **Seazen Group Ltd.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 13.07.2025 (i) | | 3.500 | 2.055 | 0,06 |
| **SPARC EM SPC Panama Metro Line SP** | | | | |
| 0,000 % fällig am 05.12.2022 (c) | | 1.079 | 1.060 | 0,03 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 10.01.2025 ^ | | 8.500 | 1.275 | 0,04 |
| 7,000 % fällig am 09.07.2025 ^ | | 4.700 | 705 | 0,02 |
| 7,250 % fällig am 14.06.2022 ^ | | 900 | 137 | 0,00 |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,840 % fällig am 22.04.2051 | | 200 | 156 | 0,01 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2026 | | 1.000 | 694 | 0,02 |
| **Zhongsheng Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 13.01.2026 | | 3.900 | 3.636 | 0,11 |
| Summe Cayman Inseln | | | 123.444 | 3,84 |
| **CHILE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco del Estado de Chile** | | | | |
| 2,704 % fällig am 09.01.2025 | | 4.300 | 4.078 | 0,13 |
| **Banco Santander Chile** | | | | |
| 2,700 % fällig am 10.01.2025 | | 5.200 | 4.984 | 0,15 |
| **Corp. Nacional del Cobre de Chile** | | | | |
| 3,150 % fällig am 14.01.2030 | | 2.700 | 2.361 | 0,07 |
| 3,625 % fällig am 01.08.2027 | | 8.800 | 8.346 | 0,26 |
| 3,700 % fällig am 30.01.2050 | | 3.700 | 2.766 | 0,09 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2047 | | 1.200 | 1.023 | 0,03 |
| 4,875 % fällig am 04.11.2044 (i) | | 5.600 | 4.980 | 0,15 |
| 6,150 % fällig am 24.10.2036 | | 1.000 | 1.034 | 0,03 |
| **Embotelladora Andina S.A.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 21.01.2050 | | 3.900 | 2.977 | 0,09 |
| **Empresa de los Ferrocarriles del Estado** | | | | |
| 3,068 % fällig am 18.08.2050 | | 1.500 | 906 | 0,03 |
| 3,830 % fällig am 14.09.2061 | | 7.000 | 4.859 | 0,15 |
| **Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A.** | | | | |
| 3,650 % fällig am 07.05.2030 | | 1.600 | 1.442 | 0,04 |
| **Empresa Nacional del Petroleo** | | | | |
| 3,450 % fällig am 16.09.2031 | | 7.400 | 5.990 | 0,19 |
| **GNL Quintero S.A.** | | | | |
| 4,634 % fällig am 31.07.2029 | | 8.206 | 7.894 | 0,25 |
| **Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 07.05.2029 | | 8.600 | 8.217 | 0,26 |
| | | | 61.857 | 1,92 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Chile Government International Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.01.2027 (i) | | 13.400 | 12.539 | 0,39 |
| 3,250 % fällig am 21.09.2071 | | 14.200 | 9.537 | 0,30 |
| 3,500 % fällig am 31.01.2034 (i) | | 11.300 | 10.074 | 0,31 |
| 3,625 % fällig am 30.10.2042 | | 2.000 | 1.609 | 0,05 |
| 4,340 % fällig am 07.03.2042 | | 11.800 | 10.527 | 0,33 |
| | | | 44.286 | 1,38 |
| Summe Chile | | | 106.143 | 3,30 |
| **CHINA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Chalco Hong Kong Investment Co. Ltd.** | | | | |
| 2,100 % fällig am 28.07.2026 | | 16.000 | 14.759 | 0,46 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **China Huadian Overseas Development Ltd.** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 23.06.2025 (e) | $ | 6.200 | $ | 6.030 | 0,19 |
| **Rongshi International Finance Ltd.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 04.05.2027 | | 2.400 | | 2.372 | 0,07 |
| **SPIC MTN Co. Ltd.** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 27.07.2025 | | 7.400 | | 6.929 | 0,22 |
| **Yango Justice International Ltd.** | | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.04.2024 ^ | | 4.700 | | 378 | 0,01 |
| **ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd.** | | | | | |
| 3,125 % fällig am 16.07.2025 | | 11.600 | | 10.618 | 0,33 |
| | | | | 41.086 | 1,28 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Export-Import Bank of China** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 28.11.2047 | | 7.100 | | 6.797 | 0,21 |
| Summe China | | | | 47.883 | 1,49 |
| **KOLUMBIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Ecopetrol S.A.** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 16.01.2025 | | 600 | | 557 | 0,02 |
| 4,625 % fällig am 02.11.2031 | | 9.800 | | 7.448 | 0,23 |
| 5,375 % fällig am 26.06.2026 | | 2.200 | | 2.041 | 0,06 |
| 5,875 % fällig am 18.09.2023 | | 900 | | 904 | 0,03 |
| 5,875 % fällig am 28.05.2045 | | 3.100 | | 2.116 | 0,06 |
| 6,875 % fällig am 29.04.2030 | | 200 | | 177 | 0,01 |
| 7,375 % fällig am 18.09.2043 | | 2.400 | | 1.962 | 0,06 |
| | | | | 15.205 | 0,47 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Colombia Government International Bond** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 30.01.2030 | | 2.500 | | 1.907 | 0,06 |
| 3,125 % fällig am 15.04.2031 (i) | | 23.607 | | 17.447 | 0,54 |
| 3,875 % fällig am 15.02.2061 | | 13.000 | | 7.506 | 0,24 |
| 4,000 % fällig am 26.02.2024 | | 12.900 | | 12.564 | 0,39 |
| 4,125 % fällig am 15.05.2051 | | 17.200 | | 10.345 | 0,32 |
| 4,500 % fällig am 15.03.2029 | | 1.400 | | 1.212 | 0,04 |
| 5,000 % fällig am 15.06.2045 | | 3.400 | | 2.285 | 0,07 |
| 5,200 % fällig am 15.05.2049 (i) | | 12.700 | | 8.646 | 0,27 |
| 5,625 % fällig am 26.02.2044 | | 4.800 | | 3.465 | 0,11 |
| 6,125 % fällig am 18.01.2041 | | 7.895 | | 6.212 | 0,19 |
| 7,375 % fällig am 18.09.2037 | | 1.400 | | 1.299 | 0,04 |
| 8,125 % fällig am 21.05.2024 | | 500 | | 520 | 0,02 |
| | | | | 73.408 | 2,29 |
| Summe Kolumbien | | | | 88.613 | 2,76 |
| **COSTA RICA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Instituto Costarricense de Electricidad** | | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.05.2043 | | 2.200 | | 1.629 | 0,05 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Costa Rica Government International Bond** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 26.01.2023 | | 6.300 | | 6.283 | 0,20 |
| 4,375 % fällig am 30.04.2025 | | 2.000 | | 1.937 | 0,06 |
| 5,625 % fällig am 30.04.2043 | | 3.300 | | 2.484 | 0,08 |
| 7,158 % fällig am 12.03.2045 | | 1.177 | | 1.028 | 0,03 |
| | | | | 11.732 | 0,37 |
| Summe Costa Rica | | | | 13.361 | 0,42 |
| **DOMINIKANISCHE REPUBLIK** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Dominican Republic Government International Bond** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 23.09.2032 | | 7.300 | | 5.635 | 0,17 |
| 5,300 % fällig am 21.01.2041 | | 6.100 | | 4.248 | 0,13 |
| 5,500 % fällig am 27.01.2025 | | 9.600 | | 9.554 | 0,30 |
| 5,500 % fällig am 22.02.2029 | | 10.600 | | 9.254 | 0,29 |
| 5,875 % fällig am 30.01.2060 | | 4.550 | | 3.125 | 0,10 |
| 5,950 % fällig am 25.01.2027 | | 17.700 | | 16.941 | 0,53 |
| 6,000 % fällig am 19.07.2028 | | 12.400 | | 11.564 | 0,36 |
| 6,000 % fällig am 22.02.2033 | | 7.300 | | 6.099 | 0,19 |
| 6,400 % fällig am 05.06.2049 | | 250 | | 187 | 0,01 |
| 6,875 % fällig am 29.01.2026 | | 6.400 | | 6.545 | 0,20 |
| 7,450 % fällig am 30.04.2044 | | 100 | | 86 | 0,00 |
| Summe Dominikanische Republik | | | | 73.238 | 2,28 |
| **ECUADOR** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Ecuador Government International Bond** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 31.07.2030 (c) | $ | 5.232 | $ | 2.253 | 0,07 |
| 0,500 % fällig am 31.07.2040 | | 21.363 | | 9.195 | 0,29 |
| 1,000 % fällig am 31.07.2035 | | 15.871 | | 7.915 | 0,25 |
| 5,000 % fällig am 31.07.2030 | | 16.726 | | 11.034 | 0,34 |
| Summe Ecuador | | | | 30.397 | 0,95 |
| **ÄGYPTEN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Egypt Government International Bond** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 16.04.2026 | € | 14.508 | | 11.397 | 0,36 |
| 5,625 % fällig am 16.04.2030 | | 4.770 | | 3.108 | 0,10 |
| 5,875 % fällig am 16.02.2031 | $ | 5.300 | | 3.308 | 0,10 |
| 6,375 % fällig am 11.04.2031 | € | 200 | | 132 | 0,00 |
| 6,875 % fällig am 30.04.2040 (i) | $ | 3.100 | | 1.728 | 0,05 |
| 7,053 % fällig am 15.01.2032 | | 6.000 | | 3.918 | 0,12 |
| 7,300 % fällig am 30.09.2033 | | 21.900 | | 14.120 | 0,44 |
| 7,500 % fällig am 16.02.2061 | | 2.600 | | 1.454 | 0,05 |
| 7,625 % fällig am 29.05.2032 | | 6.800 | | 4.473 | 0,14 |
| 7,903 % fällig am 21.02.2048 | | 8.900 | | 5.116 | 0,16 |
| 8,150 % fällig am 20.11.2059 | | 2.100 | | 1.221 | 0,04 |
| 8,500 % fällig am 31.01.2047 | | 4.900 | | 2.918 | 0,09 |
| 8,500 % fällig am 31.01.2047 | | 3.100 | | 1.846 | 0,06 |
| 8,875 % fällig am 29.05.2050 | | 9.100 | | 5.554 | 0,17 |
| Summe Ägypten | | | | 60.293 | 1,88 |
| **EL SALVADOR** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **El Salvador Government International Bond** | | | | | |
| 6,375 % fällig am 18.01.2027 | | 1.100 | | 377 | 0,01 |
| 7,125 % fällig am 20.01.2050 | | 12.707 | | 4.067 | 0,13 |
| 7,625 % fällig am 21.09.2034 | | 3.800 | | 1.185 | 0,04 |
| 7,625 % fällig am 01.02.2041 | | 530 | | 169 | 0,01 |
| 7,650 % fällig am 15.06.2035 | | 200 | | 65 | 0,00 |
| 8,250 % fällig am 10.04.2032 | | 410 | | 141 | 0,00 |
| 8,625 % fällig am 28.02.2029 | | 185 | | 62 | 0,00 |
| 9,500 % fällig am 15.07.2052 | | 1.400 | | 472 | 0,01 |
| Summe El Salvador | | | | 6.538 | 0,20 |
| **ÄTHIOPIEN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Ethiopia Government International Bond** | | | | | |
| 6,625 % fällig am 11.12.2024 | | 3.300 | | 1.889 | 0,06 |
| **GEORGIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Georgian Railway JSC** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 17.06.2028 | | 300 | | 251 | 0,01 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Deutsche Bank AG** | | | | | |
| 3,700 % fällig am 30.05.2024 | | 4.222 | | 4.150 | 0,13 |
| 3,950 % fällig am 27.02.2023 | | 6.769 | | 6.756 | 0,21 |
| Summe Deutschland | | | | 10.906 | 0,34 |
| **GHANA** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Ghana Government International Bond** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 07.04.2025 (c) | | 900 | | 513 | 0,02 |
| 0,000 % fällig am 07.04.2025 (c)(i) | | 2.200 | | 1.253 | 0,04 |
| 6,375 % fällig am 11.02.2027 | | 15.200 | | 8.759 | 0,27 |
| 7,625 % fällig am 16.05.2029 | | 800 | | 395 | 0,01 |
| 7,750 % fällig am 07.04.2029 | | 7.300 | | 3.666 | 0,11 |
| 7,875 % fällig am 26.03.2027 (i) | | 6.200 | | 3.620 | 0,11 |
| 7,875 % fällig am 11.02.2035 | | 3.729 | | 1.758 | 0,06 |
| 8,125 % fällig am 26.03.2032 | | 10.200 | | 4.965 | 0,16 |
| 8,625 % fällig am 07.04.2034 | | 10.500 | | 5.110 | 0,16 |
| 8,750 % fällig am 11.03.2061 | | 4.550 | | 2.160 | 0,07 |
| 8,875 % fällig am 07.05.2042 | | 1.600 | | 775 | 0,02 |
| 8,950 % fällig am 26.03.2051 | | 2.900 | | 1.380 | 0,04 |
| Summe Ghana | | | | 34.354 | 1,07 |
| **GUATEMALA** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Guatemala Government International Bond** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 05.06.2027 | $ | 8.600 | $ | 8.063 | 0,25 |
| 4,500 % fällig am 03.05.2026 | | 6.900 | | 6.654 | 0,21 |
| 4,875 % fällig am 13.02.2028 | | 7.120 | | 6.671 | 0,21 |
| 4,900 % fällig am 01.06.2030 | | 2.997 | | 2.743 | 0,08 |
| 5,375 % fällig am 24.04.2032 | | 300 | | 277 | 0,01 |
| 6,125 % fällig am 01.06.2050 | | 2.100 | | 1.771 | 0,05 |
| Summe Guatemala | | | | 26.179 | 0,81 |
| **HONGKONG** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **AIA Group Ltd.** | | | | | |
| 3,200 % fällig am 16.09.2040 | | 900 | | 721 | 0,02 |
| **Huarong Finance Co. Ltd.** | | | | | |
| 2,631 % fällig am 24.02.2023 (i) | | 9.000 | | 8.798 | 0,27 |
| 3,375 % fällig am 24.02.2030 | | 1.100 | | 829 | 0,02 |
| 3,875 % fällig am 13.11.2029 | | 300 | | 240 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 29.05.2029 | | 3.450 | | 2.876 | 0,09 |
| 5,000 % fällig am 19.11.2025 | | 3.700 | | 3.501 | 0,11 |
| 5,500 % fällig am 16.01.2025 | | 200 | | 194 | 0,01 |
| | | | | 17.159 | 0,53 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Airport Authority Hong Kong** | | | | | |
| 2,100 % fällig am 08.03.2026 (e) | | 7.500 | | 6.818 | 0,21 |
| 2,625 % fällig am 04.02.2051 | | 1.000 | | 723 | 0,03 |
| | | | | 7.541 | 0,24 |
| Summe Hongkong | | | | 24.700 | 0,77 |
| **UNGARN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Hungary Government International Bond** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 18.11.2030 | € | 800 | | 608 | 0,02 |
| 1,750 % fällig am 05.06.2035 | | 3.900 | | 2.884 | 0,09 |
| 2,125 % fällig am 22.09.2031 | $ | 2.700 | | 2.093 | 0,07 |
| 3,125 % fällig am 21.09.2051 | | 500 | | 332 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 16.06.2029 | | 17.800 | | 17.781 | 0,55 |
| Summe Ungarn | | | | 23.698 | 0,74 |
| **INDIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Adani Transmission Step-One Ltd.** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 21.05.2036 | | 2.450 | | 2.067 | 0,07 |
| **Indian Railway Finance Corp. Ltd.** | | | | | |
| 3,950 % fällig am 13.02.2050 (i) | | 2.200 | | 1.691 | 0,05 |
| **JSW Steel Ltd.** | | | | | |
| 5,050 % fällig am 05.04.2032 | | 1.000 | | 744 | 0,02 |
| **Muthoot Finance Ltd.** | | | | | |
| 4,400 % fällig am 02.09.2023 | | 5.400 | | 5.257 | 0,16 |
| **NTPC Ltd.** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 03.04.2024 | | 2.000 | | 1.981 | 0,06 |
| **Reliance Industries Ltd.** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 12.01.2032 | | 2.300 | | 1.910 | 0,06 |
| | | | | 13.650 | 0,42 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Export-Import Bank of India** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 05.08.2026 | | 600 | | 573 | 0,02 |
| 3,875 % fällig am 12.03.2024 (i) | | 4.100 | | 4.091 | 0,13 |
| | | | | 4.664 | 0,15 |
| Summe Indien | | | | 18.314 | 0,57 |
| **INDONESIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Freeport Indonesia PT** | | | | | |
| 5,315 % fällig am 14.04.2032 | | 7.500 | | 6.836 | 0,21 |
| **LLPL Capital Pte. Ltd.** | | | | | |
| 6,875 % fällig am 04.02.2039 | | 959 | | 894 | 0,03 |
| **Pelabuhan Indonesia Persero PT** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 05.05.2025 | | 8.200 | | 8.096 | 0,25 |
| 4,500 % fällig am 02.05.2023 | | 18.700 | | 18.723 | 0,58 |
| 4,875 % fällig am 01.10.2024 | | 3.100 | | 3.125 | 0,10 |
| 5,375 % fällig am 05.05.2045 | | 3.693 | | 3.461 | 0,11 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Pertamina Persero PT** | | | | |
| 4,175 % fällig am 21.01.2050 | $ | 5.000 | $ 3.927 | 0,12 |
| 5,625 % fällig am 20.05.2043 | | 1.800 | 1.680 | 0,05 |
| 6,000 % fällig am 03.05.2042 | | 17.600 | 16.954 | 0,53 |
| 6,450 % fällig am 30.05.2044 | | 11.000 | 11.192 | 0,35 |
| 6,500 % fällig am 07.11.2048 | | 9.500 | 9.666 | 0,30 |
| **Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara** | | | | |
| 4,000 % fällig am 30.06.2050 | | 18.800 | 13.110 | 0,41 |
| 4,125 % fällig am 15.05.2027 | | 1.300 | 1.251 | 0,04 |
| 4,375 % fällig am 05.02.2050 | | 2.900 | 2.139 | 0,07 |
| 5,250 % fällig am 24.10.2042 | | 2.300 | 1.978 | 0,06 |
| 5,250 % fällig am 15.05.2047 | | 5.400 | 4.483 | 0,14 |
| 6,150 % fällig am 21.05.2048 | | 700 | 642 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 25.01.2049 | | 7.800 | 7.174 | 0,22 |
| | | | 115.331 | 3,59 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 1,100 % fällig am 12.03.2033 | € | 10.400 | 7.766 | 0,24 |
| 4,750 % fällig am 18.07.2047 | $ | 4.200 | 3.875 | 0,12 |
| 5,125 % fällig am 15.01.2045 | | 8.950 | 8.597 | 0,27 |
| 5,250 % fällig am 17.01.2042 | | 9.100 | 8.927 | 0,28 |
| 5,350 % fällig am 11.02.2049 | | 200 | 197 | 0,01 |
| 6,625 % fällig am 17.02.2037 | | 8.700 | 9.569 | 0,30 |
| 6,750 % fällig am 15.01.2044 | | 4.000 | 4.625 | 0,14 |
| 7,750 % fällig am 17.01.2038 | | 1.000 | 1.192 | 0,04 |
| 8,500 % fällig am 12.10.2035 | | 5.100 | 6.451 | 0,20 |
| **Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia** | | | | |
| 3,800 % fällig am 23.06.2050 | | 7.800 | 6.296 | 0,19 |
| | | | 57.495 | 1,79 |
| Summe Indonesien | | | 172.826 | 5,38 |
| **IRLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC** | | | | |
| 5,950 % fällig am 15.04.2030 ^(g) | | 6.600 | 726 | 0,02 |
| **Republic of Angola Via Avenir Issuer Ireland DAC** | | | | |
| 6,927 % fällig am 19.02.2027 | | 15.571 | 14.326 | 0,45 |
| **Russian Railways Via RZD Capital PLC** | | | | |
| 7,487 % fällig am 25.03.2031 ^ | £ | 5.000 | 607 | 0,02 |
| Summe Irland | | | 15.659 | 0,49 |
| **ISRAEL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bank Hapoalim B.M.** | | | | |
| 3,255 % fällig am 21.01.2032 (g) | $ | 9.900 | 8.514 | 0,26 |
| **Israel Electric Corp. Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 22.02.2032 | | 1.100 | 986 | 0,03 |
| 4,250 % fällig am 14.08.2028 | | 5.400 | 5.204 | 0,16 |
| 5,000 % fällig am 12.11.2024 | | 200 | 203 | 0,01 |
| **Leviathan Bond Ltd.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 30.06.2027 | | 8.200 | 7.598 | 0,24 |
| Summe Israel | | | 22.505 | 0,70 |
| **ELFENBEINKÜSTE** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Republik Côte d'Ivoire** | | | | |
| 5,000 % fällig am 19.03.2027 | € | 4.300 | 4.323 | 0,13 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ivory Coast Government International Bond** | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.01.2032 | | 7.400 | 5.587 | 0,18 |
| 5,750 % fällig am 31.12.2032 | $ | 16.593 | 14.426 | 0,45 |
| 5,875 % fällig am 17.10.2031 | € | 4.800 | 3.945 | 0,12 |
| | | | 23.958 | 0,75 |
| Summe Elfenbeinküste | | | 28.281 | 0,88 |
| **JAMAIKA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **TransJamaican Highway Ltd.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 10.10.2036 | $ | 3.189 | 2.801 | 0,09 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Corsair International Ltd.** | | | | |
| 4,850 % fällig am 28.01.2027 | € | 15.600 | 15.396 | 0,48 |
| 5,200 % fällig am 28.01.2029 | € | 6.700 | $ 6.542 | 0,20 |
| Summe Jersey, Kanalinseln | | | 21.938 | 0,68 |
| **JORDANIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Jordan Government International Bond** | | | | |
| 4,950 % fällig am 07.07.2025 | $ | 2.200 | 1.988 | 0,06 |
| 5,750 % fällig am 31.01.2027 | | 13.200 | 11.632 | 0,36 |
| 5,850 % fällig am 07.07.2030 | | 2.100 | 1.669 | 0,05 |
| 6,125 % fällig am 29.01.2026 | | 7.200 | 6.607 | 0,21 |
| 7,375 % fällig am 10.10.2047 | | 3.600 | 2.655 | 0,08 |
| Summe Jordanien | | | 24.551 | 0,76 |
| **KASACHSTAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Development Bank of Kazakhstan JSC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 10.12.2022 | | 2.800 | 2.795 | 0,08 |
| **KazMunayGas National Co. JSC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 24.04.2025 | | 2.400 | 2.248 | 0,07 |
| 4,750 % fällig am 19.04.2027 | | 10.600 | 9.548 | 0,30 |
| 5,375 % fällig am 24.04.2030 | | 400 | 354 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 19.04.2047 | | 6.164 | 4.734 | 0,15 |
| 6,375 % fällig am 24.10.2048 | | 2.300 | 1.914 | 0,06 |
| **Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.08.2030 | | 11.900 | 9.095 | 0,28 |
| | | | 30.688 | 0,95 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Kazakhstan Government International Bond** | | | | |
| 1,550 % fällig am 09.11.2023 | € | 400 | 413 | 0,01 |
| 2,375 % fällig am 09.11.2028 | | 200 | 190 | 0,01 |
| 4,875 % fällig am 14.10.2044 | $ | 800 | 668 | 0,02 |
| 5,125 % fällig am 21.07.2025 | | 250 | 259 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 21.07.2045 | | 7.680 | 7.738 | 0,24 |
| | | | 9.268 | 0,29 |
| Summe Kasachstan | | | 39.956 | 1,24 |
| **KENIA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Kenya Government International Bond** | | | | |
| 8,000 % fällig am 22.05.2032 | | 9.500 | 6.766 | 0,21 |
| **LIBANON** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Lebanon Government International Bond** | | | | |
| 8,250 % fällig am 17.05.2034 ^ | | 9.700 | 618 | 0,02 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Constellation Oil Services Holding S.A.** | | | | |
| 13,500 % fällig am 30.06.2025 | | 1.704 | 1.708 | 0,05 |
| **Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar oder 4,000 % PIK)** | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.12.2026 (a) | | 3.743 | 2.765 | 0,09 |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 4,950 % fällig am 19.07.2022 | | 3.000 | 2.325 | 0,07 |
| 5,150 % fällig am 11.02.2026 | | 5.900 | 1.917 | 0,06 |
| **Guara Norte SARL** | | | | |
| 5,198 % fällig am 15.06.2034 | | 4.962 | 4.034 | 0,13 |
| **Petrorio Luxembourg Trading SARL** | | | | |
| 6,125 % fällig am 09.06.2026 | | 7.100 | 6.542 | 0,20 |
| **Unigel Luxembourg S.A.** | | | | |
| 8,750 % fällig am 01.10.2026 | | 7.700 | 7.634 | 0,24 |
| Summe Luxemburg | | | 26.925 | 0,84 |
| **MALAYSIA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Axiata SPV2 Bhd.** | | | | |
| 2,163 % fällig am 19.08.2030 | | 2.300 | 1.960 | 0,06 |
| **Petronas Capital Ltd.** | | | | |
| 3,404 % fällig am 28.04.2061 | | 16.000 | 12.061 | 0,38 |
| 4,500 % fällig am 18.03.2045 | | 500 | 480 | 0,01 |
| 4,550 % fällig am 21.04.2050 | | 13.200 | 12.635 | 0,39 |
| Summe Malaysia | | | 27.136 | 0,84 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **MARSHALLINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Nakilat, Inc.** | | | | |
| 6,267 % fällig am 31.12.2033 | $ | 464 | $ 508 | 0,02 |
| **MAURITIUS** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Greenko Solar Mauritius Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 29.07.2026 | | 3.200 | 2.860 | 0,09 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **MEXIKO** | | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **Hipotecaria Su Casita S.A. (b)** | | 39.443 | 0 | 0,00 |
| **Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V. (b)** | | 2.622 | 1 | 0,00 |
| Summe Stammaktien | | | $ 1 | 0,00 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **America Movil S.A.B. de C.V.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 04.04.2032 | $ | 11.050 | 9.831 | 0,31 |
| 6,450 % fällig am 05.12.2022 | MXN | 88.000 | 4.305 | 0,13 |
| **Banco Mercantil del Norte S.A.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 24.01.2032 (e)(g) | $ | 4.100 | 3.355 | 0,11 |
| 7,500 % fällig am 27.06.2029 (e)(g) | | 4.900 | 4.444 | 0,14 |
| **BBVA Bancomer S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 30.09.2022 | | 300 | 301 | 0,01 |
| **Cibanco S.A. Ibm** | | | | |
| 4,962 % fällig am 18.07.2029 | | 4.100 | 3.674 | 0,12 |
| **Comision Federal de Electricidad** | | | | |
| 6,264 % fällig am 15.02.2052 | | 3.700 | 2.959 | 0,09 |
| **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 |
| **Industrias Penoles S.A.B. de C.V.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 06.08.2050 | | 4.900 | 3.899 | 0,12 |
| **Minera Mexico S.A. de C.V.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 26.01.2050 | | 5.500 | 4.279 | 0,13 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 3,625 % fällig am 24.11.2025 | € | 1.400 | 1.299 | 0,04 |
| 3,750 % fällig am 21.02.2024 | | 600 | 606 | 0,02 |
| 5,125 % fällig am 15.03.2023 | | 100 | 105 | 0,00 |
| 6,350 % fällig am 12.02.2048 | $ | 30.211 | 17.837 | 0,56 |
| 6,500 % fällig am 02.06.2041 | | 2.000 | 1.252 | 0,04 |
| 6,625 % fällig am 15.06.2035 | | 9.050 | 6.200 | 0,19 |
| 6,625 % fällig am 15.06.2038 | | 200 | 132 | 0,00 |
| 6,700 % fällig am 16.02.2032 | | 14.861 | 11.363 | 0,35 |
| 6,750 % fällig am 21.09.2047 | | 17.180 | 10.668 | 0,33 |
| 6,950 % fällig am 28.01.2060 | | 39.004 | 24.130 | 0,75 |
| 7,690 % fällig am 23.01.2050 | | 84.516 | 57.733 | 1,80 |
| **Trust Fibra Uno** | | | | |
| 6,390 % fällig am 15.01.2050 | | 1.400 | 1.116 | 0,04 |
| | | | 169.488 | 5,28 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 3,750 % fällig am 19.04.2071 | | 9.200 | 5.876 | 0,18 |
| 3,771 % fällig am 24.05.2061 | | 22.800 | 14.851 | 0,46 |
| 4,000 % fällig am 15.03.2115 | € | 1.000 | 743 | 0,02 |
| 4,280 % fällig am 14.08.2041 | $ | 11.091 | 8.794 | 0,27 |
| 5,000 % fällig am 27.04.2051 | | 14.100 | 11.754 | 0,37 |
| 5,750 % fällig am 12.10.2110 | | 31.450 | 26.515 | 0,83 |
| | | | 68.533 | 2,13 |
| Summe Mexiko | | | 238.022 | 7,41 |
| **MONGOLEI** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Mongolia Government International Bond** | | | | |
| 3,500 % fällig am 07.07.2027 | | 6.300 | 5.118 | 0,16 |
| 5,625 % fällig am 01.05.2023 | | 4.090 | 4.034 | 0,12 |
| Summe Mongolei | | | 9.152 | 0,28 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **MAROKKO** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **OCP S.A.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 23.06.2031 | $ | 8.550 | $ 6.482 | 0,20 |
| 5,125 % fällig am 23.06.2051 | | 10.600 | 7.066 | 0,22 |
| | | | 13.548 | 0,42 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Morocco Government International Bond** | | | | |
| 1,500 % fällig am 27.11.2031 | € | 4.800 | 3.342 | 0,10 |
| 2,375 % fällig am 15.12.2027 | $ | 9.916 | 8.011 | 0,25 |
| 4,000 % fällig am 15.12.2050 | | 900 | 529 | 0,02 |
| 4,250 % fällig am 11.12.2022 | | 2.400 | 2.401 | 0,08 |
| | | | 14.283 | 0,45 |
| Summe Marokko | | | 27.831 | 0,87 |
| **MULTINATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ATP Tower Holdings LLC** | | | | |
| 4,050 % fällig am 27.04.2026 | | 10.600 | 8.777 | 0,27 |
| **NAMIBIA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Namibia Government International Bond** | | | | |
| 5,250 % fällig am 29.10.2025 | | 2.000 | 1.779 | 0,05 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Kazakhstan Temir Zholy Finance BV** | | | | |
| 6,950 % fällig am 10.07.2042 | | 4.960 | 4.517 | 0,14 |
| **Metinvest BV** | | | | |
| 7,750 % fällig am 23.04.2023 | | 475 | 283 | 0,01 |
| 8,500 % fällig am 23.04.2026 (i) | | 5.700 | 2.990 | 0,09 |
| **Prosus NV** | | | | |
| 1,539 % fällig am 03.08.2028 | € | 2.400 | 1.991 | 0,06 |
| 2,031 % fällig am 03.08.2032 | | 1.200 | 870 | 0,03 |
| 3,257 % fällig am 19.01.2027 | $ | 3.900 | 3.393 | 0,11 |
| 3,680 % fällig am 21.01.2030 | | 2.200 | 1.755 | 0,06 |
| 3,832 % fällig am 08.02.2051 | | 2.100 | 1.268 | 0,04 |
| 4,027 % fällig am 03.08.2050 | | 1.600 | 996 | 0,03 |
| **Republic of Angola Via Avenir BV** | | | | |
| 6,609 % fällig am 07.12.2023 | | 5.640 | 5.569 | 0,17 |
| 10,447 % fällig am 01.07.2023 | | 4.577 | 4.588 | 0,14 |
| Summe Niederlande | | | 28.220 | 0,88 |
| **NIGERIA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BOI Finance BV** | | | | |
| 7,500 % fällig am 16.02.2027 | € | 12.900 | 10.925 | 0,34 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Nigeria Government International Bond** | | | | |
| 6,125 % fällig am 28.09.2028 | $ | 6.600 | 4.700 | 0,14 |
| 6,375 % fällig am 12.07.2023 (i) | | 200 | 196 | 0,01 |
| 6,375 % fällig am 12.07.2023 | | 8.450 | 8.287 | 0,26 |
| 6,500 % fällig am 28.11.2027 | | 8.353 | 6.386 | 0,20 |
| 7,143 % fällig am 23.02.2030 | | 12.600 | 8.940 | 0,28 |
| 7,375 % fällig am 28.09.2033 | | 9.400 | 6.172 | 0,19 |
| 7,625 % fällig am 28.11.2047 | | 7.946 | 4.778 | 0,15 |
| 7,696 % fällig am 23.02.2038 | | 4.800 | 2.977 | 0,09 |
| 7,875 % fällig am 16.02.2032 | | 1.350 | 944 | 0,03 |
| 8,250 % fällig am 28.09.2051 | | 4.400 | 2.753 | 0,08 |
| 8,747 % fällig am 21.01.2031 | | 10.850 | 8.138 | 0,25 |
| 9,248 % fällig am 21.01.2049 | | 5.000 | 3.412 | 0,11 |
| | | | 57.683 | 1,79 |
| Summe Nigeria | | | 68.608 | 2,13 |
| **OMAN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Oman Government International Bond** | | | | |
| 4,125 % fällig am 17.01.2023 | | 2.100 | 2.100 | 0,07 |
| 4,875 % fällig am 01.02.2025 | | 1.100 | 1.078 | 0,03 |
| 5,625 % fällig am 17.01.2028 | | 6.690 | 6.453 | 0,20 |
| 6,000 % fällig am 01.08.2029 | | 17.400 | 16.803 | 0,52 |
| 6,250 % fällig am 25.01.2031 | | 13.100 | 12.686 | 0,40 |
| 6,500 % fällig am 08.03.2047 | $ | 4.373 | $ 3.685 | 0,11 |
| 6,750 % fällig am 28.10.2027 | | 18.500 | 18.907 | 0,59 |
| 6,750 % fällig am 17.01.2048 | | 1.900 | 1.645 | 0,05 |
| 7,000 % fällig am 25.01.2051 | | 4.400 | 3.891 | 0,12 |
| **Oman Sovereign Sukuk Co.** | | | | |
| 4,397 % fällig am 01.06.2024 | | 2.600 | 2.573 | 0,08 |
| Summe Oman | | | 69.821 | 2,17 |
| **PAKISTAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Third Pakistan International Sukuk Co. Ltd.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 05.12.2022 | | 1.400 | 1.316 | 0,04 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Pakistan Government International Bond** | | | | |
| 6,000 % fällig am 08.04.2026 | | 3.952 | 2.687 | 0,08 |
| 6,875 % fällig am 05.12.2027 | | 3.500 | 2.388 | 0,08 |
| 7,375 % fällig am 08.04.2031 | | 1.870 | 1.189 | 0,04 |
| 8,250 % fällig am 15.04.2024 | | 5.500 | 4.301 | 0,13 |
| 8,875 % fällig am 08.04.2051 | | 10.500 | 6.309 | 0,20 |
| | | | 16.874 | 0,53 |
| Summe Pakistan | | | 18.190 | 0,57 |
| **PANAMA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 11.08.2061 | | 7.100 | 5.636 | 0,17 |
| **Banco General S.A.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 07.05.2031 (e)(g) | | 400 | 366 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 07.05.2031 (e) | | 8.300 | 7.595 | 0,24 |
| **Banco Nacional de Panamá** | | | | |
| 2,500 % fällig am 11.08.2030 | | 5.900 | 4.697 | 0,15 |
| | | | 18.294 | 0,57 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Panama Government International Bond** | | | | |
| 3,870 % fällig am 23.07.2060 | | 1.400 | 994 | 0,03 |
| 4,300 % fällig am 29.04.2053 | | 2.000 | 1.576 | 0,05 |
| 4,500 % fällig am 15.05.2047 | | 8.100 | 6.672 | 0,21 |
| 4,500 % fällig am 16.04.2050 | | 9.000 | 7.346 | 0,23 |
| 4,500 % fällig am 01.04.2056 | | 13.400 | 10.668 | 0,33 |
| 4,500 % fällig am 19.01.2063 | | 8.200 | 6.330 | 0,20 |
| 6,700 % fällig am 26.01.2036 | | 1.300 | 1.409 | 0,04 |
| 8,125 % fällig am 28.04.2034 | | 300 | 377 | 0,01 |
| 8,875 % fällig am 30.09.2027 | | 2.000 | 2.358 | 0,07 |
| | | | 37.730 | 1,17 |
| Summe Panama | | | 56.024 | 1,74 |
| **PARAGUAY** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Paraguay Government International Bond** | | | | |
| 2,739 % fällig am 29.01.2033 | | 1.900 | 1.418 | 0,04 |
| 3,849 % fällig am 28.06.2033 | | 2.600 | 2.126 | 0,07 |
| 4,700 % fällig am 27.03.2027 | | 1.800 | 1.732 | 0,05 |
| 5,400 % fällig am 30.03.2050 | | 3.100 | 2.414 | 0,08 |
| 6,100 % fällig am 11.08.2044 | | 1.200 | 1.049 | 0,03 |
| Summe Paraguay | | | 8.739 | 0,27 |
| **PERU** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco de Credito del Peru S.A.** | | | | |
| 4,650 % fällig am 17.09.2024 | PEN | 26.100 | 6.361 | 0,20 |
| **Cia de Minas Buenaventura SAA** | | | | |
| 5,500 % fällig am 23.07.2026 | $ | 3.000 | 2.705 | 0,09 |
| **InRetail Consumer** | | | | |
| 3,250 % fällig am 22.03.2028 | | 10.100 | 8.400 | 0,26 |
| **Peru LNG SRL** | | | | |
| 5,375 % fällig am 22.03.2030 | | 1.700 | 1.377 | 0,04 |
| **Petroleos del Peru S.A.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 19.06.2032 | | 2.600 | 2.014 | 0,06 |
| 5,625 % fällig am 19.06.2047 | | 8.500 | 5.794 | 0,18 |
| | | | 26.651 | 0,83 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 2,392 % fällig am 23.01.2026 | | 1.900 | 1.768 | 0,05 |
| 3,000 % fällig am 15.01.2034 | $ | 1.000 | $ 823 | 0,03 |
| 3,230 % fällig am 28.07.2121 | | 3.400 | 2.094 | 0,07 |
| 3,600 % fällig am 15.01.2072 | | 2.600 | 1.767 | 0,05 |
| 6,550 % fällig am 14.03.2037 | | 943 | 1.025 | 0,03 |
| | | | 7.477 | 0,23 |
| Summe Peru | | | 34.128 | 1,06 |
| **PHILIPPINEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **JGSH Philippines Ltd.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 09.07.2030 | | 6.600 | 6.088 | 0,19 |
| **Jollibee Worldwide Pte. Ltd.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 24.01.2026 | | 8.700 | 8.525 | 0,27 |
| 4,750 % fällig am 24.06.2030 | | 600 | 570 | 0,02 |
| **PLDT, Inc.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 23.01.2031 | | 3.200 | 2.681 | 0,08 |
| | | | 17.864 | 0,56 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Philippines Government International Bond** | | | | |
| 2,650 % fällig am 10.12.2045 | | 5.500 | 3.838 | 0,12 |
| 2,950 % fällig am 05.05.2045 | | 5.900 | 4.250 | 0,13 |
| 3,700 % fällig am 01.03.2041 | | 650 | 542 | 0,02 |
| 3,950 % fällig am 20.01.2040 | | 2.400 | 2.094 | 0,06 |
| | | | 10.724 | 0,33 |
| Summe Philippinen | | | 28.588 | 0,89 |
| **KATAR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Nakilat, Inc.** | | | | |
| 6,067 % fällig am 31.12.2033 | | 190 | 202 | 0,01 |
| **Qatar Energy** | | | | |
| 2,250 % fällig am 12.07.2031 | | 9.300 | 7.960 | 0,25 |
| 3,125 % fällig am 12.07.2041 | | 8.100 | 6.372 | 0,20 |
| 3,300 % fällig am 12.07.2051 | | 18.100 | 14.021 | 0,43 |
| | | | 28.555 | 0,89 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 4,400 % fällig am 16.04.2050 (i) | | 6.000 | 5.742 | 0,18 |
| 4,400 % fällig am 16.04.2050 | | 1.200 | 1.148 | 0,03 |
| 4,625 % fällig am 02.06.2046 | | 300 | 299 | 0,01 |
| 4,817 % fällig am 14.03.2049 | | 1.200 | 1.211 | 0,04 |
| 5,103 % fällig am 23.04.2048 | | 480 | 504 | 0,01 |
| | | | 8.904 | 0,27 |
| Summe Katar | | | 37.459 | 1,16 |
| **RUMÄNIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Romania Government International Bond** | | | | |
| 1,750 % fällig am 13.07.2030 | € | 17.500 | 13.078 | 0,41 |
| 2,000 % fällig am 08.12.2026 | | 3.900 | 3.650 | 0,11 |
| 2,124 % fällig am 16.07.2031 | | 4.700 | 3.490 | 0,11 |
| 2,125 % fällig am 07.03.2028 | | 4.400 | 3.796 | 0,12 |
| 2,375 % fällig am 19.04.2027 | | 2.100 | 1.943 | 0,06 |
| 2,625 % fällig am 02.12.2040 | | 7.400 | 4.509 | 0,14 |
| 2,875 % fällig am 26.05.2028 | | 1.600 | 1.434 | 0,04 |
| 2,875 % fällig am 13.04.2042 | | 5.900 | 3.621 | 0,11 |
| 3,500 % fällig am 03.04.2034 | | 4.200 | 3.217 | 0,10 |
| 3,750 % fällig am 07.02.2034 | | 3.155 | 2.479 | 0,08 |
| 3,875 % fällig am 29.10.2035 | | 100 | 78 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 14.02.2051 | $ | 2.700 | 1.768 | 0,06 |
| 4,625 % fällig am 03.04.2049 | € | 200 | 149 | 0,00 |
| Summe Rumänien | | | 43.212 | 1,34 |
| **RUSSLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **SCF Capital Designated Activity Co.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 16.06.2023 ^ | $ | 1.200 | 360 | 0,01 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Russia Government International Bond** | | | | |
| 1,125 % fällig am 20.11.2027 | € | 500 | 144 | 0,00 |
| 1,850 % fällig am 20.11.2032 | | 8.900 | 2.512 | 0,08 |
| 2,875 % fällig am 04.12.2025 | | 2.500 | 693 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 4,375 % fällig am 21.03.2029 ^ | $ | 18.200 | $ 5.005 | 0,16 |
| 4,750 % fällig am 27.05.2026 | | 3.400 | 920 | 0,03 |
| 4,875 % fällig am 16.09.2023 | | 200 | 53 | 0,00 |
| 5,100 % fällig am 28.03.2035 ^ | | 12.600 | 3.339 | 0,10 |
| 5,250 % fällig am 23.06.2047 ^ | | 2.000 | 530 | 0,02 |
| 5,875 % fällig am 16.09.2043 ^ | | 5.200 | 1.534 | 0,05 |
| 7,500 % fällig am 31.03.2030 ^ | | 363 | 99 | 0,00 |
| | | | 14.829 | 0,46 |
| Summe Russland | | | 15.189 | 0,47 |
| **SAUDI-ARABIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Saudi Arabian Oil Co.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 16.04.2024 | | 600 | 590 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 16.04.2029 | | 3.000 | 2.867 | 0,09 |
| 3,500 % fällig am 24.11.2070 | | 40.800 | 29.016 | 0,90 |
| | | | 32.473 | 1,01 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Saudi Arabia Government International Bond** | | | | |
| 2,250 % fällig am 02.02.2033 | | 5.000 | 4.166 | 0,13 |
| 3,450 % fällig am 02.02.2061 | | 12.000 | 9.012 | 0,28 |
| 3,750 % fällig am 21.01.2055 | | 30.800 | 25.282 | 0,79 |
| 4,500 % fällig am 26.10.2046 (i) | | 29.700 | 27.161 | 0,84 |
| 4,625 % fällig am 04.10.2047 | | 300 | 279 | 0,01 |
| | | | 65.900 | 2,05 |
| Summe Saudi-Arabien | | | 98.373 | 3,06 |
| **SENEGAL** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Senegal Government International Bond** | | | | |
| 4,750 % fällig am 13.03.2028 | € | 1.600 | 1.366 | 0,04 |
| 5,375 % fällig am 08.06.2037 | | 5.900 | 3.890 | 0,12 |
| 6,750 % fällig am 13.03.2048 | $ | 800 | 512 | 0,02 |
| Summe Senegal | | | 5.768 | 0,18 |
| **SERBIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Serbia Government International Bond** | | | | |
| 1,000 % fällig am 23.09.2028 | € | 400 | 305 | 0,01 |
| 1,500 % fällig am 26.06.2029 | | 11.200 | 8.500 | 0,26 |
| 1,650 % fällig am 03.03.2033 | | 10.000 | 6.582 | 0,21 |
| 3,125 % fällig am 15.05.2027 | | 700 | 642 | 0,02 |
| Summe Serbien | | | 16.029 | 0,50 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 18.09.2022 | $ | 200 | 200 | 0,01 |
| **Flex Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.06.2029 | | 1.300 | 1.253 | 0,04 |
| **Medco Bell Pte. Ltd.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 30.01.2027 | | 5.900 | 5.055 | 0,15 |
| **Singapore Airlines Ltd.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 19.01.2029 | | 10.300 | 9.382 | 0,29 |
| Summe Singapur | | | 15.890 | 0,49 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Absa Group Ltd.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 27.05.2026 (e)(g) | | 4.350 | 3.949 | 0,12 |
| **AngloGold Ashanti Holdings PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.10.2030 | | 3.600 | 2.969 | 0,09 |
| 6,500 % fällig am 15.04.2040 | | 200 | 190 | 0,01 |
| **Development Bank of Southern Africa** | | | | |
| 8,600 % fällig am 21.10.2024 (h) | ZAR | 467.300 | 28.001 | 0,87 |
| **Eskom Holdings SOC Ltd.** | | | | |
| 4,314 % fällig am 23.07.2027 | $ | 30.250 | 24.856 | 0,77 |
| 6,350 % fällig am 10.08.2028 | | 13.400 | 12.042 | 0,38 |
| 6,750 % fällig am 06.08.2023 | | 9.800 | 9.040 | 0,28 |
| **Growthpoint Properties International Pty. Ltd.** | | | | |
| 5,872 % fällig am 02.05.2023 | | 5.200 | 5.198 | 0,16 |
| **Sasol Financing International Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 14.11.2022 | $ | 14.200 | $ 14.138 | 0,44 |
| **Sasol Financing USA LLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 27.03.2024 | | 5.515 | 5.408 | 0,17 |
| **Transnet SOC Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 26.07.2022 | | 4.900 | 4.698 | 0,15 |
| | | | 110.489 | 3,44 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 4,300 % fällig am 12.10.2028 | | 4.200 | 3.598 | 0,11 |
| 4,850 % fällig am 30.09.2029 | | 14.300 | 12.251 | 0,38 |
| 5,000 % fällig am 12.10.2046 | | 10.200 | 6.609 | 0,21 |
| 5,375 % fällig am 24.07.2044 | | 400 | 275 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 30.09.2049 | | 7.100 | 4.871 | 0,15 |
| 5,875 % fällig am 20.04.2032 | | 3.000 | 2.568 | 0,08 |
| 6,300 % fällig am 22.06.2048 | | 10.000 | 7.475 | 0,23 |
| 7,300 % fällig am 20.04.2052 | | 3.300 | 2.647 | 0,08 |
| 10,500 % fällig am 21.12.2026 | ZAR | 123.000 | 7.951 | 0,25 |
| | | | 48.245 | 1,50 |
| Summe Südafrika | | | 158.734 | 4,94 |
| **SRI LANKA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Sri Lanka Government International Bond** | | | | |
| 5,750 % fällig am 18.04.2023 ^ | $ | 9.770 | 3.171 | 0,10 |
| 5,875 % fällig am 25.07.2022 ^ | | 2.050 | 857 | 0,03 |
| 6,125 % fällig am 03.06.2025 ^ | | 5.100 | 1.699 | 0,05 |
| 6,200 % fällig am 11.05.2027 ^ | | 8.200 | 2.667 | 0,08 |
| 6,825 % fällig am 18.07.2026 ^ | | 1.200 | 417 | 0,01 |
| 6,850 % fällig am 03.11.2025 ^ | | 6.500 | 2.144 | 0,07 |
| 7,550 % fällig am 28.03.2030 ^ | | 21.300 | 6.898 | 0,21 |
| 7,850 % fällig am 14.03.2029 ^ | | 3.600 | 1.182 | 0,04 |
| Summe Sri Lanka | | | 19.035 | 0,59 |
| **SUPRANATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banque Ouest Africaine de Developpement** | | | | |
| 5,000 % fällig am 27.07.2027 | | 3.000 | 2.741 | 0,09 |
| **Eastern & Southern African Trade & Development Bank** | | | | |
| 4,125 % fällig am 30.06.2028 | | 8.300 | 6.893 | 0,21 |
| Summe Supranational | | | 9.634 | 0,30 |
| **TANSANIA** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **The Ministry of Finance and Planning, Government of the United Republic of Tanzania** | | | | |
| 5,400 % fällig am 26.04.2028 | € | 21.200 | 22.219 | 0,69 |
| **THAILAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bangkok Bank PCL** | | | | |
| 3,733 % fällig am 25.09.2034 (g) | $ | 800 | 702 | 0,02 |
| **GC Treasury Center Co. Ltd.** | | | | |
| 2,980 % fällig am 18.03.2031 | | 3.000 | 2.500 | 0,08 |
| 5,200 % fällig am 30.03.2052 | | 5.900 | 5.169 | 0,16 |
| Summe Thailand | | | 8.371 | 0,26 |
| **TUNESIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Banque Centrale de Tunisie Government International Bond** | | | | |
| 3,280 % fällig am 09.08.2027 | ¥ | 200.000 | 693 | 0,02 |
| 5,750 % fällig am 30.01.2025 | $ | 2.800 | 1.565 | 0,05 |
| 6,750 % fällig am 31.10.2023 | € | 700 | 510 | 0,02 |
| Summe Tunesien | | | 2.768 | 0,09 |
| **TÜRKEI** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S** | | | | |
| 5,004 % fällig am 06.04.2023 | $ | 1.200 | 1.183 | 0,04 |
| **Turkish Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.09.2028 | | 4.216 | 3.508 | 0,11 |
| **Turkiye Is Bankasi A/S** | | | | |
| 6,125 % fällig am 25.04.2024 | | 2.200 | 2.054 | 0,06 |
| **Yapi ve Kredi Bankasi A/S** | | | | |
| 5,850 % fällig am 21.06.2024 | $ | 600 | $ 556 | 0,02 |
| | | | 7.301 | 0,23 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **SOCAR Turkey Enerji A/S** | | | | |
| 3,450 % fällig am 11.08.2026 | € | 19.884 | 19.645 | 0,61 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Export-Credit Bank of Turkey** | | | | |
| 4,250 % fällig am 18.09.2022 | $ | 11.100 | 11.021 | 0,34 |
| 5,375 % fällig am 24.10.2023 (i) | | 5.300 | 5.026 | 0,16 |
| 5,750 % fällig am 06.07.2026 | | 3.500 | 2.933 | 0,09 |
| 8,250 % fällig am 24.01.2024 | | 4.700 | 4.627 | 0,14 |
| **Turkey Government International Bond** | | | | |
| 4,250 % fällig am 13.03.2025 | | 5.000 | 4.304 | 0,13 |
| 4,875 % fällig am 09.10.2026 | | 6.000 | 4.823 | 0,15 |
| 5,125 % fällig am 17.02.2028 | | 25.000 | 19.111 | 0,59 |
| 5,750 % fällig am 11.05.2047 | | 48.100 | 29.742 | 0,93 |
| 5,950 % fällig am 15.01.2031 | | 24.000 | 17.487 | 0,54 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2027 | | 17.400 | 14.344 | 0,45 |
| 6,000 % fällig am 14.01.2041 | | 18.320 | 11.738 | 0,37 |
| 6,125 % fällig am 24.10.2028 | | 5.200 | 4.099 | 0,13 |
| 6,375 % fällig am 14.10.2025 | | 10.900 | 9.684 | 0,30 |
| 6,875 % fällig am 17.03.2036 | | 16.070 | 11.831 | 0,37 |
| | | | 150.770 | 4,69 |
| Summe Türkei | | | 177.716 | 5,53 |
| **UKRAINE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **NPC Ukrenergo** | | | | |
| 6,875 % fällig am 09.11.2026 | | 7.800 | 1.950 | 0,06 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ukraine Government International Bond** | | | | |
| 4,375 % fällig am 27.01.2030 | € | 5.200 | 1.359 | 0,04 |
| 6,876 % fällig am 21.05.2029 | $ | 2.400 | 594 | 0,02 |
| 7,253 % fällig am 15.03.2033 | | 17.839 | 4.504 | 0,14 |
| 7,375 % fällig am 25.09.2032 | | 10.020 | 2.530 | 0,08 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2023 | | 10.940 | 3.556 | 0,11 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2024 | | 20.750 | 5.343 | 0,17 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2025 | | 6.000 | 1.530 | 0,05 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2026 | | 10.000 | 2.600 | 0,08 |
| 8,994 % fällig am 01.02.2024 | | 5.200 | 1.339 | 0,04 |
| | | | 23.355 | 0,73 |
| Summe Ukraine | | | 25.305 | 0,79 |
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC** | | | | |
| 3,650 % fällig am 02.11.2029 | | 2.200 | 2.120 | 0,07 |
| 4,600 % fällig am 02.11.2047 | | 600 | 570 | 0,02 |
| **DP World Ltd.** | | | | |
| 4,700 % fällig am 30.09.2049 | | 800 | 656 | 0,02 |
| 5,625 % fällig am 25.09.2048 | | 3.475 | 3.265 | 0,10 |
| 6,850 % fällig am 02.07.2037 | | 4.680 | 5.057 | 0,16 |
| **Kuwait Projects Co. SPC Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 23.02.2027 | | 4.000 | 3.224 | 0,10 |
| 5,000 % fällig am 15.03.2023 | | 2.700 | 2.637 | 0,08 |
| **MDGH GMTN RSC Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 21.05.2050 | | 5.500 | 4.933 | 0,15 |
| **NBK SPC Ltd.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 15.09.2027 | | 900 | 804 | 0,02 |
| | | | 23.266 | 0,72 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **NMC OpCo Ltd.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 25.03.2027 | AED | 36.775 | 10.169 | 0,32 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Emirate of Dubai Government International Bond** | | | | |
| 3,900 % fällig am 09.09.2050 | $ | 1.700 | 1.233 | 0,04 |
| **Finance Department Government of Sharjah** | | | | |
| 4,375 % fällig am 10.03.2051 | | 1.900 | 1.356 | 0,04 |
| | | | 2.589 | 0,08 |
| Summe Vereinigte Arabische Emirate | | | 36.024 | 1,12 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Antofagasta PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 14.10.2030 | $ | 2.200 | $ 1.706 | 0,05 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (g) | | 318 | 321 | 0,01 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 11.09.2024 | | 200 | 199 | 0,01 |
| **Fresnillo PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 02.10.2050 | | 9.000 | 6.621 | 0,21 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 3,973 % fällig am 22.05.2030 | | 400 | 368 | 0,01 |
| 4,041 % fällig am 13.03.2028 | | 1.000 | 950 | 0,03 |
| 4,583 % fällig am 19.06.2029 | | 300 | 290 | 0,01 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 4,582 % fällig am 10.12.2025 | | 1.000 | 982 | 0,03 |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 19.09.2026 | £ | 400 | 462 | 0,01 |
| 3,875 % fällig am 12.09.2023 | $ | 200 | 199 | 0,01 |
| 4,269 % fällig am 22.03.2025 | | 200 | 198 | 0,01 |
| 4,800 % fällig am 05.04.2026 | | 1.100 | 1.098 | 0,03 |
| 5,076 % fällig am 27.01.2030 | | 200 | 196 | 0,01 |
| **State Savings Bank of Ukraine Via SSB PLC** | | | | |
| 9,375 % fällig am 10.03.2023 þ | | 844 | 506 | 0,01 |
| **Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC** | | | | |
| 8,250 % fällig am 09.07.2024 | | 16.100 | 4.589 | 0,14 |
| **Ukreximbank Via Biz Finance PLC** | | | | |
| 9,750 % fällig am 22.01.2025 | | 2.186 | 1.213 | 0,04 |
| | | | 19.898 | 0,62 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Warwick Finance Residential Mortgages PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.12.2049 (c) | £ | 0 | 161 | 0,01 |
| 1,742 % fällig am 21.12.2049 | | 4.520 | 5.485 | 0,17 |
| 2,442 % fällig am 21.12.2049 | | 735 | 891 | 0,02 |
| 2,942 % fällig am 21.12.2049 | | 367 | 443 | 0,01 |
| 3,442 % fällig am 21.12.2049 | | 210 | 253 | 0,01 |
| 3,942 % fällig am 21.12.2049 | | 210 | 253 | 0,01 |
| | | | 7.486 | 0,23 |
| Summe Großbritannien | | | 27.384 | 0,85 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Aames Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 2,104 % fällig am 25.04.2036 | $ | 3.225 | 3.017 | 0,09 |
| **Argent Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,104 % fällig am 25.05.2035 | | 487 | 437 | 0,01 |
| **Argent Securities Trust** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.07.2036 | | 1.023 | 906 | 0,03 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 1,864 % fällig am 25.02.2037 | | 1.781 | 1.720 | 0,05 |
| 2,749 % fällig am 25.11.2035 | | 3.660 | 3.554 | 0,11 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | | |
| 2,064 % fällig am 25.05.2047 | | 777 | 547 | 0,02 |
| 2,104 % fällig am 25.11.2036 | | 273 | 114 | 0,00 |
| 6,502 % fällig am 25.11.2036 | | 918 | 405 | 0,01 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 2,974 % fällig am 25.02.2033 | | 255 | 248 | 0,01 |
| **Humboldt Americas LLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 31.07.2022 | COP | 20.000.000 | 4.297 | 0,13 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 1,894 % fällig am 25.08.2036 | $ | 100 | 92 | 0,00 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 5,111 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 2.263 | 2.119 | 0,07 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,844 % fällig am 25.11.2036 | | 1.157 | 733 | 0,02 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 1,824 % fällig am 25.02.2037 | | 1.496 | 848 | 0,03 |
| 2,389 % fällig am 25.01.2035 | | 185 | 174 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,084 % fällig am 25.02.2037 | | 192 | 61 | 0,00 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,844 % fällig am 25.04.2037 | $ | 788 | $ 588 | 0,02 |
| 1,844 % fällig am 25.05.2037 | | 606 | 408 | 0,01 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,404 % fällig am 25.09.2035 | | 3.900 | 3.570 | 0,11 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 5,797 % fällig am 25.08.2036 | | 780 | 355 | 0,01 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | | |
| 1,934 % fällig am 25.09.2037 | | 322 | 310 | 0,01 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 1,794 % fällig am 25.08.2037 | | 642 | 568 | 0,02 |
| 2,124 % fällig am 25.11.2036 | | 79 | 74 | 0,00 |
| 2,149 % fällig am 25.03.2036 | | 848 | 839 | 0,03 |
| 2,524 % fällig am 25.10.2037 | | 1.429 | 1.125 | 0,04 |
| | | | 27.109 | 0,84 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **ENERGIE** | | | | |
| **Constellation Oil Services Holding S.A. (b)(h)** | | 4.243.669 | 460 | 0,01 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **DAE Funding LLC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 15.02.2024 | $ | 4.700 | 4.454 | 0,14 |
| 2,625 % fällig am 20.03.2025 | | 3.500 | 3.260 | 0,10 |
| 3,375 % fällig am 20.03.2028 | | 4.000 | 3.524 | 0,11 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 3,550 % fällig am 07.10.2022 | | 3.700 | 3.688 | 0,11 |
| **JPMorgan Structured Products BV** | | | | |
| 12,000 % fällig am 28.08.2026 (h) | ZMW | 65.400 | 2.642 | 0,08 |
| 12,000 % fällig am 04.01.2027 (h) | | 56.200 | 2.201 | 0,07 |
| 14,000 % fällig am 09.12.2031 (h) | | 73.700 | 2.576 | 0,08 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | | |
| 8,200 % fällig am 06.04.2028 | $ | 8.329 | 8.666 | 0,27 |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | | 2.699 | 2.799 | 0,09 |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027 | | 7.452 | 7.947 | 0,25 |
| **Rutas 2 and 7 Finance Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 30.09.2036 (c) | | 5.413 | 3.202 | 0,10 |
| | | | 44.959 | 1,40 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | | |
| 2,733 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 6 | 6 | 0,00 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 3,148 % fällig am 26.05.2037 | | 3.784 | 3.582 | 0,11 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,961 % fällig am 25.01.2035 | | 4 | 4 | 0,00 |
| 3,278 % fällig am 25.05.2047 ^ | | 100 | 94 | 0,00 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 2,752 % fällig am 25.05.2035 | | 69 | 67 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,396 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 190 | 173 | 0,01 |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,274 % fällig am 25.10.2036 | | 1.148 | 956 | 0,03 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,974 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 1.060 | 461 | 0,02 |
| 2,252 % fällig am 20.12.2035 | | 653 | 598 | 0,02 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,042 % fällig am 20.05.2036 ^ | | 93 | 88 | 0,00 |
| 3,093 % fällig am 25.11.2037 | | 453 | 427 | 0,01 |
| **Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust** | | | | |
| 1,482 % fällig am 25.11.2034 | | 248 | 233 | 0,01 |
| **Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,954 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 780 | 683 | 0,02 |
| **GSMPS Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,974 % fällig am 25.01.2036 | $ | 160 | $ 134 | 0,00 |
| **GSR Mortgage Loan Trust ^** | | | | |
| 2,867 % fällig am 25.01.2036 | | 27 | 27 | 0,00 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,476 % fällig am 19.10.2035 | | 105 | 65 | 0,00 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | | |
| 2,144 % fällig am 25.01.2036 | | 319 | 309 | 0,01 |
| **Impac CMB Trust** | | | | |
| 2,264 % fällig am 25.03.2035 | | 94 | 88 | 0,00 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,804 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 1.410 | 1.374 | 0,04 |
| 2,264 % fällig am 25.07.2045 | | 365 | 300 | 0,01 |
| 2,650 % fällig am 25.11.2037 | | 227 | 193 | 0,01 |
| **JPMorgan Resecuritization Trust** | | | | |
| 2,500 % fällig am 25.03.2056 | | 315 | 302 | 0,01 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 2,004 % fällig am 25.09.2046 | | 2.247 | 2.096 | 0,07 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 385 | 326 | 0,01 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,483 % fällig am 25.09.2037 | | 22 | 21 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.02.2037 | | 810 | 745 | 0,02 |
| **SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,741 % fällig am 25.10.2037 ^ | | 628 | 563 | 0,02 |
| **TBW Mortgage-Backed Trust** | | | | |
| 6,540 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 1.328 | 412 | 0,01 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 1,546 % fällig am 25.01.2046 | | 90 | 82 | 0,00 |
| 1,994 % fällig am 25.05.2034 | | 162 | 161 | 0,01 |
| 3,087 % fällig am 25.03.2036 | | 946 | 904 | 0,03 |
| 3,145 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 170 | 158 | 0,01 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,494 % fällig am 25.10.2036 | | 383 | 365 | 0,01 |
| | | | 15.997 | 0,50 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 1,868 % fällig am 01.12.2035 | | 9 | 9 | 0,00 |
| 2,323 % fällig am 01.03.2036 | | 15 | 15 | 0,00 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.02.2038 | | 1 | 1 | 0,00 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 | | 12.450 | 11.200 | 0,35 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2052 | | 14.100 | 13.548 | 0,42 |
| | | | 24.773 | 0,77 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | | |
| 1,750 % fällig am 15.08.2041 (i) | | 12.300 | 9.361 | 0,29 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.05.2029 (i) | | 7.900 | 7.569 | 0,24 |
| | | | 16.930 | 0,53 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **OPTIONSSCHEINE** | | | | |
| **Constellation Oil Services Holding S.A. - Exp. 10.06.2071 (h)** | | 5 | 0 | 0,00 |
| Summe USA | | | 130.228 | 4,05 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **USBEKISTAN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Uzbekistan Government International Bond** | | | | |
| 3,900 % fällig am 19.10.2031 | $ | 8.400 | 5.971 | 0,19 |
| **VENEZUELA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Petroleos de Venezuela S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 12.04.2027 ^ | | 73.690 | 4.403 | 0,14 |
| 5,500 % fällig am 12.04.2037 ^ | | 19.365 | 1.157 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 16.05.2024 ^ | | 3.500 | 220 | 0,01 |
| | | | 5.780 | 0,18 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Venezuela Government International Bond** | | | | |
| 7,000 % fällig am 31.03.2038 ^ | $ | 19.650 | $ 1.719 | 0,05 |
| 7,650 % fällig am 21.04.2025 ^ | | 6.624 | 580 | 0,02 |
| 7,750 % fällig am 13.10.2019 ^ | | 20.130 | 1.560 | 0,05 |
| 8,250 % fällig am 13.10.2024 ^ | | 12.483 | 1.061 | 0,03 |
| 9,000 % fällig am 07.05.2023 ^ | | 9.878 | 840 | 0,03 |
| 9,250 % fällig am 15.09.2027 ^ | | 13.410 | 1.173 | 0,04 |
| 9,250 % fällig am 07.05.2028 ^ | | 11.868 | 1.039 | 0,03 |
| 11,950 % fällig am 05.08.2031 ^ | | 2.930 | 256 | 0,01 |
| | | | 8.228 | 0,26 |
| Summe Venezuela | | | 14.008 | 0,44 |
| **VIETNAM** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Vietnam Government International Bond** | | | | |
| 4,800 % fällig am 19.11.2024 | | 500 | 499 | 0,02 |
| **JUNGFERNINSELN (BRITISCH)** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **1MDB Global Investments Ltd.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 09.03.2023 | | 11.200 | 10.862 | 0,34 |
| **Champion Path Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,850 % fällig am 27.01.2028 | | 6.400 | 3.761 | 0,12 |
| **CLP Power Hong Kong Financing Ltd.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 30.06.2030 | | 5.300 | 4.480 | 0,14 |
| **Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 | | 500 | 505 | 0,01 |
| **Studio City Finance Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2029 | | 3.500 | 1.813 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 15.07.2025 | $ | 3.000 | $ 1.904 | 0,06 |
| Summe Jungferninseln (Britisch) | | | 23.325 | 0,73 |
| **SAMBIA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Zambia Government International Bond** | | | | |
| 5,375 % fällig am 20.09.2022 ^ | | 4.050 | 2.322 | 0,07 |
| 8,500 % fällig am 14.04.2024 ^ | | 2.100 | 1.281 | 0,04 |
| 8,970 % fällig am 30.07.2027 ^ | | 5.100 | 2.999 | 0,09 |
| Summe Sambia | | | 6.602 | 0,20 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **ISRAEL TREASURY BILLS** | | | | |
| 0,860 % fällig am 03.05.2023 (c)(d) | ILS | 132.800 | 37.508 | 1,17 |
| **JAPAN TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,108) % fällig am 11.07.2022 (c)(d) | ¥ | 5.260.000 | 38.720 | 1,21 |
| **U.S. TREASURY BILLS** | | | | |
| 1,089 % fällig am 23.08.2022 (c)(d)(i)(j) | $ | 9.100 | 9.080 | 0,28 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 85.308 | 2,66 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **$ 2.915.389** | **90,71** |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (f)** | 250.000 | $ 2.123 | 0,07 |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Emerging Markets Opportunities Fund (f)** | 3.577.236 | 34.520 | 1,07 |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)** | 26.524.758 | 263.868 | 8,21 |
| **PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)** | 384.360 | 5.227 | 0,16 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$ 305.738** | **9,51** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 0,400 % | 30.06.2024 | 01.07.2022 | $ 11.538 | U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | $ 11.769 | $ 11.538 | $ 11.538 | 0,36 |
| MBC | 1,530 | 29.06.2022 | 06.07.2022 | 53.000 | U.S. Treasury Notes 0,500 % fällig am 28.02.2026 | 55.151 | 53.000 | 53.015 | 1,65 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ 66.920** | **$ 64.538** | **$ 64.553** | **2,01** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bobl September Futures | Long | 09.2022 | 438 | $ (23) | 0,00 |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 926 | 3.027 | 0,09 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 75 | 552 | 0,02 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 291 | 363 | 0,01 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 1.982 | 1.158 | 0,04 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 4.825 | (6.833) | (0,21) |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2022 | 116 | 149 | 0,00 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09.2022 | 493 | (2.253) | (0,07) |
| | | | | $ (3.860) | (0,12) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ (3.860)** | **(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 | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| General Electric Co. | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 1.500 | $ 6 | 0,00 |
| | | | | $ 6 | 0,00 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Asia Ex-Japan 37 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2027 | $ 5.700 | $ (76) | 0,00 |
| | | | | $ (76) | 0,00 |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 % | 15.06.2029 | $ 11.100 | $ (715) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,863 | 02.01.2023 | BRL 672.800 | (6.164) | (0,19) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 11,970 | 02.01.2024 | 350.300 | 1.086 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 21.06.2027 | $ 13.700 | (1.801) | (0,06) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 15.12.2028 | 400 | (39) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 | 15.12.2031 | 5.700 | (707) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 20.12.2022 | 149.170 | (5.445) | (0,17) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 21.12.2046 | 1.200 | 434 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 15.06.2046 | 600 | 223 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 5,950 | 30.11.2024 | ZAR 560.000 | 1.112 | 0,03 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | € 9.200 | 901 | 0,03 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 5,470 | 21.04.2025 | MXN 182.700 | 1.031 | 0,03 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 5,520 | 24.04.2025 | 175.900 | 999 | 0,03 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 5,530 | 24.04.2025 | 37.200 | 212 | 0,01 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 5,615 | 23.04.2025 | 719.200 | 4.133 | 0,13 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,080 | 26.02.2025 | 196.200 | (1.162) | (0,04) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,100 | 26.02.2025 | 58.000 | (344) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,100 | 28.02.2025 | 372.800 | (2.215) | (0,07) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,140 | 26.02.2025 | 65.000 | (388) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,150 | 26.02.2025 | 388.000 | (2.318) | (0,07) |
| | | | | | $ (11.167) | (0,35) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (11.237)** | **(0,35)** |

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

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

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

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

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Turkey Government International Bond | (1,000) % | 20.12.2026 | $ 8.500 | $ 1.413 | $ 725 | $ 2.138 | 0,07 |
| BPS | Russia Government International Bond | (1,000) | 20.12.2022 | 200 | 60 | 90 | 150 | 0,00 |
| CBK | Turkey Government International Bond | (1,000) | 20.12.2026 | 3.900 | 651 | 330 | 981 | 0,03 |
| GST | Russia Government International Bond | (1,000) | 20.12.2022 | 3.300 | 957 | 1.513 | 2.470 | 0,08 |
| | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2027 | 20.900 | (729) | 273 | (456) | (0,01) |
| HUS | Dubai Government International Bond | (1,000) | 20.12.2024 | 3.600 | (12) | (1) | (13) | 0,00 |
| JPM | Dubai Government International Bond | (1,000) | 20.12.2024 | 1.500 | (2) | (4) | (6) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | (1,000) | 20.06.2026 | 27.250 | 1.274 | 510 | 1.784 | 0,05 |
| | Turkey Government International Bond | (1,000) | 20.12.2025 | 6.300 | 608 | 717 | 1.325 | 0,04 |
| MYC | Turkey Government International Bond | (1,000) | 20.12.2026 | 800 | 135 | 66 | 201 | 0,01 |
| | | | | | $ 4.355 | $ 4.219 | $ 8.574 | 0,27 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2031 | $ 7.200 | $ (1.064) | $ (219) | $ (1.283) | (0,04) |
| | Chile Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 700 | 4 | (5) | (1) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 12.400 | 5 | (12) | (7) | 0,00 |
| | Montenegro Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | € 1.800 | (140) | 86 | (54) | 0,00 |
| | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.06.2026 | $ 2.900 | 26 | (22) | 4 | 0,00 |
| | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.12.2031 | 2.000 | (84) | (43) | (127) | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2031 | 6.780 | (851) | (4.226) | (5.077) | (0,16) |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2025 | 9.600 | (526) | 33 | (493) | (0,02) |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 5.500 | (1.085) | (393) | (1.478) | (0,05) |

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Chile Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2026 | $ 6.800 | $ 39 | $ (48) | $ (9) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 4.900 | 6 | (133) | (127) | 0,00 |
| | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.06.2026 | 32.100 | 116 | (69) | 47 | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 1.100 | (217) | (79) | (296) | (0,01) |
| BRC | Argentina Government International Bond | 5,000 | 20.12.2023 | 6.800 | (985) | (1.023) | (2.008) | (0,06) |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2030 | 4.000 | (554) | (117) | (671) | (0,02) |
| | QNB Finance Ltd, | 1,000 | 20.06.2023 | 3.600 | 28 | (4) | 24 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2031 | 1.100 | (112) | (711) | (823) | (0,03) |
| | Saudi Arabia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 15.687 | (277) | 499 | 222 | 0,01 |
| CBK | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 5.000 | (237) | (108) | (345) | (0,01) |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 500 | (5) | 0 | (5) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 6.000 | 11 | (167) | (156) | (0,01) |
| | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.06.2026 | 2.200 | 19 | (16) | 3 | 0,00 |
| | Saudi Arabia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 1.200 | (41) | 58 | 17 | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 2.600 | (516) | (183) | (699) | (0,02) |
| DUB | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 8.900 | (65) | 63 | (2) | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 12.300 | (546) | 123 | (423) | (0,01) |
| FBF | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 10.000 | 122 | (64) | 58 | 0,00 |
| GST | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2026 | 600 | (32) | 2 | (30) | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2031 | 4.100 | (621) | (109) | (730) | (0,02) |
| | Chile Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 3.600 | 33 | (38) | (5) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 2.700 | (40) | 27 | (13) | 0,00 |
| | Indonesia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 78.000 | 185 | (1.668) | (1.483) | (0,05) |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 100 | (1) | 1 | 0 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 4.200 | (18) | (122) | (140) | 0,00 |
| | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.06.2026 | 29.100 | 118 | (76) | 42 | 0,00 |
| | Saudi Arabia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 3.000 | 29 | 10 | 39 | 0,00 |
| | Saudi Arabia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 3.413 | 36 | 12 | 48 | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 15.300 | (691) | 164 | (527) | (0,02) |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 7.200 | (1.406) | (529) | (1.935) | (0,06) |
| HUS | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 400 | (6) | 7 | 1 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 100 | (1) | 1 | 0 | 0,00 |
| | Saudi Arabia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 9.700 | 103 | 21 | 124 | 0,00 |
| JPM | Argentina Government International Bond | 5,000 | 20.12.2023 | 4.700 | (703) | (684) | (1.387) | (0,04) |
| | Chile Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 7.700 | 41 | (51) | (10) | 0,00 |
| | Israel Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 6.100 | 144 | (34) | 110 | 0,00 |
| | Nigeria Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 9.100 | (216) | 179 | (37) | 0,00 |
| | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.06.2026 | 1.500 | 13 | (15) | (2) | 0,00 |
| | Saudi Arabia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 11.100 | 140 | 2 | 142 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 10.600 | (171) | 38 | (133) | 0,00 |
| MYC | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 9.100 | (564) | (197) | (761) | (0,02) |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2030 | 4.300 | (600) | (122) | (722) | (0,02) |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 1.500 | (1) | 4 | 3 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 100 | (1) | 1 | 0 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 500 | (2) | (15) | (17) | 0,00 |
| | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.06.2026 | 39.200 | 122 | (65) | 57 | 0,00 |
| | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 3.000 | (10) | (8) | (18) | 0,00 |
| | Saudi Arabia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 18.000 | 98 | 133 | 231 | 0,01 |
| MYI | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.06.2026 | 2.700 | 23 | (19) | 4 | 0,00 |
| | | | | | $ (10.928) | $ (9.930) | $ (20.858) | (0,65) |

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

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

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

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | £ | 12.025 | $ | 15.205 | $ 600 | $ 0 | $ 600 | 0,02 |
| | 07.2022 | ZAR | 206.954 | | 13.698 | 1.084 | 0 | 1.084 | 0,03 |
| | 08.2022 | PEN | 78.846 | | 20.060 | 0 | (617) | (617) | (0,02) |
| | 09.2022 | TRY | 35.264 | | 1.732 | 0 | (253) | (253) | (0,01) |
| | 09.2022 | $ | 10.380 | PEN | 40.097 | 104 | 0 | 104 | 0,00 |
| | 12.2022 | PEN | 26.439 | $ | 6.919 | 65 | 0 | 65 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | € | 3.166 | | 3.344 | 33 | 0 | 33 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 180.500 | | 1.397 | 68 | 0 | 68 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 45.650 | | 2.182 | 0 | (80) | (80) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 14.455 | BRL | 74.720 | 0 | (167) | (167) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 223.922 | € | 212.826 | 0 | (1.424) | (1.424) | (0,04) |
| | 07.2022 | | 2.271 | MXN | 45.650 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 2.953 | $ | 189 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08.2022 | COP | 18.440.841 | $ | 4.563 | $ 170 | $ 0 | $ 170 | 0,01 |
| | 08.2022 | € | 203.123 | | 214.035 | 1.287 | 0 | 1.287 | 0,04 |
| | 08.2022 | $ | 9.199 | PEN | 35.227 | 57 | (18) | 39 | 0,00 |
| | 09.2022 | MXN | 45.650 | $ | 2.238 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 10.2022 | TRY | 1.490 | | 88 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 12.2022 | | 40.163 | | 1.731 | 0 | (307) | (307) | (0,01) |
| BRC | 07.2022 | ¥ | 5.260.000 | | 43.009 | 4.279 | 0 | 4.279 | 0,13 |
| CBK | 07.2022 | $ | 11.925 | BRL | 59.330 | 0 | (579) | (579) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 1.732 | € | 1.622 | 0 | (36) | (36) | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN | 42.227 | $ | 11.061 | 7 | (14) | (7) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 12.483 | PEN | 47.508 | 7 | (29) | (22) | 0,00 |
| | 11.2022 | PEN | 2.329 | $ | 591 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 12.2022 | | 79.414 | | 20.665 | 78 | 0 | 78 | 0,00 |
| | 12.2022 | $ | 45.283 | PEN | 174.853 | 139 | (109) | 30 | 0,00 |
| | 02.2023 | PEN | 7.079 | $ | 1.781 | 0 | (46) | (46) | 0,00 |
| | 05.2023 | ILS | 131.671 | | 38.893 | 499 | 0 | 499 | 0,02 |
| | 05.2023 | PEN | 6.254 | | 1.582 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | $ | 205 | PLN | 893 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 12.2022 | ZAR | 65.691 | $ | 4.181 | 235 | 0 | 235 | 0,01 |
| GLM | 07.2022 | BRL | 101.603 | | 19.603 | 174 | 0 | 174 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 738 | BRL | 3.815 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 396 | MXN | 8.080 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 443 | ZAR | 7.127 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN | 6.952 | $ | 1.856 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 19.448 | BRL | 101.603 | 0 | (186) | (186) | (0,01) |
| | 10.2022 | ZAR | 245.721 | $ | 15.593 | 746 | 0 | 746 | 0,02 |
| MBC | 07.2022 | € | 2.735 | | 2.886 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 7.133 | € | 6.775 | 0 | (50) | (50) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | BRL | 36.262 | $ | 7.434 | 500 | 0 | 500 | 0,02 |
| | 07.2022 | £ | 29 | | 35 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | SGD | 37 | | 27 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 6 | AUD | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 380 | € | 362 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 337 | £ | 278 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 42 | SGD | 58 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNY | 23.827 | $ | 3.549 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | TRY | 118.850 | | 6.884 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | € | 8 | | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 7.147 | € | 6.856 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 58.834 | $ | 3.877 | 292 | 0 | 292 | 0,01 |
| | 08.2022 | CNY | 38.140 | | 5.699 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 09.2022 | ZAR | 59.904 | | 3.875 | 244 | 0 | 244 | 0,01 |
| | 11.2022 | PEN | 78.322 | | 18.895 | 0 | (1.432) | (1.432) | (0,04) |
| SOG | 07.2022 | € | 219.498 | | 235.919 | 6.445 | 0 | 6.445 | 0,20 |
| | 07.2022 | $ | 14.635 | £ | 12.025 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| | 08.2022 | £ | 12.025 | $ | 14.642 | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | € | 4 | | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | $ | 365 | HUF | 127.858 | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 143 | MXN | 2.825 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 403 | ZAR | 6.487 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 09.2022 | MXN | 52.589 | $ | 2.639 | 63 | 0 | 63 | 0,00 |
| | 10.2022 | TRY | 205.403 | | 12.178 | 1.123 | 0 | 1.123 | 0,03 |
| | 10.2022 | $ | 142 | MXN | 2.908 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ 18.448 | $ (5.507) | $ 12.941 | 0,40 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse M Retail AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | AUD | 364 | $ | 253 | $ 3 | $ 0 | $ 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 253 | AUD | 364 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | AUD | 428 | $ | 297 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 411 | AUD | 571 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 9 | $ | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 297 | AUD | 428 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | AUD | 29 | $ | 20 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1 | AUD | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | | 1 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | AUD | 157 | $ | 108 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 108 | AUD | 157 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | AUD | 15 | $ | 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 442 | AUD | 616 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | AUD | 368 | $ | 253 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1 | AUD | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 253 | | 368 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | AUD | 286 | $ | 197 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 197 | AUD | 286 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | | 414 | | 580 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | | | | | | $ 6 | $ (59) | $ (53) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | CHF 867 | $ 870 | $ 0 | $ (36) | $ (36) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 29.523 | CHF 28.212 | 0 | (54) | (54) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | 55 | 53 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | 29.503 | 28.239 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | CHF 26.261 | $ 27.647 | 216 | 0 | 216 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ 29.194 | CHF 28.003 | 56 | 0 | 56 | 0,00 |
| | 08.2022 | 27.647 | 26.217 | 0 | (214) | (214) | (0,01) |
| SCX | 07.2022 | CHF 371 | $ 389 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | $ 273 | $ (309) | $ (36) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | € 864 | $ 921 | $ 17 | $ 0 | $ 17 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | 462.234 | 486.141 | 2.899 | 0 | 2.899 | 0,09 |
| | 07.2022 | $ 16.141 | € 15.197 | 0 | (253) | (253) | (0,01) |
| | 08.2022 | 466.063 | 442.303 | 0 | (2.802) | (2.802) | (0,09) |
| CBK | 07.2022 | € 1 | $ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 1.726 | € 1.607 | 0 | (45) | (45) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | € 454.752 | $ 478.463 | 3.045 | (2) | 3.043 | 0,10 |
| | 07.2022 | $ 506.263 | € 469.481 | 0 | (15.444) | (15.444) | (0,48) |
| | 08.2022 | 466.149 | 442.303 | 0 | (2.889) | (2.889) | (0,09) |
| SOG | 07.2022 | 501.926 | 466.992 | 0 | (13.710) | (13.710) | (0,42) |
| UAG | 07.2022 | 434.450 | 404.290 | 0 | (11.786) | (11.786) | (0,37) |
| | | | | $ 5.961 | $ (46.931) | $ (40.970) | (1,27) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | £ 116 | $ 143 | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 24.844 | £ 19.650 | 0 | (981) | (981) | (0,03) |
| BPS | 07.2022 | £ 1.681 | $ 2.041 | 5 | (5) | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 296 | £ 239 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | £ 352 | $ 431 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 24.806 | £ 19.665 | 0 | (924) | (924) | (0,03) |
| CBK | 07.2022 | £ 42 | $ 52 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | $ 601 | £ 490 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | £ 104 | $ 126 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 13 | 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | 18.214 | 22.166 | 47 | 0 | 47 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 22.177 | £ 18.214 | 0 | (46) | (46) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | 24.524 | 19.452 | 0 | (900) | (900) | (0,03) |
| | | | | $ 59 | $ (2.869) | $ (2.810) | (0,09) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional PLN (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | PLN 83.122 | $ 19.378 | $ 890 | $ 0 | $ 890 | 0,03 |
| BRC | 07.2022 | $ 61 | PLN 264 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | PLN 5 | $ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 6.427 | PLN 27.651 | 0 | (277) | (277) | (0,01) |
| MBC | 07.2022 | 6.457 | 27.651 | 0 | (307) | (307) | (0,01) |
| SCX | 07.2022 | 61 | 264 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | PLN 787 | $ 176 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 6.543 | PLN 28.084 | 0 | (296) | (296) | (0,01) |
| | | | | $ 891 | $ (885) | $ 6 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend und Class E SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | SGD 5.958 | $ 4.287 | $ 6 | $ 0 | $ 6 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 9.557 | SGD 13.095 | 0 | (148) | (148) | 0,00 |
| | 08.2022 | 4.287 | 5.958 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | SGD 11.949 | $ 8.601 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 19 | SGD 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 8.601 | 11.950 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | SGD 29 | $ 21 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07.2022 | $ 167 | SGD 231 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | SGD 284 | $ 205 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 27 | SGD 37 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | 59 | 81 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 9.756 | 13.334 | 0 | (176) | (176) | (0,01) |
| UAG | 07.2022 | SGD 382 | $ 275 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 10.122 | SGD 13.860 | 0 | (163) | (163) | (0,01) |
| | | | | $ 22 | $ (509) | $ (487) | (0,02) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **$ (43.693)** | **(1,36)** |
| **Summe Anlagen** | | | | | | **$ 3.226.875** | **100,40** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | | | | | **$ (12.738)** | **(0,40)** |
| **Nettovermögen** | | | | | | **$ 3.214.137** | **100,00** |

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

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

**^** **Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a)** **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

**(b)** **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

**(c)** **Nullkuponwertpapier.**

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

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

**(f)** **Mit dem Fonds verbunden.**

**(g)** **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(h)** **Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|
| Constellation Oil Services Holding S.A. | 10.06.2022 | $ 460 | $ 460 | 0,01 |
| Constellation Oil Services Holding S.A. - Exp. 10. Juni 2071 | 10.06.2022 | 0 | 0 | 0,00 |
| Development Bank of Southern Africa 8,600 % fällig am 21.10.2024 | 07.10.2021 | 31.381 | 28.001 | 0,87 |
| JPMorgan Structured Products BV 12,000 fällig am 04.01.2027 | 15.06.2021 | 1.489 | 2.201 | 0,07 |
| JPMorgan Structured Products BV 12,000 fällig am 28.08.2026 | 15.06.2021 | 1.734 | 2.642 | 0,08 |
| JPMorgan Structured Products BV 14,000 fällig am 09.12.2031 | 24.05.2021 - 01.06.2021 | 1.784 | 2.576 | 0,08 |
| | | $ 36.848 | $ 35.880 | 1,11 |

**(i)** **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 112.014 und Barmittel in Höhe von USD 1.503 als Sicherheiten verpfändet.**

**(j)** **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurde zum 30. Juni 2022 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von USD 289 und Barmittel in Höhe von USD 44.726 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 167 als Sicherheiten erhalten.**

**Barmittel in Höhe von USD 22.670 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 2.836.420 | $ 78.968 | $ 2.915.389 |
| Investmentfonds | 305.738 | 0 | 0 | 305.738 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 64.538 | 0 | 64.538 |
| Finanzderivate[3] | 3.556 | (62.292) | (54) | (58.790) |
| **Summen** | **$ 309.295** | **$ 2.838.666** | **$ 78.914** | **$ 3.226.875** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 1 | $ 4.225.306 | $ 75.060 | $ 4.300.367 |
| Investmentfonds | 460.982 | 0 | 0 | 460.982 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 50.323 | 0 | 50.323 |
| Finanzderivate[3] | 3.442 | 8.806 | (94) | 12.154 |
| **Summen** | **$ 464.425** | **$ 4.284.435** | **$ 74.966** | **$ 4.823.826** |

(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 2022:**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | (1,500) % | 20.05.2022 | TBD[1] | $ (1.493) | $ (1.490) | (0,05) |
| | 1,220 | 22.03.2022 | 23.09.2022 | (3.965) | (3.978) | (0,12) |
| | 1,220 | 31.05.2022 | 23.09.2022 | (1.532) | (1.534) | (0,05) |
| | 1,450 | 12.04.2022 | 14.10.2022 | (50.999) | (51.163) | (1,59) |
| | 1,450 | 16.06.2022 | 14.10.2022 | (5.734) | (5.737) | (0,18) |
| BRC | (3,750) | 16.05.2022 | TBD[1] | (687) | (683) | (0,02) |
| | (0,900) | 15.11.2021 | TBD[1] | (1.571) | (1.562) | (0,05) |
| | (0,750) | 23.05.2022 | TBD[1] | (1.317) | (1.315) | (0,04) |
| | (0,750) | 31.05.2022 | TBD[1] | (1.260) | (1.258) | (0,04) |
| | (0,600) | 17.05.2022 | TBD[1] | (3.008) | (3.005) | (0,09) |
| | (0,600) | 25.05.2022 | TBD[1] | (1.002) | (1.001) | (0,03) |
| | (0,600) | 27.05.2022 | TBD[1] | (2.024) | (2.022) | (0,06) |
| | (0,250) | 24.11.2021 | TBD[1] | (963) | (954) | (0,03) |
| | (0,250) | 25.04.2022 | TBD[1] | (2.335) | (2.333) | (0,07) |
| | (0,250) | 10.06.2022 | TBD[1] | (1.037) | (1.036) | (0,03) |
| JML | 1,800 | 17.06.2022 | 29.07.2022 | (7.575) | (7.580) | (0,24) |
| MEI | 0,000 | 24.06.2022 | 23.06.2024 | (475) | (475) | (0,02) |
| | 1,500 | 17.06.2022 | TBD[1] | (13.134) | (13.142) | (0,41) |
| NOM | 1,550 | 17.06.2022 | TBD[1] | (7.361) | (7.366) | (0,23) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (107.634)** | **(3,35)** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (5.724) | $ 6.212 | $ 488 |
| BPS | (766) | 600 | (166) |
| BRC | 99 | 0 | 99 |
| CBK | (647) | 891 | 244 |
| DUB | (138) | 90 | (48) |
| FBF | 58 | 0 | 58 |
| GLM | 757 | (620) | 137 |
| GST | (2.720) | 2.400 | (320) |
| HUS | (112) | (150) | (38) |
| JPM | 1.786 | (1.360) | 426 |
| MBC | (15.645) | 14.150 | (1.495) |
| MYC | (1.026) | 997 | (29) |
| MYI | 481 | (480) | 1 |
| SCX | (1.041) | 1.210 | 169 |
| SOG | (7.265) | 7.520 | 255 |
| TOR | (900) | 950 | 50 |
| UAG | (11.114) | 9.932 | (1.182) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 75,89 | 77,77 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 14,30 | 13,32 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 0,52 | 0,12 |
| Investmentfonds | 9,51 | 9,78 |
| Pensionsgeschäfte | 2,01 | 1,07 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,12) | 0,09 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,35) | (0,19) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (1,36) | 0,35 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (3,35) | (3,53) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Angola | 0,27 | 1,12 |
| Argentinien | 1,76 | 2,17 |
| Armenien | k. A. | 0,22 |
| Österreich | k. A. | 0,05 |
| Aserbaidschan | 1,58 | 0,98 |
| Bahamas | 0,28 | 0,26 |
| Bahrain | 0,65 | 0,61 |
| Weissrussland | 0,01 | 0,04 |
| Brasilien | 3,01 | 3,15 |
| Kamerun | 0,18 | 0,17 |
| Cayman-Inseln | 3,84 | 3,81 |
| Chile | 3,30 | 2,56 |
| China | 1,49 | 2,34 |
| Kolumbien | 2,76 | 2,07 |
| Costa Rica | 0,42 | 0,31 |
| Dominikanische Republik | 2,28 | 1,93 |
| Ecuador | 0,95 | 1,10 |
| Ägypten | 1,88 | 3,67 |
| El Salvador | 0,20 | 0,25 |
| Äthiopien | 0,06 | 0,05 |
| Georgien | 0,01 | k. A. |
| Deutschland | 0,34 | 0,37 |
| Ghana | 1,07 | 1,12 |
| Guatemala | 0,81 | 1,13 |
| Hongkong | 0,77 | 0,91 |
| Ungarn | 0,74 | 0,24 |
| Indien | 0,57 | 0,84 |
| Indonesien | 5,38 | 5,40 |
| Irland | 0,49 | 0,45 |
| Israel | 0,70 | 0,53 |
| Elfenbeinküste | 0,88 | 1,38 |
| Jamaika | 0,09 | 0,07 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,68 | k. A. |
| Jordanien | 0,76 | 0,61 |
| Kasachstan | 1,24 | 0,95 |
| Kenia | 0,21 | 0,33 |
| Libanon | 0,02 | k. A. |
| Luxemburg | 0,84 | 1,64 |
| Malaysia | 0,84 | 0,60 |
| Marshallinseln | 0,02 | 0,01 |
| Mauritius | 0,09 | 0,07 |
| Mexiko | 7,41 | 7,28 |
| Mongolei | 0,28 | 0,45 |
| Marokko | 0,87 | 0,89 |
| Multinational | 0,27 | 0,22 |
| Namibia | 0,05 | 0,04 |
| Niederlande | 0,88 | 0,77 |
| Nigeria | 2,13 | 2,65 |
| Oman | 2,17 | 1,57 |
| Pakistan | 0,57 | 0,45 |
| Panama | 1,74 | 1,42 |
| Paraguay | 0,27 | 0,18 |
| Peru | 1,06 | 1,37 |
| Philippinen | 0,89 | 1,07 |
| Katar | 1,16 | 1,18 |
| Rumänien | 1,34 | 1,39 |
| Russland | 0,47 | 1,46 |
| Ruanda | k. A. | 0,05 |
| Saudi-Arabien | 3,06 | 2,77 |
| Senegal | 0,18 | 0,31 |
| Serbien | 0,50 | 0,23 |
| Singapur | 0,49 | 0,16 |
| Südafrika | 4,94 | 4,23 |
| Sri Lanka | 0,59 | 0,80 |
| Supranational | 0,30 | 0,29 |
| Tansania | 0,69 | 0,53 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Thailand | 0,26 | 0,14 |
| Trinidad und Tobago | k. A. | 0,01 |
| Tunesien | 0,09 | 0,07 |
| Türkei | 5,53 | 4,68 |
| Ukraine | 0,79 | 2,65 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 1,12 | 1,01 |
| Großbritannien | 0,85 | 1,00 |
| USA | 4,05 | 3,49 |
| Uruguay | k. A. | 0,00 |
| Usbekistan | 0,19 | k. A. |
| Venezuela | 0,44 | 0,22 |
| Vietnam | 0,02 | 0,01 |
| Jungferninseln (Britisch) | 0,73 | 0,62 |
| Sambia | 0,20 | 0,18 |
| Kurzfristige Instrumente | 2,66 | 1,86 |
| Investmentfonds | 9,51 | 9,78 |
| Pensionsgeschäfte | 2,01 | 1,07 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,12) | 0,09 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,00 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | 0,00 | 0,00 |
| Zinsswaps | (0,35) | (0,19) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Credit Default Swaps on Corporate. Sovereign and U.S. Municipal Issues — Buy Protection | 0,27 | 0,04 |
| Credit Default Swaps on Corporate. Sovereign and U.S. Municipal Issues — Sell Protection | (0,65) | (0,13) |
| Forward Foreign Currency Contracts | 0,40 | (0,01) |
| Hedged Forward Foreign Currency Contracts | (1,38) | 0,45 |
| Other Current Assets & Liabilities | (0,40) | (2,31) |
| Net Assets | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **ARGENTINIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 09.07.2030 | $ | 13.962 | $ 3.086 | 0,14 |
| 1,000 % fällig am 09.07.2029 | | 7.494 | 1.767 | 0,08 |
| 1,125 % fällig am 09.07.2035 | | 51.979 | 10.994 | 0,50 |
| 2,000 % fällig am 09.01.2038 | | 11.113 | 3.251 | 0,15 |
| 2,500 % fällig am 09.07.2041 | | 117.829 | 30.635 | 1,39 |
| **Provincia de Buenos Aires** | | | | |
| 3,900 % fällig am 01.09.2037 | | 4.800 | 1.481 | 0,07 |
| **Provincia de la Rioja** | | | | |
| 4,750 % fällig am 24.02.2028 ^ | | 425 | 259 | 0,01 |
| **Provincia de Neuquen** | | | | |
| 4,625 % fällig am 27.04.2030 ^ | | 320 | 192 | 0,01 |
| Summe Argentinien | | | 51.665 | 2,35 |
| **ARMENIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Republic of Armenien Government International Bond** | | | | |
| 3,600 % fällig am 02.02.2031 | | 7.700 | 5.353 | 0,24 |
| 3,950 % fällig am 26.09.2029 | | 800 | 598 | 0,03 |
| Summe Armenien | | | 5.951 | 0,27 |
| **ÖSTERREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Sappi Papier Holding GmbH** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.04.2026 | € | 300 | 280 | 0,01 |
| **BAHAMAS** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Bahamas Government International Bond** | | | | |
| 6,000 % fällig am 21.11.2028 | $ | 5.400 | 3.839 | 0,18 |
| 9,000 % fällig am 16.06.2029 | | 2.000 | 1.610 | 0,07 |
| Summe Bahamas | | | 5.449 | 0,25 |
| **BAHRAIN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Bahrain Government International Bond** | | | | |
| 4,250 % fällig am 25.01.2028 | | 15.500 | 13.950 | 0,63 |
| 5,250 % fällig am 25.01.2033 | | 3.000 | 2.439 | 0,11 |
| 5,625 % fällig am 30.09.2031 | | 5.900 | 5.099 | 0,23 |
| 6,000 % fällig am 19.09.2044 | | 2.300 | 1.714 | 0,08 |
| 6,125 % fällig am 05.07.2022 | | 1.500 | 1.502 | 0,07 |
| Summe Bahrain | | | 24.704 | 1,12 |
| **BENIN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Benin Government International Bond** | | | | |
| 4,950 % fällig am 22.01.2035 | € | 11.500 | 7.874 | 0,36 |
| **BERMUDA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Star Energy Geothermal Darajat** | | | | |
| 4,850 % fällig am 14.10.2038 | $ | 3.800 | 3.228 | 0,15 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcao** | | | | |
| 4,125 % fällig am 20.09.2031 | | 6.700 | 5.522 | 0,25 |
| **Banco BTG Pactual S.A.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 11.01.2026 | | 2.400 | 2.135 | 0,10 |
| 4,500 % fällig am 10.01.2025 | | 2.600 | 2.508 | 0,11 |
| **Banco do Brasil S.A.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 30.09.2026 | | 8.400 | 7.603 | 0,35 |
| 3,875 % fällig am 10.10.2022 | | 4.029 | 4.036 | 0,18 |
| **Brazil Minas SPE Via State of Minas Gerais** | | | | |
| 5,333 % fällig am 15.02.2028 | | 13.566 | 13.319 | 0,61 |
| **BRF S.A.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 21.09.2050 | | 4.000 | 2.669 | 0,12 |
| **CSN Inova Ventures** | | | | |
| 6,750 % fällig am 28.01.2028 | | 8.500 | 7.429 | 0,34 |
| **Globo Comunicacao e Participacoes S.A.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 22.01.2030 | | 200 | 157 | 0,01 |
| **Itau Unibanco Holding S.A.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 13.05.2023 | $ | 300 | $ 302 | 0,01 |
| **Natura Cosmeticos S.A.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 03.05.2028 | | 8.100 | 6.681 | 0,30 |
| **Rede D'or Finance SARL** | | | | |
| 4,500 % fällig am 22.01.2030 | | 263 | 222 | 0,01 |
| **Rumo Luxembourg SARL** | | | | |
| 5,250 % fällig am 10.01.2028 | | 4.800 | 4.512 | 0,21 |
| **Suzano Austria GmbH** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.01.2032 | | 3.000 | 2.266 | 0,10 |
| **XP, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 01.07.2026 | | 7.400 | 6.534 | 0,30 |
| | | | 65.895 | 3,00 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Brazil Government International Bond** | | | | |
| 4,250 % fällig am 07.01.2025 | | 300 | 298 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 14.01.2050 | | 22.375 | 15.227 | 0,69 |
| 5,000 % fällig am 27.01.2045 | | 5.395 | 3.867 | 0,18 |
| | | | 19.392 | 0,88 |
| Summe Brasilien | | | 85.287 | 3,88 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AAC Technologies Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 02.06.2026 | | 6.800 | 5.840 | 0,27 |
| **Alibaba Group Holding Ltd.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 09.02.2041 | | 5.000 | 3.444 | 0,16 |
| **Baidu, Inc.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 23.02.2027 | | 3.900 | 3.474 | 0,16 |
| 2,375 % fällig am 23.08.2031 (f) | | 3.900 | 3.233 | 0,15 |
| **Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 05.06.2034 (a) | | 5.055 | 3.210 | 0,15 |
| **CIFI Holdings Group Co. Ltd.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 17.08.2026 | | 2.900 | 1.651 | 0,08 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 12.07.2026 | | 3.300 | 1.550 | 0,07 |
| 3,875 % fällig am 22.10.2030 | | 1.800 | 760 | 0,03 |
| **Geely Automobile Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 09.12.2024 (c) | | 900 | 854 | 0,04 |
| **Hongkong Land Finance Cayman Islands Co. Ltd.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.07.2031 (f) | | 13.000 | 10.868 | 0,49 |
| **HPHT Finance Ltd.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 19.03.2026 | | 3.200 | 2.966 | 0,14 |
| **ICD Funding Ltd.** | | | | |
| 3,223 % fällig am 28.04.2026 | | 400 | 377 | 0,02 |
| **ICD Sukuk Co. Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.02.2027 | | 600 | 604 | 0,03 |
| **Interoceanica Finance Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 30.11.2025 (a) | | 579 | 511 | 0,02 |
| **Kaisa Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 9,375 % fällig am 30.06.2024 ^ | | 1.850 | 258 | 0,01 |
| 9,750 % fällig am 28.09.2023 ^ | | 300 | 42 | 0,00 |
| 11,250 % fällig am 09.04.2022 ^ | | 1.000 | 140 | 0,01 |
| 11,500 % fällig am 30.01.2023 ^ | | 200 | 28 | 0,00 |
| 11,650 % fällig am 01.06.2026 ^ | | 3.600 | 495 | 0,02 |
| 11,700 % fällig am 11.11.2025 ^ | | 1.450 | 202 | 0,01 |
| 11,950 % fällig am 12.11.2023 ^ | | 300 | 42 | 0,00 |
| **Lima Metro Line Finance Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 05.07.2034 | | 487 | 481 | 0,02 |
| **MAF Sukuk Ltd.** | | | | |
| 4,638 % fällig am 14.05.2029 | | 3.600 | 3.617 | 0,16 |
| **Powerlong Real Estate Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 30.04.2025 | | 3.400 | 544 | 0,02 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 28.03.2024 | | 300 | 299 | 0,01 |
| **SPARC EM SPC Panama Metro Line SP** | | | | |
| 0,000 % fällig am 05.12.2022 (a) | | 161 | 158 | 0,01 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 26.04.2024 ^ | | 1.500 | 229 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 10.01.2025 ^ | | 700 | 105 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 09.07.2025 ^ | | 3.500 | 525 | 0,02 |
| **Xiaomi Best Time International Ltd.** | | | | |
| 4,100 % fällig am 14.07.2051 | | 11.900 | 8.016 | 0,37 |
| **Zhongsheng Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 13.01.2026 | | 1.000 | 932 | 0,04 |
| Summe Cayman Inseln | | | 55.455 | 2,52 |
| **CHILE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Santander Chile** | | | | |
| 2,700 % fällig am 10.01.2025 | $ | 2.250 | $ 2.156 | 0,10 |
| **Corp. Nacional del Cobre de Chile** | | | | |
| 3,150 % fällig am 14.01.2030 | | 1.050 | 918 | 0,04 |
| 3,625 % fällig am 01.08.2027 | | 600 | 569 | 0,03 |
| 3,700 % fällig am 30.01.2050 | | 700 | 523 | 0,02 |
| 4,250 % fällig am 17.07.2042 | | 1.400 | 1.158 | 0,05 |
| 4,375 % fällig am 05.02.2049 | | 200 | 167 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2047 | | 500 | 426 | 0,02 |
| 4,875 % fällig am 04.11.2044 | | 300 | 267 | 0,01 |
| **Empresa de los Ferrocarriles del Estado** | | | | |
| 3,068 % fällig am 18.08.2050 | | 600 | 363 | 0,02 |
| 3,830 % fällig am 14.09.2061 | | 2.300 | 1.597 | 0,07 |
| **Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 10.09.2051 | | 13.700 | 10.147 | 0,46 |
| 4,250 % fällig am 07.05.2029 | | 1.600 | 1.529 | 0,07 |
| | | | 19.820 | 0,90 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Chile Government International Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.01.2027 | | 13.500 | 12.633 | 0,57 |
| 3,100 % fällig am 07.05.2041 | | 15.400 | 11.756 | 0,54 |
| 3,100 % fällig am 22.01.2061 | | 7.900 | 5.361 | 0,24 |
| 3,250 % fällig am 21.09.2071 | | 4.800 | 3.224 | 0,15 |
| 3,500 % fällig am 31.01.2034 | | 1.900 | 1.694 | 0,08 |
| 3,500 % fällig am 25.01.2050 | | 3.600 | 2.763 | 0,13 |
| 3,500 % fällig am 15.04.2053 | | 8.900 | 6.757 | 0,31 |
| 4,340 % fällig am 07.03.2042 | | 7.700 | 6.869 | 0,31 |
| | | | 51.057 | 2,33 |
| Summe Chile | | | 70.877 | 3,23 |
| **CHINA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Yango Justice International Ltd.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 17.02.2025 ^ | | 3.300 | 289 | 0,01 |
| 7,875 % fällig am 04.09.2024 ^ | | 2.000 | 175 | 0,01 |
| Summe China | | | 464 | 0,02 |
| **KOLUMBIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Davivienda S.A.** | | | | |
| 6,650 % fällig am 22.04.2031 (c)(d) | | 6.720 | 5.380 | 0,24 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Colombia Government International Bond** | | | | |
| 3,000 % fällig am 30.01.2030 | | 300 | 229 | 0,01 |
| 3,125 % fällig am 15.04.2031 | | 6.600 | 4.878 | 0,22 |
| 3,875 % fällig am 15.02.2061 | | 9.700 | 5.601 | 0,26 |
| 4,000 % fällig am 26.02.2024 | | 5.000 | 4.870 | 0,22 |
| 4,125 % fällig am 15.05.2051 (f) | | 19.800 | 11.908 | 0,54 |
| 5,000 % fällig am 15.06.2045 (f) | | 1.100 | 739 | 0,04 |
| 5,200 % fällig am 15.05.2049 (f) | | 7.700 | 5.242 | 0,24 |
| 5,625 % fällig am 26.02.2044 | | 1.000 | 722 | 0,03 |
| 6,125 % fällig am 18.01.2041 | | 11.400 | 8.971 | 0,41 |
| 10,375 % fällig am 28.01.2033 | | 1.350 | 1.606 | 0,07 |
| | | | 44.766 | 2,04 |
| Summe Kolumbien | | | 50.146 | 2,28 |
| **COSTA RICA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Costa Rica Government International Bond** | | | | |
| 4,250 % fällig am 26.01.2023 | | 10.080 | 10.052 | 0,46 |
| 5,625 % fällig am 30.04.2043 | | 19.350 | 14.568 | 0,66 |
| 7,000 % fällig am 04.04.2044 | | 1.900 | 1.640 | 0,07 |
| 7,158 % fällig am 12.03.2045 | | 2.400 | 2.097 | 0,10 |
| Summe Costa Rica | | | 28.357 | 1,29 |
| **DOMINIKANISCHE REPUBLIK** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Dominican Republic Government International Bond** | | | | |
| 4,500 % fällig am 30.01.2030 | | 3.000 | 2.417 | 0,11 |
| 5,300 % fällig am 21.01.2041 | | 9.100 | 6.339 | 0,29 |
| 5,500 % fällig am 27.01.2025 | | 2.500 | 2.488 | 0,11 |
| 5,500 % fällig am 22.02.2029 | | 7.400 | 6.460 | 0,29 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 5,875 % fällig am 30.01.2060 | $ | 37.800 | $25.959 | 1,18 |
| 5,950 % fällig am 25.01.2027 | | 18.400 | 17.611 | 0,80 |
| 6,000 % fällig am 19.07.2028 | | 1.520 | 1.418 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 22.02.2033 | | 1.700 | 1.420 | 0,07 |
| 6,400 % fällig am 05.06.2049 | | 2.500 | 1.874 | 0,09 |
| 6,500 % fällig am 15.02.2048 | | 200 | 152 | 0,01 |
| 6,850 % fällig am 27.01.2045 | | 100 | 79 | 0,00 |
| 6,875 % fällig am 29.01.2026 | | 4.500 | 4.602 | 0,21 |
| Summe Dominikanische Republik | | | 70.819 | 3,22 |
| **ECUADOR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ecuador Social Bond SARL** | | | | |
| 0,000 % fällig am 30.01.2035 (a) | | 3.687 | 2.822 | 0,13 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ecuador Government International Bond** | | | | |
| 0,000 % fällig am 31.07.2030 (a) | | 6.616 | 2.848 | 0,13 |
| 0,500 % fällig am 31.07.2040 | | 7.027 | 3.025 | 0,14 |
| 1,000 % fällig am 31.07.2035 | | 53.100 | 26.482 | 1,20 |
| 5,000 % fällig am 31.07.2030 | | 9.734 | 6.421 | 0,29 |
| | | | 38.776 | 1,76 |
| Summe Ecuador | | | 41.598 | 1,89 |
| **ÄGYPTEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Egypt Government International Bond** | | | | |
| 5,250 % fällig am 06.10.2025 | | 18.100 | 14.856 | 0,68 |
| 5,625 % fällig am 16.04.2030 | € | 1.100 | 717 | 0,03 |
| 5,875 % fällig am 16.02.2031 | $ | 3.800 | 2.372 | 0,11 |
| 6,375 % fällig am 11.04.2031 | € | 5.600 | 3.701 | 0,17 |
| 7,053 % fällig am 15.01.2032 | $ | 6.200 | 4.048 | 0,19 |
| 7,300 % fällig am 30.09.2033 | | 5.400 | 3.482 | 0,16 |
| 7,500 % fällig am 16.02.2061 | | 6.600 | 3.692 | 0,17 |
| 7,625 % fällig am 29.05.2032 | | 6.000 | 3.946 | 0,18 |
| 7,903 % fällig am 21.02.2048 | | 5.700 | 3.277 | 0,15 |
| 8,150 % fällig am 20.11.2059 | | 3.500 | 2.035 | 0,09 |
| 8,500 % fällig am 31.01.2047 | | 800 | 476 | 0,02 |
| 8,500 % fällig am 31.01.2047 | | 2.600 | 1.548 | 0,07 |
| 8,700 % fällig am 01.03.2049 | | 2.300 | 1.380 | 0,06 |
| 8,750 % fällig am 30.09.2051 | | 7.400 | 4.478 | 0,20 |
| Summe Ägypten | | | 50.008 | 2,28 |
| **EL SALVADOR** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **El Salvador Government International Bond** | | | | |
| 5,875 % fällig am 30.01.2025 | | 300 | 108 | 0,00 |
| 6,375 % fällig am 18.01.2027 | | 3.600 | 1.234 | 0,06 |
| 7,125 % fällig am 20.01.2050 | | 14.900 | 4.769 | 0,22 |
| 7,625 % fällig am 21.09.2034 | | 1.100 | 343 | 0,02 |
| 7,625 % fällig am 01.02.2041 | | 250 | 80 | 0,00 |
| 7,650 % fällig am 15.06.2035 | | 1.000 | 328 | 0,01 |
| 7,750 % fällig am 24.01.2023 | | 110 | 77 | 0,00 |
| 9,500 % fällig am 15.07.2052 | | 7.750 | 2.612 | 0,12 |
| Summe El Salvador | | | 9.551 | 0,43 |
| **GEORGIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Georgian Railway JSC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 17.06.2028 | | 11.000 | 9.188 | 0,42 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 3,700 % fällig am 30.05.2024 | | 600 | 590 | 0,03 |
| **GHANA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ghana Government International Bond** | | | | |
| 0,000 % fällig am 07.04.2025 (a)(f) | | 1.400 | 798 | 0,04 |
| 6,375 % fällig am 11.02.2027 | | 3.500 | 2.016 | 0,09 |
| 7,625 % fällig am 16.05.2029 | | 3.300 | 1.627 | 0,07 |
| 7,750 % fällig am 07.04.2029 | | 4.300 | 2.160 | 0,10 |
| 7,875 % fällig am 26.03.2027 (f) | | 1.100 | 642 | 0,03 |
| 7,875 % fällig am 11.02.2035 | | 6.100 | 2.876 | 0,13 |
| 8,125 % fällig am 26.03.2032 | | 12.500 | 6.085 | 0,28 |
| 8,625 % fällig am 07.04.2034 | | 8.200 | 3.991 | 0,18 |
| 8,627 % fällig am 16.06.2049 | $ | 1.600 | $ 760 | 0,04 |
| 8,750 % fällig am 11.03.2061 | | 31.950 | 15.169 | 0,69 |
| 8,875 % fällig am 07.05.2042 | | 1.100 | 533 | 0,02 |
| 8,950 % fällig am 26.03.2051 | | 5.600 | 2.666 | 0,12 |
| Summe Ghana | | | 39.323 | 1,79 |
| **GUERNSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 29.07.2026 | € | 3.500 | 2.945 | 0,13 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AIA Group Ltd.** | | | | |
| 3,200 % fällig am 16.09.2040 | $ | 200 | 160 | 0,01 |
| **Fortune Star BVI Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 19.10.2025 | | 4.000 | 2.565 | 0,12 |
| **Huarong Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 2,631 % fällig am 24.02.2023 | | 1.600 | 1.564 | 0,07 |
| 3,375 % fällig am 24.02.2030 | | 3.300 | 2.487 | 0,11 |
| 3,625 % fällig am 30.09.2030 | | 2.700 | 2.079 | 0,10 |
| 3,875 % fällig am 13.11.2029 | | 900 | 719 | 0,03 |
| 4,500 % fällig am 29.05.2029 | | 1.800 | 1.501 | 0,07 |
| 4,750 % fällig am 27.04.2027 | | 800 | 723 | 0,03 |
| 4,950 % fällig am 07.11.2047 | | 1.700 | 1.198 | 0,05 |
| **Lenovo Group Ltd.** | | | | |
| 3,421 % fällig am 02.11.2030 | | 1.500 | 1.279 | 0,06 |
| **MTR Corp. Ltd.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 19.08.2030 | | 6.300 | 5.257 | 0,24 |
| | | | 19.532 | 0,89 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Airport Authority Hong Kong** | | | | |
| 2,100 % fällig am 08.03.2026 (c) | | 1.800 | 1.636 | 0,07 |
| 2,400 % fällig am 08.03.2028 (c) | | 3.600 | 3.109 | 0,14 |
| 2,500 % fällig am 12.01.2032 | | 200 | 175 | 0,01 |
| **Hong Kong Government International Bond** | | | | |
| 2,375 % fällig am 02.02.2051 | | 1.200 | 853 | 0,04 |
| | | | 5.773 | 0,26 |
| Summe Hongkong | | | 25.305 | 1,15 |
| **UNGARN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Hungary Government International Bond** | | | | |
| 1,750 % fällig am 05.06.2035 | € | 8.400 | 6.212 | 0,28 |
| 2,125 % fällig am 22.09.2031 | $ | 20.150 | 15.618 | 0,71 |
| 3,125 % fällig am 21.09.2051 | | 6.400 | 4.244 | 0,19 |
| 5,250 % fällig am 16.06.2029 | | 11.600 | 11.588 | 0,53 |
| Summe Ungarn | | | 37.662 | 1,71 |
| **INDIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Adani Renewable Energy RJ Ltd.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.10.2039 | | 4.037 | 3.021 | 0,14 |
| **Indian Railway Finance Corp. Ltd.** | | | | |
| 3,570 % fällig am 21.01.2032 | | 11.400 | 9.776 | 0,44 |
| 3,835 % fällig am 13.12.2027 | | 3.500 | 3.330 | 0,15 |
| **JSW Hydro Energy Ltd.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 18.05.2031 | | 8.740 | 6.972 | 0,32 |
| **Muthoot Finance Ltd.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 02.09.2023 | | 900 | 876 | 0,04 |
| **ReNew Power Pvt Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 05.03.2027 | | 2.000 | 1.832 | 0,08 |
| **ReNew Wind Energy AP2** | | | | |
| 4,500 % fällig am 14.07.2028 | | 10.000 | 7.840 | 0,36 |
| **Shriram Transport Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 13.03.2024 | | 3.900 | 3.603 | 0,16 |
| **Wipro IT Services LLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 23.06.2026 | | 10.000 | 8.991 | 0,41 |
| Summe Indien | | | 46.241 | 2,10 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bank Mandiri Persero Tbk PT** | | | | |
| 2,000 % fällig am 19.04.2026 | | 6.700 | 6.080 | 0,28 |
| 3,750 % fällig am 11.04.2024 | | 2.000 | 1.989 | 0,09 |
| **Pelabuhan Indonesia Persero PT** | | | | |
| 4,250 % fällig am 05.05.2025 | $ | 3.700 | $ 3.653 | 0,17 |
| 5,375 % fällig am 05.05.2045 | | 1.000 | 937 | 0,04 |
| **Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia** | | | | |
| 4,700 % fällig am 06.06.2032 | | 18.100 | 17.822 | 0,81 |
| | | | 30.481 | 1,39 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 1,100 % fällig am 12.03.2033 | € | 1.700 | 1.269 | 0,06 |
| 1,300 % fällig am 23.03.2034 | | 11.400 | 8.491 | 0,39 |
| 4,750 % fällig am 18.07.2047 | $ | 4.400 | 4.060 | 0,18 |
| 5,125 % fällig am 15.01.2045 | | 1.200 | 1.153 | 0,05 |
| 5,250 % fällig am 08.01.2047 | | 200 | 195 | 0,01 |
| 7,750 % fällig am 17.01.2038 | | 2.180 | 2.599 | 0,12 |
| **Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia** | | | | |
| 3,875 % fällig am 06.04.2024 | | 800 | 797 | 0,04 |
| **Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia** | | | | |
| 3,550 % fällig am 09.06.2051 | | 5.500 | 4.308 | 0,19 |
| 3,800 % fällig am 23.06.2050 | | 3.500 | 2.825 | 0,13 |
| | | | 25.697 | 1,17 |
| Summe Indonesien | | | 56.178 | 2,56 |
| **IRLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC** | | | | |
| 5,950 % fällig am 15.04.2030 ^(d) | | 3.900 | 429 | 0,02 |
| **Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC** | | | | |
| 3,949 % fällig am 24.04.2023 ^ | | 1.700 | 459 | 0,02 |
| **Sovcombank Via SovCom Capital DAC** | | | | |
| 3,400 % fällig am 26.01.2025 ^ | | 5.400 | 378 | 0,02 |
| Summe Irland | | | 1.266 | 0,06 |
| **ELFENBEINKÜSTE** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Republik Côte d'Ivoire** | | | | |
| 5,000 % fällig am 19.03.2027 | € | 1.500 | 1.508 | 0,07 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ivory Coast Government International Bond** | | | | |
| 5,250 % fällig am 22.03.2030 | | 19.900 | 16.354 | 0,75 |
| 5,750 % fällig am 31.12.2032 | $ | 12.731 | 11.068 | 0,50 |
| 5,875 % fällig am 17.10.2031 | € | 1.400 | 1.151 | 0,05 |
| 6,625 % fällig am 22.03.2048 | | 2.900 | 2.042 | 0,09 |
| | | | 30.615 | 1,39 |
| Summe Elfenbeinküste | | | 32.123 | 1,46 |
| **JAMAIKA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **TransJamaican Highway Ltd.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 10.10.2036 | $ | 677 | 594 | 0,03 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Jamaica Government International Bond** | | | | |
| 7,875 % fällig am 28.07.2045 | | 3.300 | 3.476 | 0,16 |
| Summe Jamaika | | | 4.070 | 0,19 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Corsair International Ltd.** | | | | |
| 4,850 % fällig am 28.01.2027 | € | 7.900 | 7.796 | 0,36 |
| 5,200 % fällig am 28.01.2029 | | 3.400 | 3.320 | 0,15 |
| Summe Jersey, Kanalinseln | | | 11.116 | 0,51 |
| **JORDANIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Jordan Government International Bond** | | | | |
| 5,750 % fällig am 31.01.2027 | $ | 300 | 264 | 0,01 |
| 6,125 % fällig am 29.01.2026 | | 3.000 | 2.753 | 0,13 |
| 7,375 % fällig am 10.10.2047 | | 12.800 | 9.440 | 0,43 |
| 7,375 % fällig am 10.10.2047 | | 1.500 | 1.106 | 0,05 |
| Summe Jordanien | | | 13.563 | 0,62 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **KASACHSTAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Development Bank of Kazakhstan JSC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 10.12.2022 | $ | 6.900 | $ 6.887 | 0,31 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Kazakhstan Government International Bond** | | | | |
| 1,550 % fällig am 09.11.2023 | € | 6.840 | 7.062 | 0,32 |
| 2,375 % fällig am 09.11.2028 | | 3.000 | 2.843 | 0,13 |
| 4,875 % fällig am 14.10.2044 | $ | 11.600 | 9.692 | 0,44 |
| 6,500 % fällig am 21.07.2045 | | 22.200 | 22.368 | 1,02 |
| | | | 41.965 | 1,91 |
| Summe Kasachstan | | | 48.852 | 2,22 |
| **KENIA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Kenya Government International Bond** | | | | |
| 6,300 % fällig am 23.01.2034 (f) | | 8.500 | 5.329 | 0,24 |
| 6,875 % fällig am 24.06.2024 | | 12.900 | 10.836 | 0,49 |
| 8,000 % fällig am 22.05.2032 | | 6.400 | 4.558 | 0,21 |
| Summe Kenia | | | 20.723 | 0,94 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Amaggi Luxembourg International SARL** | | | | |
| 5,250 % fällig am 28.01.2028 | | 6.000 | 5.361 | 0,24 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 23.04.2027 | € | 2.400 | 2.007 | 0,09 |
| **NE Property BV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 20.01.2030 | | 5.600 | 4.166 | 0,19 |
| 3,375 % fällig am 14.07.2027 | | 2.300 | 2.074 | 0,10 |
| **Unigel Luxembourg S.A.** | | | | |
| 8,750 % fällig am 01.10.2026 | $ | 1.400 | 1.388 | 0,06 |
| Summe Luxemburg | | | 14.996 | 0,68 |
| **MALAYSIA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Axiata SPV5 Labuan Ltd.** | | | | |
| 3,064 % fällig am 19.08.2050 | | 4.900 | 3.519 | 0,16 |
| **MAURITIUS** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Azure Power Energy Ltd.** | | | | |
| 3,575 % fällig am 19.08.2026 | | 9.444 | 7.828 | 0,35 |
| **Greenko Dutch BV** | | | | |
| 3,850 % fällig am 29.03.2026 | | 8.536 | 7.261 | 0,33 |
| **Greenko Solar Mauritius Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 29.07.2026 | | 7.300 | 6.525 | 0,30 |
| **India Green Energy Holdings** | | | | |
| 5,375 % fällig am 29.04.2024 | | 9.400 | 8.795 | 0,40 |
| Summe Mauritius | | | 30.409 | 1,38 |
| **MEXIKO** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **America Movil S.A.B. de C.V.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 04.04.2032 | | 6.500 | 5.783 | 0,26 |
| 6,450 % fällig am 05.12.2022 | MXN | 2.000 | 98 | 0,00 |
| **Banco Mercantil del Norte S.A.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 24.01.2032 (c)(d) | $ | 2.000 | 1.637 | 0,08 |
| 7,500 % fällig am 27.06.2029 (c)(d) | | 3.400 | 3.084 | 0,14 |
| 7,625 % fällig am 10.01.2028 (c)(d) | | 300 | 279 | 0,01 |
| 8,375 % fällig am 14.10.2030 (c)(d) | | 400 | 387 | 0,02 |
| **Banco Santander Mexico S.A.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 09.11.2022 | | 400 | 401 | 0,02 |
| **BBVA Bancomer S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 30.09.2022 | | 17.240 | 17.299 | 0,79 |
| **Cibanco S.A. Ibm** | | | | |
| 4,962 % fällig am 18.07.2029 | | 2.700 | 2.419 | 0,11 |
| **Corp. GEO S.A.B. de C.V.** | | | | |
| 8,875 % fällig am 25.09.2014 ^ | | 500 | 0 | 0,00 |
| **Metalsa S.A. de C.V.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 04.05.2031 | $ | 10.600 | $ 7.505 | 0,34 |
| **Trust Fibra Uno** | | | | |
| 6,390 % fällig am 15.01.2050 | | 2.000 | 1.595 | 0,07 |
| | | | 40.487 | 1,84 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 1,350 % fällig am 18.09.2027 | € | 1.000 | 923 | 0,04 |
| 2,250 % fällig am 12.08.2036 | | 9.700 | 7.063 | 0,32 |
| 2,659 % fällig am 24.05.2031 | $ | 400 | 330 | 0,02 |
| 3,750 % fällig am 19.04.2071 | | 7.200 | 4.599 | 0,21 |
| 3,771 % fällig am 24.05.2061 | | 8.200 | 5.341 | 0,24 |
| 5,000 % fällig am 27.04.2051 | | 200 | 167 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 12.10.2110 (f) | | 16.340 | 13.776 | 0,63 |
| | | | 32.199 | 1,47 |
| Summe Mexiko | | | 72.686 | 3,31 |
| **MONGOLEI** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Mongolia Government International Bond** | | | | |
| 3,500 % fällig am 07.07.2027 | | 15.800 | 12.837 | 0,58 |
| 5,125 % fällig am 07.04.2026 | | 1.100 | 992 | 0,05 |
| 5,625 % fällig am 01.05.2023 | | 2.530 | 2.495 | 0,11 |
| Summe Mongolei | | | 16.324 | 0,74 |
| **MAROKKO** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Morocco Government International Bond** | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.12.2027 | | 5.910 | 4.775 | 0,22 |
| 4,000 % fällig am 15.12.2050 | | 22.000 | 12.925 | 0,59 |
| 4,250 % fällig am 11.12.2022 | | 2.300 | 2.301 | 0,10 |
| 5,500 % fällig am 11.12.2042 | | 4.600 | 3.366 | 0,15 |
| Summe Marokko | | | 23.367 | 1,06 |
| **MULTINATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **NXP BV** | | | | |
| 3,400 % fällig am 01.05.2030 | | 500 | 442 | 0,02 |
| **NAMIBIA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Namibia Government International Bond** | | | | |
| 5,250 % fällig am 29.10.2025 | | 2.300 | 2.046 | 0,09 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Atrium Finance Issuer BV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.09.2027 | € | 8.000 | 6.770 | 0,31 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 1,125 % fällig am 07.12.2028 | £ | 4.000 | 4.070 | 0,18 |
| 1,400 % fällig am 01.07.2026 | $ | 7.900 | 7.184 | 0,33 |
| **InterCement Financial Operations BV** | | | | |
| 5,750 % fällig am 17.07.2024 | | 200 | 153 | 0,01 |
| **Kazakhstan Temir Zholy Finance BV** | | | | |
| 6,950 % fällig am 10.07.2042 | | 8.100 | 7.377 | 0,33 |
| **Metinvest BV** | | | | |
| 7,750 % fällig am 23.04.2023 | | 200 | 119 | 0,01 |
| 8,500 % fällig am 23.04.2026 | | 1.100 | 577 | 0,03 |
| **Prosus NV** | | | | |
| 1,539 % fällig am 03.08.2028 | € | 800 | 664 | 0,03 |
| 2,031 % fällig am 03.08.2032 | | 400 | 290 | 0,01 |
| 3,061 % fällig am 13.07.2031 | $ | 2.000 | 1.474 | 0,07 |
| 3,257 % fällig am 19.01.2027 | | 2.200 | 1.914 | 0,09 |
| 3,680 % fällig am 21.01.2030 | | 400 | 319 | 0,01 |
| 4,027 % fällig am 03.08.2050 | | 800 | 498 | 0,02 |
| Summe Niederlande | | | 31.409 | 1,43 |
| **OMAN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Oman Government International Bond** | | | | |
| 4,125 % fällig am 17.01.2023 | | 7.424 | 7.424 | 0,34 |
| 4,750 % fällig am 15.06.2026 | | 4.600 | 4.395 | 0,20 |
| 4,875 % fällig am 01.02.2025 | | 3.000 | 2.942 | 0,13 |
| 5,375 % fällig am 08.03.2027 | | 5.600 | 5.455 | 0,25 |
| 5,625 % fällig am 17.01.2028 | $ | 8.200 | $ 7.910 | 0,36 |
| 6,000 % fällig am 01.08.2029 | | 14.200 | 13.713 | 0,62 |
| 6,250 % fällig am 25.01.2031 | | 7.700 | 7.456 | 0,34 |
| 6,500 % fällig am 08.03.2047 | | 3.550 | 2.992 | 0,14 |
| 6,750 % fällig am 28.10.2027 | | 16.600 | 16.965 | 0,77 |
| 6,750 % fällig am 17.01.2048 | | 4.000 | 3.462 | 0,16 |
| 7,000 % fällig am 25.01.2051 | | 7.500 | 6.634 | 0,30 |
| 7,375 % fällig am 28.10.2032 | | 3.450 | 3.574 | 0,16 |
| **Oman Sovereign Sukuk Co.** | | | | |
| 4,397 % fällig am 01.06.2024 | | 1.500 | 1.484 | 0,07 |
| Summe Oman | | | 84.406 | 3,84 |
| **PANAMA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 11.08.2061 | | 2.900 | 2.302 | 0,11 |
| **Banco General S.A.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 07.05.2031 (c) | | 6.500 | 5.947 | 0,27 |
| **Banco Nacional de Panamá** | | | | |
| 2,500 % fällig am 11.08.2030 | | 600 | 478 | 0,02 |
| **Empresa de Transmision Electrica S.A.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 02.05.2049 | | 1.000 | 840 | 0,04 |
| | | | 9.567 | 0,44 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Panama Government International Bond** | | | | |
| 2,252 % fällig am 29.09.2032 | | 4.300 | 3.363 | 0,15 |
| 3,160 % fällig am 23.01.2030 | | 1.800 | 1.603 | 0,07 |
| 3,870 % fällig am 23.07.2060 | | 8.500 | 6.034 | 0,27 |
| 4,000 % fällig am 22.09.2024 | | 1.430 | 1.428 | 0,07 |
| 4,300 % fällig am 29.04.2053 | | 2.500 | 1.970 | 0,09 |
| 4,500 % fällig am 15.05.2047 | | 7.000 | 5.766 | 0,26 |
| 4,500 % fällig am 16.04.2050 | | 10.800 | 8.815 | 0,40 |
| 4,500 % fällig am 01.04.2056 | | 16.000 | 12.738 | 0,58 |
| 4,500 % fällig am 19.01.2063 | | 18.500 | 14.283 | 0,65 |
| 6,700 % fällig am 26.01.2036 | | 7.500 | 8.129 | 0,37 |
| 8,125 % fällig am 28.04.2034 | | 1.000 | 1.257 | 0,06 |
| 9,375 % fällig am 16.01.2023 | | 180 | 185 | 0,01 |
| 9,375 % fällig am 01.04.2029 | | 1.000 | 1.225 | 0,06 |
| | | | 66.796 | 3,04 |
| Summe Panama | | | 76.363 | 3,48 |
| **PARAGUAY** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Paraguay Government International Bond** | | | | |
| 2,739 % fällig am 29.01.2033 | | 1.900 | 1.418 | 0,06 |
| 3,849 % fällig am 28.06.2033 | | 1.900 | 1.554 | 0,07 |
| 4,700 % fällig am 27.03.2027 | | 2.300 | 2.213 | 0,10 |
| 5,400 % fällig am 30.03.2050 | | 13.200 | 10.280 | 0,47 |
| 5,600 % fällig am 13.03.2048 | | 1.800 | 1.428 | 0,07 |
| 6,100 % fällig am 11.08.2044 | | 2.500 | 2.185 | 0,10 |
| Summe Paraguay | | | 19.078 | 0,87 |
| **PERU** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Cia de Minas Buenaventura SAA** | | | | |
| 5,500 % fällig am 23.07.2026 | | 1.400 | 1.262 | 0,06 |
| **InRetail Consumer** | | | | |
| 3,250 % fällig am 22.03.2028 | | 3.700 | 3.077 | 0,14 |
| | | | 4.339 | 0,20 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Fondo MIVIVIENDA S.A.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 12.04.2027 | | 12.500 | 12.114 | 0,55 |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 1,950 % fällig am 17.11.2036 | € | 8.300 | 5.973 | 0,27 |
| 3,000 % fällig am 15.01.2034 | $ | 8.100 | 6.665 | 0,30 |
| 3,230 % fällig am 28.07.2121 | | 3.300 | 2.033 | 0,09 |
| 3,600 % fällig am 15.01.2072 | | 6.500 | 4.416 | 0,20 |
| 6,550 % fällig am 14.03.2037 | | 2.842 | 3.090 | 0,14 |
| 7,350 % fällig am 21.07.2025 | | 300 | 324 | 0,02 |
| | | | 34.615 | 1,57 |
| Summe Peru | | | 38.954 | 1,77 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **PHILIPPINEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Globe Telecom, Inc.** | | | | |
| 4,200 % fällig am 02.08.2026 (c) | $ | 6.700 | $ 6.317 | 0,29 |
| **Jollibee Worldwide Pte. Ltd.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 24.01.2026 | | 2.100 | 2.058 | 0,09 |
| 4,750 % fällig am 24.06.2030 | | 3.300 | 3.135 | 0,14 |
| **PLDT, Inc.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 23.01.2031 | | 1.000 | 838 | 0,04 |
| 3,450 % fällig am 23.06.2050 | | 3.900 | 2.983 | 0,14 |
| | | | 15.331 | 0,70 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Philippines Government International Bond** | | | | |
| 2,650 % fällig am 10.12.2045 | | 2.800 | 1.954 | 0,09 |
| 2,950 % fällig am 05.05.2045 | | 14.500 | 10.446 | 0,48 |
| 3,200 % fällig am 06.07.2046 | | 12.900 | 9.706 | 0,44 |
| 3,700 % fällig am 01.03.2041 | | 300 | 250 | 0,01 |
| | | | 22.356 | 1,02 |
| Summe Philippinen | | | 37.687 | 1,72 |
| **KATAR** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 4,400 % fällig am 16.04.2050 (f) | | 20.600 | 19.712 | 0,90 |
| 4,817 % fällig am 14.03.2049 | | 8.300 | 8.376 | 0,38 |
| 5,103 % fällig am 23.04.2048 | | 1.000 | 1.050 | 0,05 |
| Summe Katar | | | 29.138 | 1,33 |
| **RUMÄNIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Romania Government International Bond** | | | | |
| 1,750 % fällig am 13.07.2030 (f) | € | 6.100 | 4.559 | 0,21 |
| 2,000 % fällig am 08.12.2026 | | 300 | 281 | 0,01 |
| 2,124 % fällig am 16.07.2031 | | 1.500 | 1.114 | 0,05 |
| 2,124 % fällig am 16.07.2031 (f) | | 31.610 | 23.470 | 1,07 |
| 2,125 % fällig am 07.03.2028 | | 4.600 | 3.968 | 0,18 |
| 2,625 % fällig am 02.12.2040 | | 3.950 | 2.407 | 0,11 |
| 2,750 % fällig am 14.04.2041 | | 7.800 | 4.780 | 0,22 |
| 2,875 % fällig am 26.05.2028 | | 100 | 90 | 0,00 |
| 2,875 % fällig am 13.04.2042 | | 8.600 | 5.278 | 0,24 |
| 3,375 % fällig am 28.01.2050 | | 6.200 | 3.857 | 0,18 |
| 3,500 % fällig am 03.04.2034 | | 3.000 | 2.297 | 0,10 |
| 3,750 % fällig am 07.02.2034 | | 950 | 747 | 0,03 |
| 4,000 % fällig am 14.02.2051 | $ | 3.550 | 2.325 | 0,11 |
| 4,625 % fällig am 03.04.2049 | € | 400 | 298 | 0,01 |
| Summe Rumänien | | | 55.471 | 2,52 |
| **RUSSLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **MMK International Capital DAC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 13.06.2024 | $ | 2.800 | 1.008 | 0,05 |
| **SENEGAL** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Senegal Government International Bond** | | | | |
| 4,750 % fällig am 13.03.2028 | € | 1.200 | 1.025 | 0,05 |
| 5,375 % fällig am 08.06.2037 | | 5.800 | 3.824 | 0,17 |
| 6,250 % fällig am 23.05.2033 | $ | 10.600 | 8.162 | 0,37 |
| 6,750 % fällig am 13.03.2048 | | 600 | 384 | 0,02 |
| Summe Senegal | | | 13.395 | 0,61 |
| **SERBIEN** | | | | |
| **Serbia Government International Bond** | | | | |
| 1,000 % fällig am 23.09.2028 | € | 6.200 | 4.735 | 0,22 |
| 1,650 % fällig am 03.03.2033 | | 14.400 | 9.478 | 0,43 |
| 3,125 % fällig am 15.05.2027 | | 7.300 | 6.696 | 0,30 |
| Summe Serbien | | | 20.909 | 0,95 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 25.03.2027 | $ | 5.488 | 4.375 | 0,20 |
| **Continuum Energy Levanter Pte. Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 09.02.2027 | $ | 5.918 | $ 4.679 | 0,21 |
| **Flex Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.06.2029 | | 200 | 193 | 0,01 |
| **United Overseas Bank Ltd.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 14.04.2026 | | 6.500 | 5.972 | 0,27 |
| Summe Singapur | | | 15.219 | 0,69 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Absa Group Ltd.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 27.05.2026 (c)(d) | | 3.500 | 3.178 | 0,15 |
| **Development Bank of Southern Africa** | | | | |
| 8,600 % fällig am 21.10.2024 (e) | ZAR | 253.300 | 15.178 | 0,69 |
| **Growthpoint Properties International Pty. Ltd.** | | | | |
| 5,872 % fällig am 02.05.2023 | $ | 1.300 | 1.299 | 0,06 |
| | | | 19.655 | 0,90 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 4,300 % fällig am 12.10.2028 | | 12.000 | 10.281 | 0,47 |
| 4,850 % fällig am 27.09.2027 | | 3.200 | 2.925 | 0,13 |
| 4,850 % fällig am 30.09.2029 | | 6.000 | 5.140 | 0,23 |
| 5,000 % fällig am 12.10.2046 | | 2.000 | 1.296 | 0,06 |
| 5,750 % fällig am 30.09.2049 | | 30.800 | 21.129 | 0,96 |
| 5,875 % fällig am 20.04.2032 | | 13.500 | 11.557 | 0,53 |
| 7,300 % fällig am 20.04.2052 | | 11.000 | 8.824 | 0,40 |
| | | | 61.152 | 2,78 |
| Summe Südafrika | | | 80.807 | 3,68 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Hana Bank** | | | | |
| 3,500 % fällig am 19.10.2026 (c)(d) | | 6.500 | 5.997 | 0,27 |
| **Hanwha Life Insurance Co. Ltd.** | | | | |
| 3,379 % fällig am 04.02.2032 | | 6.700 | 6.119 | 0,28 |
| **Hyundai Capital Services, Inc.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 08.02.2026 | | 8.200 | 7.386 | 0,34 |
| **KB Kookmin Card Co. Ltd.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 13.05.2026 | | 10.000 | 8.993 | 0,41 |
| 4,000 % fällig am 09.06.2025 | | 7.900 | 7.831 | 0,36 |
| **Kia Corp.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 16.04.2024 | | 5.200 | 4.955 | 0,23 |
| **Kookmin Bank** | | | | |
| 1,375 % fällig am 06.05.2026 | | 8.700 | 7.960 | 0,36 |
| 2,500 % fällig am 04.11.2030 (d) | | 2.500 | 2.112 | 0,10 |
| **Mirae Asset Securities Co. Ltd.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 07.07.2024 | | 17.600 | 16.583 | 0,75 |
| **NongHyup Bank** | | | | |
| 1,250 % fällig am 28.07.2026 | | 13.000 | 11.682 | 0,53 |
| **Shinhan Bank Co. Ltd.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 21.10.2026 | | 7.500 | 6.815 | 0,31 |
| 4,375 % fällig am 13.04.2032 (d) | | 9.000 | 8.688 | 0,40 |
| **Shinhan Card Co. Ltd.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 19.10.2025 | | 3.000 | 2.739 | 0,12 |
| 1,375 % fällig am 23.06.2026 | | 3.000 | 2.678 | 0,12 |
| **Shinhan Financial Group Co. Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 12.05.2026 (c)(d) | | 8.000 | 7.120 | 0,32 |
| 3,340 % fällig am 05.02.2030 (d) | | 5.100 | 4.932 | 0,22 |
| **SK Hynix, Inc.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 19.01.2031 | | 5.300 | 4.181 | 0,19 |
| **Woori Card Co. Ltd.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 23.03.2026 | | 6.000 | 5.470 | 0,25 |
| | | | 122.241 | 5,56 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Export-Import Bank of Korea** | | | | |
| 2,125 % fällig am 18.01.2032 | | 7.200 | 6.190 | 0,28 |
| 2,500 % fällig am 29.06.2041 | | 5.400 | 4.310 | 0,20 |
| **Korea Expressway Corp.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 17.05.2026 | | 4.800 | 4.347 | 0,20 |
| **Korea Water Resources Corp.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 27.04.2025 | $ | 6.500 | $ 6.459 | 0,29 |
| **South Korea Government International Bond** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.10.2026 (a) | € | 5.000 | 4.841 | 0,22 |
| | | | 26.147 | 1,19 |
| Summe Südkorea | | | 148.388 | 6,75 |
| **SRI LANKA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Sri Lanka Government International Bond** | | | | |
| 5,750 % fällig am 18.04.2023 ^ | $ | 6.900 | 2.239 | 0,10 |
| 5,875 % fällig am 25.07.2022 ^ | | 1.236 | 517 | 0,02 |
| 6,125 % fällig am 03.06.2025 ^ | | 3.700 | 1.233 | 0,06 |
| 6,200 % fällig am 11.05.2027 ^ | | 7.100 | 2.310 | 0,11 |
| 6,750 % fällig am 18.04.2028 ^ | | 6.800 | 2.195 | 0,10 |
| 6,825 % fällig am 18.07.2026 ^ | | 3.800 | 1.319 | 0,06 |
| 6,850 % fällig am 14.03.2024 ^ | | 900 | 293 | 0,01 |
| 6,850 % fällig am 03.11.2025 ^ | | 3.000 | 989 | 0,05 |
| 7,550 % fällig am 28.03.2030 ^ | | 17.400 | 5.635 | 0,26 |
| 7,850 % fällig am 14.03.2029 ^ | | 1.600 | 525 | 0,02 |
| Summe Sri Lanka | | | 17.255 | 0,79 |
| **SUPRANATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **African Export-Import Bank** | | | | |
| 2,634 % fällig am 17.05.2026 | | 5.500 | 4.865 | 0,22 |
| **Asian Development Bank** | | | | |
| 4,700 % fällig am 12.03.2024 | MXN | 89.800 | 4.064 | 0,18 |
| 6,550 % fällig am 26.01.2025 | ZAR | 118.000 | 6.995 | 0,32 |
| **Banque Ouest Africaine de Developpement** | | | | |
| 2,750 % fällig am 22.01.2033 | € | 5.400 | 4.534 | 0,21 |
| 5,000 % fällig am 27.07.2027 | $ | 800 | 731 | 0,03 |
| **Eastern & Southern African Trade & Development Bank** | | | | |
| 4,125 % fällig am 30.06.2028 | | 16.800 | 13.952 | 0,64 |
| **Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung** | | | | |
| 5,310 % fällig am 05.02.2026 | ZAR | 114.000 | 6.318 | 0,29 |
| **International Finance Corp.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 09.10.2023 | IDR | 57.500.000 | 3.983 | 0,18 |
| | | | 45.442 | 2,07 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ghana Government International Bond** | | | | |
| 10,750 % fällig am 14.10.2030 | $ | 200 | 173 | 0,01 |
| Summe Supranational | | | 45.615 | 2,08 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 9,750 % fällig am 23.06.2027 (c)(d) | | 5.900 | 6.040 | 0,27 |
| **TANSANIA** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **The Ministry of Finance and Planning, Government of the United Republic of Tanzania** | | | | |
| 5,400 % fällig am 26.04.2028 | € | 7.900 | 8.280 | 0,38 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **TUNESIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Banque Centrale de Tunisie Government International Bond** | | | | |
| 5,625 % fällig am 17.02.2024 | € | 1.200 | $ 738 | 0,03 |
| 5,750 % fällig am 30.01.2025 | $ | 1.400 | 783 | 0,04 |
| 6,375 % fällig am 15.07.2026 | € | 900 | 510 | 0,02 |
| 6,750 % fällig am 31.10.2023 | | 601 | 438 | 0,02 |
| Summe Tunesien | | | 2.469 | 0,11 |
| **TÜRKEI** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Akbank T.A.S.** | | | | |
| 6,800 % fällig am 22.06.2031 (d) | $ | 6.500 | 5.545 | 0,25 |
| **Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S** | | | | |
| 5,004 % fällig am 06.04.2023 | | 200 | 197 | 0,01 |
| **Turkish Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.09.2028 | | 233 | 194 | 0,01 |
| | | | 5.936 | 0,27 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Export-Credit Bank of Turkey** | | | | |
| 4,250 % fällig am 18.09.2022 | | 6.100 | 6.057 | 0,28 |
| 5,375 % fällig am 24.10.2023 | | 900 | 853 | 0,04 |
| 5,750 % fällig am 06.07.2026 | | 11.000 | 9.217 | 0,42 |
| 8,250 % fällig am 24.01.2024 | | 1.500 | 1.477 | 0,07 |
| **Turkey Government International Bond** | | | | |
| 4,250 % fällig am 13.03.2025 | | 1.000 | 861 | 0,04 |
| 4,875 % fällig am 16.04.2043 | | 8.200 | 4.871 | 0,22 |
| 5,125 % fällig am 17.02.2028 | | 2.500 | 1.911 | 0,09 |
| 5,750 % fällig am 11.05.2047 | | 24.100 | 14.902 | 0,68 |
| 5,875 % fällig am 26.06.2031 | | 2.400 | 1.728 | 0,08 |
| 5,950 % fällig am 15.01.2031 | | 4.000 | 2.915 | 0,13 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2027 | | 900 | 742 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 14.01.2041 | | 600 | 384 | 0,02 |
| 6,375 % fällig am 14.10.2025 | | 2.000 | 1.777 | 0,08 |
| 6,875 % fällig am 17.03.2036 | | 3.130 | 2.304 | 0,10 |
| | | | 49.999 | 2,28 |
| Summe Türkei | | | 55.935 | 2,55 |
| **UKRAINE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **NPC Ukrenergo** | | | | |
| 6,875 % fällig am 09.11.2026 | | 8.100 | 2.025 | 0,09 |
| **State Agency of Roads of Ukraine** | | | | |
| 6,250 % fällig am 24.06.2028 | | 7.900 | 1.975 | 0,09 |
| | | | 4.000 | 0,18 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ukraine Government International Bond** | | | | |
| 4,375 % fällig am 27.01.2030 | € | 2.700 | 706 | 0,03 |
| 6,876 % fällig am 21.05.2029 | $ | 8.300 | 2.054 | 0,09 |
| 7,253 % fällig am 15.03.2033 | | 25.900 | 6.540 | 0,30 |
| 7,375 % fällig am 25.09.2032 | | 5.900 | 1.490 | 0,07 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2022 | | 4.200 | 2.373 | 0,11 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2023 | | 6.800 | 2.210 | 0,10 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2024 | | 12.300 | 3.167 | 0,14 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2025 | | 9.000 | 2.295 | 0,11 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2026 | | 100 | 26 | 0,00 |
| 8,994 % fällig am 01.02.2024 | | 4.300 | 1.107 | 0,05 |
| | | | 21.968 | 1,00 |
| Summe Ukraine | | | 25.968 | 1,18 |
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **MDGH GMTN RSC Ltd.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 07.11.2049 | | 3.000 | 2.557 | 0,12 |
| 3,950 % fällig am 21.05.2050 | | 2.600 | 2.332 | 0,10 |
| **Sweihan PV Power Co. PJSC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 31.01.2049 | | 5.100 | 4.243 | 0,19 |
| | | | 9.132 | 0,41 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **NMC OpCo Ltd.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 25.03.2027 | AED | 42.828 | 11.843 | 0,54 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Emirate of Dubai Government International Bond** | | | | |
| 3,900 % fällig am 09.09.2050 | $ | 700 | $ 508 | 0,02 |
| **Finance Department Government of Sharjah** | | | | |
| 4,375 % fällig am 10.03.2051 | | 3.800 | 2.712 | 0,13 |
| | | | 3.220 | 0,15 |
| Summe Vereinigte Arabische Emirate | | | 24.195 | 1,10 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 3,803 % fällig am 11.03.2025 | | 300 | 296 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 22.05.2027 (c)(d) | | 800 | 719 | 0,03 |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 4,269 % fällig am 22.03.2025 | | 200 | 198 | 0,01 |
| 5,076 % fällig am 27.01.2030 | | 300 | 294 | 0,01 |
| **State Savings Bank of Ukraine Via SSB PLC** | | | | |
| 9,375 % fällig am 10.03.2023 | | 449 | 269 | 0,01 |
| **Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.07.2026 | | 6.500 | 1.994 | 0,09 |
| 8,250 % fällig am 09.07.2024 | | 3.100 | 883 | 0,04 |
| **Ukreximbank Via Biz Finance PLC** | | | | |
| 9,750 % fällig am 22.01.2025 | | 975 | 541 | 0,03 |
| Summe Großbritannien | | | 5.194 | 0,24 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 1,864 % fällig am 25.02.2037 | | 810 | 782 | 0,03 |
| 2,749 % fällig am 25.11.2035 | | 640 | 621 | 0,03 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | | |
| 3,136 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 2.422 | 905 | 0,04 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.09.2036 | | 859 | 577 | 0,03 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,844 % fällig am 25.11.2036 | | 950 | 602 | 0,03 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 2,419 % fällig am 25.03.2034 | | 854 | 825 | 0,04 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.07.2036 | | 190 | 175 | 0,01 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,844 % fällig am 25.05.2037 | | 247 | 167 | 0,01 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,404 % fällig am 25.09.2035 | | 1.000 | 915 | 0,04 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | | |
| 1,934 % fällig am 25.09.2037 | | 54 | 52 | 0,00 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 1,804 % fällig am 25.02.2037 | | 202 | 62 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.10.2037 | | 135 | 106 | 0,00 |
| | | | 5.789 | 0,26 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Alphabet, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.08.2060 | | 4.100 | 2.674 | 0,12 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,981 % fällig am 25.09.2025 | | 8.700 | 8.058 | 0,37 |
| **Ford Motor Co.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.02.2032 | | 12.000 | 9.016 | 0,41 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 3,550 % fällig am 07.10.2022 | | 600 | 598 | 0,03 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,653 % fällig am 16.09.2024 | | 2.600 | 2.493 | 0,11 |
| **JPMorgan Structured Products BV** | | | | |
| 12,000 % fällig am 28.08.2026 (e) | ZMW | 30.500 | 1.232 | 0,06 |
| 12,000 % fällig am 04.01.2027 (e) | | 26.300 | 1.030 | 0,05 |
| 14,000 % fällig am 09.12.2031 (e) | | 27.900 | 975 | 0,04 |
| **MercadoLibre, Inc.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 14.01.2026 | $ | 6.700 | 5.789 | 0,26 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 0,864 % fällig am 21.10.2025 | | 2.500 | 2.308 | 0,10 |
| **Rutas 2 and 7 Finance Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 30.09.2036 (a) | | 5.027 | 2.974 | 0,14 |
| | | | 37.147 | 1,69 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,274 % fällig am 25.10.2036 | $ | 85 | $ 71 | 0,01 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,974 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 122 | 53 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | | |
| 1,506 % fällig am 30.11.2037 | | 600 | 547 | 0,03 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,804 % fällig am 25.02.2037 | | 274 | 271 | 0,01 |
| 2,264 % fällig am 25.07.2045 | | 61 | 50 | 0,00 |
| 2,650 % fällig am 25.11.2037 | | 227 | 193 | 0,01 |
| **JPMorgan Resecuritization Trust** | | | | |
| 2,500 % fällig am 25.03.2056 | | 45 | 43 | 0,00 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 1,874 % fällig am 25.08.2037 | | 989 | 917 | 0,04 |
| 2,004 % fällig am 25.09.2046 | | 239 | 223 | 0,01 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.02.2037 | | 446 | 409 | 0,02 |
| **SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,741 % fällig am 25.10.2037 ^ | | 70 | 63 | 0,00 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 3,087 % fällig am 25.03.2036 | | 199 | 190 | 0,01 |
| | | | 3.030 | 0,14 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 | | 650 | 585 | 0,03 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2052 | | 2.600 | 2.498 | 0,11 |
| | | | 3.083 | 0,14 |
| Summe USA | | | 49.049 | 2,23 |
| **URUGUAY** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Uruguay Government International Bond** | | | | |
| 4,975 % fällig am 20.04.2055 | | 15.300 | 15.157 | 0,69 |
| 5,100 % fällig am 18.06.2050 | | 14.418 | 14.538 | 0,66 |
| 7,625 % fällig am 21.03.2036 | | 2.880 | 3.619 | 0,17 |
| 7,875 % fällig am 15.01.2033 | | 7.530 | 9.441 | 0,43 |
| Summe Uruguay | | | 42.755 | 1,95 |
| **VIETNAM** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Vietnam Government International Bond** | | | | |
| 4,800 % fällig am 19.11.2024 | | 1.000 | 997 | 0,05 |
| **JUNGFERNINSELN (BRITISCH)** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 | | 300 | 303 | 0,02 |
| **Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 24.04.2033 | | 6.335 | 5.974 | 0,27 |
| Summe Jungferninseln (Britisch) | | | 6.277 | 0,29 |
| **SAMBIA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Zambia Government International Bond** | | | | |
| 5,375 % fällig am 20.09.2022 ^ | | 1.200 | 688 | 0,03 |
| 8,500 % fällig am 14.04.2024 ^ | | 4.400 | 2.683 | 0,13 |
| 8,970 % fällig am 30.07.2027 ^ | | 1.200 | 706 | 0,03 |
| Summe Sambia | | | 4.077 | 0,19 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **JAPAN TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,108) % fällig am 11.07.2022 (a)(b) | ¥ | 3.070.000 | 22.599 | 1,03 |
| **U.S. TREASURY BILLS** | | | | |
| 0,643 % fällig am 19.07.2022 (a)(b) | $ | 17.400 | 17.391 | 0,79 |
| 0,722 % fällig am 26.07.2022 (a)(b)(g) | | 18.500 | 18.487 | 0,84 |
| 0,797 % fällig am 14.07.2022 (a)(b)(g) | | 10.400 | 10.396 | 0,47 |
| 0,904 % fällig am 28.07.2022 (a)(b) | | 20.900 | 20.883 | 0,95 |
| 0,925 % fällig am 04.08.2022 (a)(b) | | 21.500 | 21.476 | 0,98 |
| 1,089 % fällig am 23.08.2022 (a)(b) | | 35.600 | 35.523 | 1,62 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| 1,139 % fällig am 01.09.2022 (a)(b) | $ 1.400 | $ 1.396 | 0,06 |
| 1,168 % fällig am 09.08.2022 (a)(b) | 19.400 | 19.374 | 0,88 |
| 1,782 % fällig am 29.09.2022 (a)(b) | 15.700 | 15.636 | 0,71 |
| | | 160.562 | 7,30 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 183.161 | 8,33 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | **$ 2.204.146** | **100,31** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 5.617 | U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | $ (5.729) | $ 5.617 | $ 5.617 | 0,26 |
| NOM | 1,480 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 31.300 | U.S. Treasury Bonds 4,375 % fällig am 15.05.2040 | (32.047) | 31.300 | 31.301 | 1,42 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (37.776)** | **$ 36.917** | **$ 36.918** | **1,68** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09.2022 | 403 | $ 842 | 0,04 |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 480 | 1.634 | 0,07 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 23 | 169 | 0,01 |
| Euro-Schatz September Futures | Long | 09.2022 | 412 | (156) | (0,01) |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 1.928 | 1.492 | 0,07 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 2.282 | (1.982) | (0,09) |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09.2022 | 208 | (950) | (0,04) |
| | | | | $ 1.049 | 0,05 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 1.049** | **0,05** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,863 % | 02.01.2023 | BRL 203.900 | $ (1.868) | (0,09) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 9,200 | 02.01.2024 | 26.600 | (258) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 11,970 | 02.01.2024 | 132.600 | 411 | 0,02 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 | 15.12.2031 | $ 1.800 | (223) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 5,950 | 30.11.2024 | ZAR 346.600 | 688 | 0,03 |
| Erhalt[1] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | € 15.000 | 1.469 | 0,07 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 5,470 | 21.04.2025 | MXN 32.600 | 192 | 0,01 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 5,520 | 24.04.2025 | 31.000 | 184 | 0,01 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 5,615 | 23.04.2025 | 128.300 | 768 | 0,04 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,100 | 26.02.2025 | 126.600 | (781) | (0,04) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,100 | 28.02.2025 | 66.100 | (412) | (0,02) |
| | | | | | $ 170 | 0,01 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 170** | **0,01** |

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

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

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Turkey Government International Bond | (1,000) % | 20.12.2026 | $ 4.300 | $ 715 | $ 366 | $ 1.081 | 0,05 |
| CBK | China Government International Bond | (1,000) | 20.06.2024 | 15.000 | (167) | (8) | (175) | (0,01) |
| | Turkey Government International Bond | (1,000) | 20.12.2026 | 2.800 | 467 | 237 | 704 | 0,03 |
| GST | China Government International Bond | (1,000) | 20.06.2024 | 15.000 | (167) | (8) | (175) | (0,01) |
| | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2027 | 53.000 | (1.850) | 693 | (1.157) | (0,05) |
| MYC | Turkey Government International Bond | (1,000) | 20.12.2026 | 2.500 | 423 | 206 | 629 | 0,03 |
| | | | | | $ (579) | $ 1.486 | $ 907 | 0,04 |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2031 | $ 1.200 | $ (181) | $ (33) | $ (214) | (0,01) |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 18.100 | 13 | (51) | (38) | 0,00 |
| | Montenegro Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | € 800 | (62) | 38 | (24) | 0,00 |
| | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | $ 5.000 | 63 | (25) | 38 | 0,00 |
| | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.06.2026 | 6.400 | 26 | (17) | 9 | 0,00 |
| | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.12.2031 | 11.900 | (502) | (254) | (756) | (0,03) |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2025 | 1.200 | (66) | 4 | (62) | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 100 | (20) | (7) | (27) | 0,00 |
| BPS | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 10.400 | (639) | (78) | (717) | (0,03) |
| | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.06.2026 | 6.100 | 54 | (45) | 9 | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 3.800 | (751) | (270) | (1.021) | (0,05) |
| BRC | Argentina Government International Bond | 5,000 | 20.12.2023 | 800 | (96) | (140) | (236) | (0,01) |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2030 | 1.400 | (194) | (41) | (235) | (0,01) |
| | Chile Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 2.500 | 15 | (18) | (3) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 1.000 | 0 | 1 | 1 | 0,00 |
| | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.12.2025 | 17.500 | 360 | (278) | 82 | 0,00 |
| | QNB Finance Ltd. | 1,000 | 20.06.2023 | 900 | 7 | (1) | 6 | 0,00 |
| CBK | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 300 | (3) | 0 | (3) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 800 | 3 | (19) | (16) | 0,00 |
| | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.06.2026 | 2.100 | 18 | (15) | 3 | 0,00 |
| | Qatar Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 5.000 | 140 | (69) | 71 | 0,00 |
| DUB | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 2.100 | (15) | 15 | 0 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 10.400 | (638) | (184) | (822) | (0,04) |
| GST | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2026 | 200 | (11) | 1 | (10) | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2031 | 1.500 | (227) | (40) | (267) | (0,01) |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 14.000 | (34) | (240) | (274) | (0,01) |
| | Indonesia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 12.400 | 30 | (266) | (236) | (0,01) |
| | Malaysia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 10.000 | 159 | (174) | (15) | 0,00 |
| | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.06.2026 | 13.700 | 99 | (79) | 20 | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 4.300 | (840) | (316) | (1.156) | (0,05) |
| HUS | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 100 | (1) | 1 | 0 | 0,00 |
| JPM | Indonesia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 7.400 | 60 | (23) | 37 | 0,00 |
| | Israel Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 1.100 | 26 | (6) | 20 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 2.500 | (40) | 9 | (31) | 0,00 |
| MYC | Argentina Government International Bond | 5,000 | 20.12.2023 | 1.500 | (289) | (154) | (443) | (0,02) |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 2.800 | (173) | (61) | (234) | (0,01) |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2030 | 2.900 | (405) | (82) | (487) | (0,02) |
| | Chile Government International Bond | 1,000 | 20.06.2026 | 15.000 | 208 | (124) | 84 | 0,00 |
| | Chile Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 16.300 | 112 | (134) | (22) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 2.500 | 27 | (37) | (10) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 200 | (1) | (6) | (7) | 0,00 |
| | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.06.2026 | 12.100 | 65 | (47) | 18 | 0,00 |
| | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 20.000 | 80 | (200) | (120) | (0,01) |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 4.600 | (206) | (158) | (364) | (0,02) |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 1.800 | (356) | (128) | (484) | (0,02) |
| MYI | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.06.2026 | 1.300 | 11 | (9) | 2 | 0,00 |
| | | | | | $ (4.174) | $ (3.760) | $ (7.934) | (0,36) |

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

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

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

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | ZAR | 152.726 | $ | 10.068 | $ 758 | $ 0 | $ 758 | 0,03 |
| | 09.2022 | TRY | 22.966 | | 1.128 | 0 | (165) | (165) | (0,01) |
| | 09.2022 | $ | 2.435 | PEN | 9.406 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | € | 2.840 | $ | 3.010 | 40 | 0 | 40 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 3.783 | | 4.766 | 172 | 0 | 172 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 10.840 | BRL | 56.034 | 0 | (125) | (125) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 204.284 | € | 194.195 | 0 | (1.263) | (1.263) | (0,06) |
| | 07.2022 | | 189 | ZAR | 3.051 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 4.082 | $ | 261 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 188.370 | | 198.489 | 1.194 | 0 | 1.194 | 0,05 |
| | 08.2022 | MXN | 87.288 | | 3.974 | 0 | (325) | (325) | (0,01) |
| | 08.2022 | $ | 4.960 | PEN | 18.947 | 20 | (12) | 8 | 0,00 |
| | 12.2022 | TRY | 26.149 | $ | 1.127 | 0 | (200) | (200) | (0,01) |
| BRC | 07.2022 | ¥ | 3.070.000 | | 25.102 | 2.497 | 0 | 2.497 | 0,11 |
| | 11.2022 | ZAR | 2.267 | | 152 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | $ | 4.319 | € | 4.030 | 0 | (106) | (106) | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN | 31.862 | $ | 8.342 | 4 | (13) | (9) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 9.028 | PEN | 34.418 | 19 | (19) | 0 | 0,00 |
| | 11.2022 | PEN | 23.290 | $ | 5.909 | 0 | (149) | (149) | (0,01) |
| | 05.2023 | | 4.396 | | 1.112 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | $ | 119 | PLN | 517 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 12.2022 | ZAR | 90.805 | $ | 5.779 | 325 | 0 | 325 | 0,02 |
| GLM | 07.2022 | BRL | 66.642 | | 12.858 | 114 | 0 | 114 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 5.815 | BRL | 29.300 | 0 | (212) | (212) | (0,01) |
| | 07.2022 | ZAR | 1.791 | $ | 113 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN | 5.023 | | 1.341 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 12.756 | BRL | 66.642 | 0 | (122) | (122) | (0,01) |
| | 10.2022 | ZAR | 133.193 | $ | 8.452 | 404 | 0 | 404 | 0,02 |
| | 05.2023 | $ | 45 | ZAR | 753 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| JPM | 08.2022 | CNH | 22 | | 150 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 12.079 | $ | 12.839 | 215 | (4) | 211 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 1.343 | € | 1.268 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 99 | ZAR | 1.587 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 51 | CNH | 341 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 05.2023 | | 51 | | 343 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | BRL | 18.692 | $ | 3.832 | 258 | 0 | 258 | 0,01 |
| | 07.2022 | £ | 107 | | 130 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 276 | € | 263 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.894 | £ | 1.562 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 125 | ZAR | 2.019 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | CNY | 463 | $ | 69 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | TRY | 76.622 | | 4.438 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | ZAR | 32.102 | | 2.116 | 160 | 0 | 160 | 0,01 |
| | 08.2022 | CNY | 741 | | 111 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 90 | CNH | 605 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | ZAR | 82.806 | $ | 5.356 | 337 | 0 | 337 | 0,02 |
| SOG | 07.2022 | € | 184.691 | | 198.508 | 5.422 | 0 | 5.422 | 0,25 |
| UAG | 09.2022 | $ | 223 | MXN | 4.444 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 10.2022 | TRY | 114.651 | $ | 6.797 | 627 | 0 | 627 | 0,03 |
| | | | | | | $ 12.649 | $ (2.777) | $ 9.872 | 0,45 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | CHF | 561 | $ | 563 | $ 0 | $ (23) | $ (23) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 15.402 | CHF | 14.718 | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | | 234 | | 224 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | | 15.391 | | 14.732 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | CHF | 309 | $ | 325 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 15.066 | CHF | 14.413 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | | | | | | $ 3 | $ (64) | $ (61) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | $ | 1.037 | € | 978 | $ 0 | $ (14) | $ (14) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | € | 425.030 | $ | 447.022 | 2.674 | 0 | 2.674 | 0,12 |
| | 07.2022 | $ | 41.756 | € | 39.624 | 0 | (331) | (331) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 430.443 | | 408.499 | 0 | (2.588) | (2.588) | (0,12) |
| CBK | 07.2022 | € | 9.247 | $ | 9.928 | 261 | 0 | 261 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 4 | € | 4 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MBC | 07.2022 | € | 409.368 | $ | 430.653 | $ 2.682 | $ (2) | $ 2.680 | 0,12 |
| | 07.2022 | $ | 459.064 | € | 425.744 | 0 | (13.971) | (13.971) | (0,65) |
| | 08.2022 | | 430.523 | | 408.499 | 0 | (2.668) | (2.668) | (0,12) |
| SOG | 07.2022 | | 453.250 | | 421.703 | 0 | (12.380) | (12.380) | (0,56) |
| UAG | 07.2022 | | 388.608 | | 361.630 | 0 | (10.542) | (10.542) | (0,48) |
| | | | | | | $ 5.617 | $ (42.496) | $ (36.879) | (1,69) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | $ | 48.424 | £ | 38.312 | $ 0 | $ (1.896) | $ (1.896) | (0,09) |
| BPS | 07.2022 | £ | 1.327 | $ | 1.606 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 3.579 | £ | 2.886 | 0 | (74) | (74) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | | 49.622 | | 39.410 | 0 | (1.761) | (1.761) | (0,08) |
| CBK | 07.2022 | | 438 | | 349 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | | 6.330 | | 5.152 | 0 | (72) | (72) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | | 480 | | 397 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 48.002 | | 38.248 | 0 | (1.552) | (1.552) | (0,07) |
| SOG | 07.2022 | £ | 43.302 | $ | 52.699 | 110 | 0 | 110 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 52.724 | £ | 43.302 | 0 | (110) | (110) | (0,01) |
| UAG | 07.2022 | | 16.199 | | 13.174 | 0 | (200) | (200) | (0,01) |
| | | | | | | $ 113 | $ (5.684) | $ (5.571) | (0,25) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Investor NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | $ | 197 | NOK | 1.861 | $ 0 | $ (9) | $ (9) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | NOK | 1.741 | $ | 178 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 199 | NOK | 1.878 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 178 | | 1.740 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | | 1 | | 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | NOK | 37 | $ | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 77 | | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | $ | 197 | NOK | 1.859 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | | | | | | $ 1 | $ (28) | $ (27) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Investor SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | $ | 3 | SEK | 34 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | SEK | 16 | $ | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 66 | SEK | 660 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | SEK | 7.174 | $ | 706 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 706 | SEK | 7.168 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | SEK | 31 | $ | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 125 | SEK | 1.250 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | SEK | 6 | $ | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | | 291 | | 29 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 504 | | 52 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 781 | SEK | 7.632 | 0 | (36) | (36) | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | | 658 | | 6.464 | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | | 747 | | 7.314 | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| | | | | | | $ 9 | $ (108) | $ (99) | 0,00 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (39.792)** | **(1,81)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 2.202.490** | **100,24** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ (5.288)** | **(0,24)** |
| **Nettovermögen** | **$ 2.197.202** | **100,00** |

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

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

**^ Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a) Nullkuponwertpapier.**

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

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

**(d) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(e) Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeits-datum | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Development Bank of Southern Africa | 8,600 % | 21.10.2024 | 07.10.2021 | $ 17.010 | $ 15.178 | 0,69 |
| JPMorgan Structured Products BV | 12,000 | 28.08.2026 | 15.06.2021 | 809 | 1.232 | 0,06 |
| JPMorgan Structured Products BV | 12,000 | 04.01.2027 | 15.06.2021 | 697 | 1.030 | 0,05 |
| JPMorgan Structured Products BV | 14,000 | 09.12.2031 | 24.05.2021 - 01.06.2021 | 677 | 975 | 0,04 |
| | | | | $ 19.193 | $ 18.415 | 0,84 |

**(f) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 71.761 und Barmittel in Höhe von USD 5.600 als Sicherheiten verpfändet.**

**(g) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 851 und Barmittel in Höhe von USD 38.161 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von USD 11.058 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 2.179.180 | $ 24.966 | $ 2.204.146 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 36.917 | 0 | 36.917 |
| Finanzderivate[3] | 2.489 | (41.038) | (24) | (38.573) |
| **Summen** | **$ 2.489** | **$ 2.175.059** | **$ 24.942** | **$ 2.202.490** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 2.686.487 | $ 17.783 | $ 2.704.270 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 51.143 | 0 | 51.143 |
| Finanzderivate[3] | 2.326 | 8.628 | (46) | 10.908 |
| **Summen** | **$ 2.326** | **$ 2.746.258** | **$ 17.737** | **$ 2.766.321** |

(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 2022:**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | (0,500) % | 30.05.2022 | TBD[1] | € (18.927) | $ (19.779) | (0,90) |
| | (0,450) | 30.05.2022 | TBD[1] | (1.451) | (1.517) | (0,07) |
| BRC | (3,750) | 16.05.2022 | TBD[1] | $ (496) | (493) | (0,02) |
| | (1,750) | 07.03.2022 | TBD[1] | (3.562) | (3.534) | (0,15) |
| | (0,900) | 15.11.2021 | TBD[1] | (1.000) | (994) | (0,05) |
| | (0,250) | 25.04.2022 | TBD[1] | (311) | (311) | (0,01) |
| | 0,250 | 23.05.2022 | TBD[1] | (3.359) | (3.360) | (0,15) |
| MEI | 0,000 | 24.06.2022 | 23.06.2024 | (237) | (237) | (0,01) |
| NOM | (0,250) | 17.06.2022 | TBD[1] | (2.566) | (2.566) | (0,12) |
| | 1,550 | 17.06.2022 | TBD[1] | (7.562) | (7.566) | (0,35) |
| | 1,580 | 17.06.2022 | TBD[1] | (743) | (743) | (0,03) |
| SCX | 1,270 | 25.04.2022 | 25.07.2022 | (16.007) | (16.044) | (0,73) |
| | 1,270 | 06.05.2022 | 25.07.2022 | (14.636) | (14.665) | (0,67) |
| | 1,270 | 12.05.2022 | 25.07.2022 | (2.079) | (2.083) | (0,10) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (73.892)** | **(3,36)** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (1.347) | $ 1.440 | $ 93 |
| BPS | (2.543) | 2.380 | (163) |
| BRC | 357 | (450) | (93) |
| CBK | 550 | (533) | 17 |
| DUB | (501) | 510 | 9 |
| GLM | 211 | (160) | 51 |
| GST | (3.270) | 3.323 | 53 |
| JPM | 26 | (70) | (44) |
| MBC | (13.842) | 12.549 | (1.293) |
| MYC | (1.440) | 1.310 | (130) |
| MYI | 251 | (468) | (217) |
| SCX | (1.095) | 1.140 | 45 |
| SOG | (6.986) | 7.230 | 244 |
| TOR | (33) | 0 | (33) |
| UAG | (10.130) | 9.130 | (1.000) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 82,19 | 82,78 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 14,93 | 19,80 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 3,19 | 0,02 |
| Pensionsgeschäfte | 1,68 | 1,94 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,05 | 0,09 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,01 | (0,05) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (1,81) | 0,37 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (3,36) | (6,34) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Argentinien | 2,35 | 2,15 |
| Armenien | 0,27 | 0,30 |
| Österreich | 0,01 | 0,01 |
| Aserbaidschan | k. A. | 0,10 |
| Bahamas | 0,25 | 0,12 |
| Bahrain | 1,12 | 1,04 |
| Benin | 0,36 | 0,48 |
| Bermuda | 0,15 | 0,16 |
| Brasilien | 3,88 | 4,18 |
| Cayman-Inseln | 2,52 | 3,26 |
| Chile | 3,23 | 2,38 |
| China | 0,02 | 0,23 |
| Kolumbien | 2,28 | 2,32 |
| Costa Rica | 1,29 | 1,04 |
| Dominikanische Republik | 3,22 | 3,00 |
| Ecuador | 1,89 | 2,10 |
| Ägypten | 2,28 | 4,38 |
| El Salvador | 0,43 | 0,58 |
| Georgien | 0,42 | 0,42 |
| Deutschland | 0,03 | 0,02 |
| Ghana | 1,79 | 2,24 |
| Guernsey, Kanalinseln | 0,13 | 0,16 |
| Hongkong | 1,15 | 1,32 |
| Ungarn | 1,71 | 1,04 |
| Indien | 2,10 | 2,03 |
| Indonesien | 2,56 | 2,47 |
| Irland | 0,06 | 0,43 |
| Insel Man | k. A. | 0,14 |
| Israel | k. A. | 0,22 |
| Elfenbeinküste | 1,46 | 1,61 |
| Jamaika | 0,19 | 0,20 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,51 | k. A. |
| Jordanien | 0,62 | 0,77 |
| Kasachstan | 2,22 | 0,94 |
| Kenia | 0,94 | 0,79 |
| Luxemburg | 0,68 | 0,38 |
| Malaysia | 0,16 | 0,02 |
| Mauritius | 1,38 | 1,44 |
| Mexiko | 3,31 | 2,88 |
| Mongolei | 0,74 | 0,55 |
| Marokko | 1,06 | 1,37 |
| Multinational | 0,02 | 0,02 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Namibia | 0,09 | 0,09 |
| Niederlande | 1,43 | 1,48 |
| Oman | 3,84 | 3,48 |
| Panama | 3,48 | 2,43 |
| Paraguay | 0,87 | 0,85 |
| Peru | 1,77 | 1,48 |
| Philippinen | 1,72 | 1,64 |
| Katar | 1,33 | 1,54 |
| Rumänien | 2,52 | 2,23 |
| Russland | 0,05 | 0,71 |
| Ruanda | k. A. | 0,09 |
| Senegal | 0,61 | 0,71 |
| Serbien | 0,95 | 0,75 |
| Singapur | 0,69 | 0,87 |
| Südafrika | 3,68 | 2,91 |
| Südkorea | 6,75 | 4,86 |
| Sri Lanka | 0,79 | 1,26 |
| Supranational | 2,08 | 1,71 |
| Schweiz | 0,27 | k. A. |
| Tansania | 0,38 | 0,35 |
| Tunesien | 0,11 | 0,11 |
| Türkei | 2,55 | 2,96 |
| Ukraine | 1,18 | 3,53 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 1,10 | 1,05 |
| Großbritannien | 0,24 | 0,46 |
| USA | 2,23 | 2,29 |
| Uruguay | 1,95 | 2,33 |
| Vietnam | 0,05 | 0,04 |
| Jungferninseln (Britisch) | 0,29 | 0,28 |
| Sambia | 0,19 | 0,20 |
| Kurzfristige Instrumente | 8,33 | 10,62 |
| Pensionsgeschäfte | 1,68 | 1,94 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,05 | 0,09 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Zinsswaps | 0,01 | (0,05) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf | 0,04 | (0,04) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,36) | (0,13) |
| Devisenterminkontrakte | 0,45 | (0,06) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (1,94) | 0,60 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (0,24) | (4,95) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Republik Côte d'Ivoire** | | | | |
| 5,000 % fällig am 19.03.2027 | € | 1.000 | $ 1.005 | 0,65 |
| **SOCAR Turkey Enerji A/S** | | | | |
| 3,450 % fällig am 11.08.2026 | | 1.000 | 988 | 0,63 |
| | | | 1.993 | 1,28 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **Absa Group Ltd.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 27.05.2026 (e)(g) | $ | 500 | 454 | 0,29 |
| **AIA Group Ltd.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 09.04.2029 | | 1.100 | 1.061 | 0,68 |
| **Akbank T.A.S.** | | | | |
| 6,800 % fällig am 06.02.2026 | | 1.000 | 897 | 0,58 |
| **Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC** | | | | |
| 5,950 % fällig am 15.04.2030 ^(g) | | 1.300 | 143 | 0,09 |
| **Arabian Centres Sukuk Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 26.11.2024 | | 700 | 667 | 0,43 |
| **Banco BTG Pactual S.A.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 10.01.2025 | | 1.100 | 1.061 | 0,68 |
| **Banco Davivienda S.A.** | | | | |
| 6,650 % fällig am 22.04.2031 (e)(g) | | 600 | 480 | 0,31 |
| **Banco de Credito del Peru S.A.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 11.01.2025 | | 1.300 | 1.223 | 0,79 |
| **Banco de Credito e Inversiones S.A.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 12.10.2027 | | 1.000 | 941 | 0,61 |
| **Banco Inbursa S.A.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 11.04.2027 | | 1.325 | 1.269 | 0,82 |
| **Banco Internacional del Peru SAA Interbank** | | | | |
| 3,250 % fällig am 04.10.2026 | | 1.000 | 920 | 0,59 |
| **Banco Mercantil del Norte S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.01.2027 (e)(g) | | 300 | 249 | 0,16 |
| 6,625 % fällig am 24.01.2032 (e)(g) | | 250 | 205 | 0,13 |
| 6,875 % fällig am 06.07.2022 (e)(g) | | 300 | 298 | 0,19 |
| **Banco Santander Chile** | | | | |
| 2,700 % fällig am 10.01.2025 | | 1.200 | 1.150 | 0,74 |
| **Banco Santander Mexico S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 17.04.2025 | | 1.800 | 1.809 | 1,17 |
| **Banistmo S.A.** | | | | |
| 3,650 % fällig am 19.09.2022 | | 400 | 400 | 0,26 |
| **Bank Hapoalim B.M.** | | | | |
| 3,255 % fällig am 21.01.2032 (g) | | 1.100 | 946 | 0,61 |
| **Bank Leumi Le-Israel B.M.** | | | | |
| 3,275 % fällig am 29.01.2031 (g) | | 1.800 | 1.588 | 1,02 |
| **Bank Mandiri Persero Tbk PT** | | | | |
| 2,000 % fällig am 19.04.2026 | | 800 | 726 | 0,47 |
| **Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT** | | | | |
| 3,750 % fällig am 30.03.2026 (g) | | 800 | 728 | 0,47 |
| **BBVA Bancomer S.A.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 18.01.2033 (g) | | 1.150 | 976 | 0,63 |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 21.01.2026 | | 700 | 642 | 0,41 |
| **Cibanco S.A. Ibm** | | | | |
| 4,962 % fällig am 18.07.2029 | | 900 | 806 | 0,52 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 22.10.2025 | | 900 | 443 | 0,29 |
| **Development Bank of Southern Africa** | | | | |
| 8,600 % fällig am 21.10.2024 (h) | ZAR | 22.300 | 1.336 | 0,86 |
| **Fab Sukuk Co. Ltd.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 21.01.2025 | $ | 325 | 316 | 0,20 |
| 3,875 % fällig am 22.01.2024 | | 1.500 | 1.504 | 0,97 |
| **Growthpoint Properties International Pty. Ltd.** | | | | |
| 5,872 % fällig am 02.05.2023 | | 1.050 | 1.050 | 0,68 |
| **Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V.** | | | | |
| 9,620 % fällig am 28.06.2018 ^ | MXN | 34.709 | 55 | 0,04 |
| **Huarong Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 24.02.2030 | $ | 500 | 377 | 0,24 |
| 5,500 % fällig am 16.01.2025 | | 200 | 194 | 0,13 |
| **IIRSA Norte Finance Ltd.** | | | | |
| 8,750 % fällig am 30.05.2024 | | 26 | 27 | 0,02 |
| **Indian Railway Finance Corp. Ltd.** | | | | |
| 3,570 % fällig am 21.01.2032 | | 800 | 686 | 0,44 |
| **Industrial Senior Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.11.2022 | $ | 300 | $ 300 | 0,19 |
| **Interoceanica Finance Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 30.11.2025 (c) | | 48 | 43 | 0,03 |
| **Kaisa Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 9,375 % fällig am 30.06.2024 ^ | | 300 | 42 | 0,03 |
| 9,750 % fällig am 28.09.2023 ^ | | 1.400 | 194 | 0,13 |
| **Kookmin Bank** | | | | |
| 2,500 % fällig am 04.11.2030 (g) | | 1.100 | 929 | 0,60 |
| **Kuwait Projects Co. SPC Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 23.02.2027 | | 682 | 550 | 0,36 |
| **MAF Sukuk Ltd.** | | | | |
| 4,638 % fällig am 14.05.2029 | | 1.000 | 1.005 | 0,65 |
| **Mizrahi Tefahot Bank Ltd.** | | | | |
| 3,077 % fällig am 07.04.2031 (g) | | 1.300 | 1.129 | 0,73 |
| **Muthoot Finance Ltd.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 02.09.2023 | | 700 | 681 | 0,44 |
| 6,125 % fällig am 31.10.2022 | | 500 | 500 | 0,32 |
| **NBK SPC Ltd.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 15.09.2027 | | 1.200 | 1.072 | 0,69 |
| **NE Property BV** | | | | |
| 1,875 % fällig am 09.10.2026 | € | 500 | 439 | 0,28 |
| 2,000 % fällig am 20.01.2030 | | 100 | 74 | 0,05 |
| **New Metro Global Ltd.** | | | | |
| 6,800 % fällig am 05.08.2023 | $ | 1.100 | 754 | 0,49 |
| **OEC Finance Ltd. (4,375 % bar oder 4,375 % PIK)** | | | | |
| 4,375 % fällig am 25.10.2029 (a) | | 697 | 17 | 0,01 |
| **OEC Finance Ltd. (5,250 % bar oder 5,250 % PIK)** | | | | |
| 5,250 % fällig am 27.12.2033 (a) | | 424 | 11 | 0,01 |
| **OEC Finance Ltd. (7,125 % bar oder 7,125 % PIK)** | | | | |
| 7,125 % fällig am 26.12.2046 (a) | | 1.498 | 37 | 0,02 |
| **Poly Real Estate Finance Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 05.02.2023 | | 700 | 699 | 0,45 |
| **Powerlong Real Estate Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 30.04.2025 | | 1.300 | 208 | 0,13 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 12.05.2025 | | 500 | 481 | 0,31 |
| 3,500 % fällig am 28.03.2024 | | 1.548 | 1.542 | 1,00 |
| **QNB Finansbank A/S** | | | | |
| 6,875 % fällig am 07.09.2024 | | 500 | 502 | 0,32 |
| **Samba Funding Ltd.** | | | | |
| 2,900 % fällig am 29.01.2027 | | 1.700 | 1.610 | 1,04 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 23.05.2023 ^(g) | | 1.700 | 119 | 0,08 |
| **Shinhan Bank Co. Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 26.03.2028 | | 900 | 893 | 0,58 |
| **Shriram Transport Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 4,150 % fällig am 18.07.2025 | | 700 | 613 | 0,40 |
| **Sovcombank Via SovCom Capital DAC** | | | | |
| 3,400 % fällig am 26.01.2025 ^ | | 1.100 | 77 | 0,05 |
| **SPARC EM SPC Panama Metro Line SP** | | | | |
| 0,000 % fällig am 05.12.2022 (c) | | 273 | 268 | 0,17 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 09.07.2023 ^ | | 500 | 76 | 0,05 |
| 7,000 % fällig am 09.07.2025 ^ | | 600 | 90 | 0,06 |
| **Trust Fibra Uno** | | | | |
| 6,390 % fällig am 15.01.2050 | | 400 | 319 | 0,21 |
| **Turkiye Is Bankasi A/S** | | | | |
| 6,125 % fällig am 25.04.2024 | | 200 | 187 | 0,12 |
| **Woori Bank** | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.04.2024 (g) | | 1.000 | 1.013 | 0,65 |
| **Yango Justice International Ltd.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 17.02.2025 ^ | | 400 | 35 | 0,02 |
| 7,875 % fällig am 04.09.2024 ^ | | 200 | 18 | 0,01 |
| **Yanlord Land HK Co. Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 20.05.2026 | | 600 | 457 | 0,30 |
| | | | 42.611 | 27,50 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **AAC Technologies Holdings, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 02.06.2031 | | 200 | 153 | 0,10 |
| **ABJA Investment Co. Pte. Ltd.** | | | | |
| 5,450 % fällig am 24.01.2028 | | 1.000 | 949 | 0,61 |
| **Adani Electricity Mumbai Ltd.** | | | | |
| 3,949 % fällig am 12.02.2030 | | 400 | 327 | 0,21 |
| **Alfa Desarrollo SpA** | | | | |
| 4,550 % fällig am 27.09.2051 | $ | 997 | $ 719 | 0,46 |
| **ALROSA Finance S.A.** | | | | |
| 3,100 % fällig am 25.06.2027 ^ | | 1.100 | 110 | 0,07 |
| **Altice Financing S.A.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.01.2028 | € | 700 | 548 | 0,35 |
| **America Movil S.A.B. de C.V.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 04.04.2032 | $ | 900 | 801 | 0,52 |
| **Andrade Gutierrez International S.A.** | | | | |
| 11,000 % fällig am 20.08.2021 ^ | | 0 | 0 | 0,00 |
| **AngloGold Ashanti Holdings PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 01.11.2028 | | 200 | 170 | 0,11 |
| 6,500 % fällig am 15.04.2040 | | 800 | 761 | 0,49 |
| **Antofagasta PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 14.10.2030 | | 700 | 543 | 0,35 |
| 5,625 % fällig am 13.05.2032 | | 400 | 386 | 0,25 |
| **ATP Tower Holdings LLC** | | | | |
| 4,050 % fällig am 27.04.2026 | | 500 | 414 | 0,27 |
| **Axiata SPV2 Bhd.** | | | | |
| 2,163 % fällig am 19.08.2030 | | 300 | 256 | 0,17 |
| **BOC Aviation USA Corp.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 29.04.2024 | | 700 | 671 | 0,43 |
| **Braskem Netherlands Finance BV** | | | | |
| 4,500 % fällig am 10.01.2028 | | 900 | 819 | 0,53 |
| **BRF S.A.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 24.01.2030 | | 900 | 714 | 0,46 |
| **Canacol Energy Ltd.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 24.11.2028 | | 700 | 568 | 0,37 |
| **Champion Path Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,850 % fällig am 27.01.2028 | | 200 | 118 | 0,08 |
| **China Modern Dairy Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 14.07.2026 | | 600 | 523 | 0,34 |
| **Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar oder 4,000 % PIK)** | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.12.2026 (a) | | 298 | 220 | 0,14 |
| **Corp. GEO S.A.B. de C.V.** | | | | |
| 8,875 % fällig am 25.09.2014 ^ | | 850 | 0 | 0,00 |
| **Coty, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.04.2026 | € | 300 | 278 | 0,18 |
| **CSN Inova Ventures** | | | | |
| 6,750 % fällig am 28.01.2028 | $ | 1.200 | 1.049 | 0,68 |
| **CT Trust** | | | | |
| 5,125 % fällig am 03.02.2032 | | 1.000 | 803 | 0,52 |
| **Digicel International Finance Ltd.** | | | | |
| 8,750 % fällig am 25.05.2024 | | 145 | 135 | 0,09 |
| **Ecopetrol S.A.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 02.11.2031 | | 100 | 76 | 0,05 |
| 6,875 % fällig am 29.04.2030 | | 2.100 | 1.863 | 1,20 |
| 7,375 % fällig am 18.09.2043 | | 1.000 | 818 | 0,53 |
| **Empresa Electrica Cochrane SpA** | | | | |
| 5,500 % fällig am 14.05.2027 | | 219 | 185 | 0,12 |
| **Energean Israel Finance Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 30.03.2024 | | 400 | 378 | 0,24 |
| 4,875 % fällig am 30.03.2026 | | 300 | 266 | 0,17 |
| **First Quantum Minerals Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.10.2027 | | 900 | 806 | 0,52 |
| **Fomento Economico Mexicano S.A.B. de C.V.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 28.05.2033 | € | 250 | 188 | 0,12 |
| 4,375 % fällig am 10.05.2043 | $ | 600 | 537 | 0,35 |
| **Fortune Star BVI Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 02.10.2026 | € | 500 | 312 | 0,20 |
| 5,950 % fällig am 19.10.2025 | $ | 800 | 513 | 0,33 |
| **Freeport Indonesia PT** | | | | |
| 4,763 % fällig am 14.04.2027 | | 900 | 866 | 0,56 |
| **Fresnillo PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 02.10.2050 | | 800 | 589 | 0,38 |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 4,950 % fällig am 23.03.2027 | | 1.000 | 300 | 0,19 |
| **Geopark Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 17.01.2027 | | 800 | 672 | 0,43 |
| **Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.05.2029 | | 700 | 716 | 0,46 |
| **Guara Norte SARL** | | | | |
| 5,198 % fällig am 15.06.2034 | | 1.123 | 913 | 0,59 |
| **Health & Happiness H&H International Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 24.10.2024 | | 800 | 700 | 0,45 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Hikma Finance USA LLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 09.07.2025 | $ | 1.000 | $ 951 | 0,61 |
| **ICL Group Ltd.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 31.05.2038 | | 400 | 398 | 0,26 |
| **IHS Netherlands Holdco BV** | | | | |
| 8,000 % fällig am 18.09.2027 | | 1.060 | 931 | 0,60 |
| **Industrias Penoles S.A.B. de C.V.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 06.08.2050 | | 600 | 477 | 0,31 |
| **InRetail Consumer** | | | | |
| 3,250 % fällig am 22.03.2028 | | 1.200 | 998 | 0,64 |
| **Invepar Holdings LLC** | | | | |
| 1,000 % fällig am 31.12.2049 (h) | | 210 | 0 | 0,00 |
| **JSW Steel Ltd.** | | | | |
| 5,050 % fällig am 05.04.2032 | | 600 | 447 | 0,29 |
| **Kosmos Energy Ltd.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 04.04.2026 | | 1.010 | 860 | 0,55 |
| **Leviathan Bond Ltd.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 30.06.2025 | | 600 | 566 | 0,37 |
| 6,500 % fällig am 30.06.2027 | | 800 | 741 | 0,48 |
| **LG Chem Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.04.2029 | | 1.600 | 1.525 | 0,98 |
| **Medco Oak Tree Pte. Ltd.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 14.05.2026 | | 700 | 639 | 0,41 |
| **Melco Resorts Finance Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 06.06.2025 | | 600 | 449 | 0,29 |
| 5,375 % fällig am 04.12.2029 | | 700 | 424 | 0,27 |
| 5,750 % fällig am 21.07.2028 | | 700 | 451 | 0,29 |
| **Metalsa S.A. de C.V.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 04.05.2031 | | 600 | 425 | 0,27 |
| **Metinvest BV** | | | | |
| 5,625 % fällig am 17.06.2025 | € | 850 | 506 | 0,33 |
| 8,500 % fällig am 23.04.2026 | $ | 400 | 210 | 0,14 |
| **MGM China Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 18.06.2025 | | 200 | 154 | 0,10 |
| 5,375 % fällig am 15.05.2024 | | 1.100 | 939 | 0,61 |
| 5,875 % fällig am 15.05.2026 | | 200 | 151 | 0,10 |
| **MTN Mauritius Investments Ltd.** | | | | |
| 4,755 % fällig am 11.11.2024 | | 900 | 877 | 0,57 |
| **Nakilat, Inc.** | | | | |
| 6,067 % fällig am 31.12.2033 | | 379 | 405 | 0,26 |
| **Novolipetsk Steel Via Steel Funding DAC** | | | | |
| 1,450 % fällig am 02.06.2026 | € | 1.100 | 448 | 0,29 |
| **OAS Restructuring BVI Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 31.03.2035 (h) | BRL | 475 | 4 | 0,00 |
| **OCP S.A.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 23.06.2051 | $ | 1.600 | 1.066 | 0,69 |
| 6,875 % fällig am 25.04.2044 | | 300 | 251 | 0,16 |
| **Odebrecht Holdco Finance Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 10.09.2058 (c) | | 3.424 | 30 | 0,02 |
| **Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.08.2022 (c)(e) | | 1.416 | 6 | 0,00 |
| **Organon & Co.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 30.04.2028 | € | 100 | 88 | 0,06 |
| 4,125 % fällig am 30.04.2028 | $ | 300 | 267 | 0,17 |
| **Oztel Holdings SPC Ltd.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 24.04.2028 | | 400 | 404 | 0,26 |
| **Periama Holdings LLC** | | | | |
| 5,950 % fällig am 19.04.2026 | | 300 | 270 | 0,17 |
| **Pertamina Persero PT** | | | | |
| 5,625 % fällig am 20.05.2043 | | 800 | 747 | 0,48 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 6,500 % fällig am 02.06.2041 | | 500 | 313 | 0,20 |
| 6,750 % fällig am 21.09.2047 | | 700 | 435 | 0,28 |
| **Petrorio Luxembourg Trading SARL** | | | | |
| 6,125 % fällig am 09.06.2026 | | 900 | 829 | 0,53 |
| **Prosus NV** | | | | |
| 3,061 % fällig am 13.07.2031 | | 1.500 | 1.106 | 0,71 |
| 3,257 % fällig am 19.01.2027 | | 200 | 174 | 0,11 |
| 4,027 % fällig am 03.08.2050 | | 300 | 187 | 0,12 |
| **Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd.** | | | | |
| 6,332 % fällig am 30.09.2027 | | 729 | 761 | 0,49 |
| **Rede D'or Finance SARL** | | | | |
| 4,500 % fällig am 22.01.2030 | | 213 | 180 | 0,12 |
| **Reliance Industries Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 12.01.2032 | | 600 | 498 | 0,32 |
| **ReNew Power Pvt Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 05.03.2027 | $ | 500 | $ 458 | 0,30 |
| **Rolls-Royce PLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.10.2027 | £ | 300 | 344 | 0,22 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 3,100 % fällig am 08.03.2029 | $ | 300 | 213 | 0,14 |
| 3,800 % fällig am 08.01.2026 | | 200 | 161 | 0,10 |
| 4,875 % fällig am 18.06.2030 | | 750 | 549 | 0,35 |
| 5,125 % fällig am 08.08.2025 | | 300 | 252 | 0,16 |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028 | | 900 | 695 | 0,45 |
| **Sappi Papier Holding GmbH** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.06.2032 | | 305 | 287 | 0,19 |
| **Sasol Financing USA LLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 27.03.2024 | | 500 | 490 | 0,32 |
| 6,500 % fällig am 27.09.2028 | | 1.700 | 1.543 | 1,00 |
| **Saudi Arabian Oil Co.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 24.11.2030 | | 2.100 | 1.792 | 1,16 |
| 4,250 % fällig am 16.04.2039 | | 1.500 | 1.390 | 0,90 |
| **Seplat Energy PLC** | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.04.2026 | | 400 | 359 | 0,23 |
| **Severstal OAO Via Steel Capital S.A.** | | | | |
| 3,150 % fällig am 16.09.2024 ^ | | 800 | 120 | 0,08 |
| **Stillwater Mining Co.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 16.11.2026 | | 1.400 | 1.170 | 0,75 |
| **Studio City Co. Ltd.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.02.2027 | | 300 | 260 | 0,17 |
| **Studio City Finance Ltd.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.01.2028 | | 900 | 506 | 0,33 |
| **Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 23.01.2023 | | 1.000 | 1.001 | 0,65 |
| **Suzano Austria GmbH** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.01.2031 | | 300 | 243 | 0,16 |
| 7,000 % fällig am 16.03.2047 | | 400 | 382 | 0,25 |
| **Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.08.2030 | | 900 | 688 | 0,44 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | | |
| 3,750 % fällig am 09.05.2027 | € | 2.100 | 1.865 | 1,20 |
| **Tullow Oil PLC** | | | | |
| 10,250 % fällig am 15.05.2026 | $ | 377 | 361 | 0,23 |
| **Turkish Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.09.2028 | | 640 | 532 | 0,34 |
| **Unigel Luxembourg S.A.** | | | | |
| 8,750 % fällig am 01.10.2026 | | 900 | 893 | 0,58 |
| **Vale Overseas Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 08.07.2030 | | 400 | 351 | 0,23 |
| 6,875 % fällig am 21.11.2036 | | 700 | 753 | 0,49 |
| **Vale S.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 29.12.2049 (e) | BRL | 6.700 | 539 | 0,35 |
| **Vedanta Resources Finance PLC** | | | | |
| 8,950 % fällig am 11.03.2025 | $ | 400 | 317 | 0,20 |
| **Votorantim Cimentos International S.A.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 05.04.2041 | | 200 | 216 | 0,14 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.10.2024 | | 700 | 521 | 0,34 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2026 | | 500 | 347 | 0,22 |
| **Xiaomi Best Time International Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 14.07.2031 | | 900 | 698 | 0,45 |
| **YPF S.A.** | | | | |
| 6,950 % fällig am 21.07.2027 | | 500 | 284 | 0,18 |
| **Yunda Holding Investment Ltd.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 19.08.2025 | | 1.000 | 909 | 0,59 |
| **Zhongsheng Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 13.01.2026 | | 700 | 653 | 0,42 |
| **Zoomlion HK SPV Co. Ltd.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 20.12.2022 | | 1.100 | 1.101 | 0,71 |
| | | | 67.564 | 43,60 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **DTEK Finance PLC (3,500 % bar und 3,500 % PIK)** | | | | |
| 7,000 % fällig am 31.12.2027 (a) | | 750 | 180 | 0,12 |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC** | | | | |
| 2,950 % fällig am 27.01.2029 | | 800 | 240 | 0,15 |
| **Greenko Power Ltd.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 13.12.2028 | | 293 | 235 | 0,15 |
| **Greenko Solar Mauritius Ltd.** | | | | |
| 5,550 % fällig am 29.01.2025 | $ | 1.000 | $ 940 | 0,61 |
| 5,950 % fällig am 29.07.2026 | | 300 | 268 | 0,17 |
| **IHS Holding Ltd.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 29.11.2026 | | 400 | 330 | 0,21 |
| **India Green Energy Holdings** | | | | |
| 5,375 % fällig am 29.04.2024 | | 1.250 | 1.170 | 0,75 |
| **Israel Electric Corp. Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 22.02.2032 | | 1.000 | 897 | 0,58 |
| 4,250 % fällig am 14.08.2028 | | 1.600 | 1.542 | 0,99 |
| **LLPL Capital Pte. Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 04.02.2039 | | 523 | 488 | 0,31 |
| **Lukoil Securities BV** | | | | |
| 3,875 % fällig am 06.05.2030 | | 1.600 | 848 | 0,55 |
| **MSU Energy S.A.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.02.2025 | | 400 | 292 | 0,19 |
| **NGD Holdings BV** | | | | |
| 6,750 % fällig am 31.12.2026 | | 284 | 126 | 0,08 |
| **Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar und 1,000 % PIK)** | | | | |
| 7,350 % fällig am 01.12.2026 ^(a) | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | | |
| 6,720 % fällig am 01.12.2022 ^ | | 229 | 221 | 0,14 |
| **Peru LNG SRL** | | | | |
| 5,375 % fällig am 22.03.2030 | | 700 | 567 | 0,37 |
| **Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara** | | | | |
| 5,250 % fällig am 24.10.2042 | | 300 | 258 | 0,17 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 6,625 % fällig am 16.01.2034 | £ | 400 | 447 | 0,29 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | | |
| 8,200 % fällig am 06.04.2028 | $ | 2.329 | 2.423 | 1,56 |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | | 97 | 101 | 0,07 |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027 | | 606 | 646 | 0,42 |
| **S.A. Global Sukuk Ltd.** | | | | |
| 2,694 % fällig am 17.06.2031 | | 1.000 | 881 | 0,57 |
| **Southern Gas Corridor CJSC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 24.03.2026 | | 900 | 886 | 0,57 |
| **Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 24.04.2033 | | 823 | 776 | 0,50 |
| | | | 14.762 | 9,52 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 124.937 | 80,62 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.05.2045 | | 8.600 | 7.984 | 5,15 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates** | | | | |
| 1,854 % fällig am 25.10.2035 | | 499 | 471 | 0,31 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,300 % fällig am 25.08.2036 | | 314 | 284 | 0,18 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,252 % fällig am 20.12.2035 | | 53 | 49 | 0,03 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,093 % fällig am 25.11.2037 | | 33 | 31 | 0,02 |
| | | | 835 | 0,54 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 7,250 % fällig am 25.05.2036 | | 398 | 234 | 0,15 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 1,844 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 43 | 44 | 0,03 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | |
| 1,814 % fällig am 25.04.2037 | | 146 | 101 | 0,07 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.** | | | | |
| 2,599 % fällig am 25.12.2035 | | 1.100 | 1.056 | 0,68 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 1,824 % fällig am 25.09.2037 | | 132 | 127 | 0,08 |
| | | | 1.562 | 1,01 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 09.07.2030 | | 18 | 4 | 0,00 |
| 1,125 % fällig am 09.07.2035 | | 11 | 2 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Colombia Government International Bond** | | | |
| 4,500 % fällig am 28.01.2026 | $ 1.000 | $ 940 | 0,61 |
| **Export-Credit Bank of Turkey** | | | |
| 8,250 % fällig am 24.01.2024 | 900 | 886 | 0,57 |
| **Oman Government International Bond** | | | |
| 6,250 % fällig am 25.01.2031 | 400 | 387 | 0,25 |
| **Provincia de Entre Rios Argentina** | | | |
| 5,000 % fällig am 08.08.2028 ^ | 155 | 107 | 0,07 |
| **Serbia Government International Bond** | | | |
| 1,650 % fällig am 03.03.2033 | € 300 | 198 | 0,13 |
| **Ukraine Government International Bond** | | | |
| 4,375 % fällig am 27.01.2030 | 300 | 79 | 0,05 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2024 | $ 300 | 77 | 0,05 |
| | | 2.680 | 1,73 |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **ENERGIE** | | | |
| **Constellation Oil Services Holding S.A. (b)(h)** | 361.648 | 39 | 0,02 |
| **Frontera Energy Corp. (b)** | 50.258 | 399 | 0,26 |
| | | 438 | 0,28 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **FINANZWERTE** | | | |
| **Hipotecaria Su Casita S.A. (b)** | 332.624 | $ 0 | 0,00 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| **Petra Diamonds Ltd. (b)** | 331.402 | 363 | 0,24 |
| | | 801 | 0,52 |
| **OPTIONSSCHEINE** | | | |
| **OAS S.A. - Exp. 21.01.2039 (h)** | 175.616 | 0 | 0,00 |

| | PARI (000S) | | |
|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **JAPAN TREASURY BILLS** | | | |
| (0,108) % fällig am 11.07.2022 (c)(d) | ¥ 230.000 | 1.693 | 1,09 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 1.693 | 1,09 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | **$142.485** | **91,94** |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)** | 814.006 | $ 8.098 | 5,23 |
| **PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)** | 25.272 | 343 | 0,22 |
| | | 8.441 | 5,45 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)** | 1.000 | 99 | 0,06 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$ 8.540** | **5,51** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 2.128 | U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | $ (2.171) | $ 2.128 | $ 2.128 | 1,37 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (2.171)** | **$ 2.128** | **$ 2.128** | **1,37** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 20 | $ 85 | 0,05 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 45 | (38) | (0,02) |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 59 | (37) | (0,02) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 62 | (42) | (0,03) |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2022 | 7 | 9 | 0,01 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2022 | 14 | 63 | 0,04 |
| | | | | $ 40 | 0,03 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 40** | **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 | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Jaguar Land Rover Automotive PLC | 5,000 % | 20.06.2026 | € 100 | $ (21) | (0,01) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-37 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2027 | $ 700 | $ (11) | (0,01) |
| iTraxx Crossover 37 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2027 | 3.100 | (255) | (0,17) |
| iTraxx Asia Ex-Japan 37 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 500 | (7) | 0,00 |
| | | | | $ (273) | (0,18) |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 0,076 % | 09.12.2022 | $ 11.100 | $ (41) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 | 21.06.2047 | 1.700 | 79 | 0,05 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,205 | 22.04.2027 | ZAR 7.200 | 14 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,210 | 22.04.2027 | 35.600 | (13) | (0,01) |
| | | | | | $ 39 | 0,03 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (255)** | **(0,16)** |

(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 | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,400 % | 17.08.2022 | 900 | $ (2) | $ (3) | 0,00 |

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Brazil Government International Bond | (1,000) % | 20.12.2024 | $ 2.700 | $ 10 | $ 37 | $ 47 | 0,03 |
| | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 1.000 | 16 | (19) | (3) | 0,00 |
| GST | Brazil Government International Bond | (1,000) | 20.06.2024 | 2.400 | 34 | (13) | 21 | 0,01 |
| MYC | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2024 | 1.350 | (2) | 4 | 2 | 0,00 |
| | | | | | $ 58 | $ 9 | $ 67 | 0,04 |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | America Movil S.A.B. de C.V. | 1,000 % | 20.12.2025 | $ 1.200 | $ (30) | $ 21 | $ (9) | (0,01) |
| | QNB Finance Ltd. | 1,000 | 20.06.2023 | 400 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| CBK | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2026 | 50 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 900 | (42) | (29) | (71) | (0,04) |
| MYC | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 400 | (1) | (12) | (13) | (0,01) |
| | | | | | $ (70) | $ (21) | $ (91) | (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 | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | $ 78 | ZAR 1.195 | $ 0 | $ (5) | $ (5) | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR 7.000 | $ 465 | 39 | 0 | 39 | 0,02 |
| | 11.2022 | 886 | 56 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | £ 878 | 1.106 | 40 | 0 | 40 | 0,03 |
| | 07.2022 | $ 8.225 | € 7.816 | 0 | (53) | (53) | (0,03) |
| | 08.2022 | € 7.429 | $ 7.828 | 47 | 0 | 47 | 0,03 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08.2022 | $ | 1.520 | ZAR | 24.621 | $ 0 | $ (23) | $ (23) | (0,02) |
| | 08.2022 | ZAR | 24.621 | $ | 1.542 | 46 | 0 | 46 | 0,03 |
| | 11.2022 | | 7.621 | | 473 | 14 | 0 | 14 | 0,01 |
| BRC | 07.2022 | ¥ | 230.000 | | 1.881 | 187 | 0 | 187 | 0,12 |
| | 11.2022 | ZAR | 4.819 | | 300 | 10 | 0 | 10 | 0,01 |
| CBK | 07.2022 | € | 158 | | 170 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| DUB | 12.2022 | $ | 105 | ZAR | 1.650 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | BRL | 1.464 | $ | 295 | 15 | 0 | 15 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 282 | BRL | 1.464 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | BRL | 1.464 | $ | 279 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 83 | HKD | 653 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10.2022 | ZAR | 11.726 | $ | 744 | 35 | 0 | 35 | 0,02 |
| | 11.2022 | | 939 | | 58 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 05.2023 | | 2.683 | | 161 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| JPM | 08.2022 | CNH | 1.112 | | 165 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | € | 104 | | 110 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 593 | ZAR | 9.585 | 0 | (9) | (9) | (0,01) |
| | 08.2022 | CNH | 2.537 | $ | 378 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 05.2023 | | 2.555 | | 381 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | $ | 6 | € | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 534 | CNY | 3.588 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 10.2022 | | 135 | ZAR | 2.198 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | ZAR | 2.584 | $ | 170 | 13 | 0 | 13 | 0,01 |
| | 08.2022 | CNH | 4.500 | | 672 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 858 | CNY | 5.744 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 97 | ZAR | 1.505 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | € | 7.554 | $ | 8.119 | 221 | 0 | 221 | 0,14 |
| UAG | 09.2022 | $ | 30 | HKD | 237 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 2.075 | $ | 132 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | | | | | | $ 689 | $ (111) | $ 578 | 0,37 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | CHF | 13 | $ | 13 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 3.854 | CHF | 3.683 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CHF | 323 | $ | 336 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2 | CHF | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | | 3.851 | | 3.687 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | CHF | 3.396 | $ | 3.575 | 28 | 0 | 28 | 0,02 |
| | 07.2022 | $ | 3.851 | CHF | 3.694 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 3.575 | | 3.390 | 0 | (28) | (28) | (0,02) |
| SCX | 07.2022 | CHF | 75 | $ | 76 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | | | | | | $ 36 | $ (40) | $ (4) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | € | 35 | $ | 38 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | | 40.049 | | 42.128 | 259 | 0 | 259 | 0,17 |
| | 08.2022 | $ | 41.601 | € | 39.480 | 0 | (250) | (250) | (0,16) |
| CBK | 07.2022 | € | 1.353 | $ | 1.452 | 38 | 0 | 38 | 0,02 |
| MBC | 07.2022 | | 40.279 | | 42.376 | 265 | 0 | 265 | 0,17 |
| | 07.2022 | $ | 44.715 | € | 41.464 | 0 | (1.365) | (1.365) | (0,88) |
| | 08.2022 | | 41.609 | | 39.480 | 0 | (258) | (258) | (0,17) |
| SOG | 07.2022 | | 44.542 | | 41.442 | 0 | (1.217) | (1.217) | (0,78) |
| UAG | 07.2022 | | 39.929 | | 37.157 | 0 | (1.083) | (1.083) | (0,70) |
| | | | | | | $ 563 | $ (4.173) | $ (3.610) | (2,33) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **$ (3.063)** | **(1,98)** |
| **Summe Anlagen** | | | | | | | | **$ 149.875** | **96,71** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | | | | | | | **$ 5.097** | **3,29** |
| **Nettovermögen** | | | | | | | | **$ 154.972** | **100,00** |

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

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

**(b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

**(c) Nullkuponwertpapier.**

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

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

**(f) Mit dem Fonds verbunden.**

**(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(h) Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|
| Constellation Oil Services Holding S.A. | 10.06.2022 | $ 39 | $ 39 | 0,02 |
| Development Bank of Southern Africa 8,600 % fällig am 21.10.2024 | 07.10.2021 | 1.498 | 1.336 | 0,86 |
| Invepar Holdings LLC 1,000 % fällig am 31.12.2049 | 16.11.2018 | 0 | 0 | 0,00 |
| OAS Restructuring BVI Ltd, 5,000 % fällig am 31.03.2035 | 16.11.2018 | 13 | 4 | 0,00 |
| OAS S.A. - Exp. 21.01.2039 | 16.11.2018 | 5 | 0 | 0,00 |
| | | $ 1.555 | $ 1.379 | 0,88 |

**Barmittel in Höhe von USD 874 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 3.290 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 399 | $ 138.888 | $ 3.198 | $ 142.485 |
| Investmentfonds | 8.441 | 99 | 0 | 8.540 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 2.128 | 0 | 2.128 |
| Finanzderivate[3] | 85 | (3.363) | 0 | (3.278) |
| **Summen** | **$ 8.997** | **$ 137.680** | **$ 3.198** | **$ 149.875** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 741 | $ 192.610 | $ 4.310 | $ 197.661 |
| Investmentfonds | 10.650 | 0 | 0 | 10.650 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 487 | 0 | 487 |
| Finanzderivate[3] | 0 | 1.245 | 0 | 1.245 |
| **Summen** | **$ 11.391** | **$ 194.342** | **$ 4.310** | **$ 210.043** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 71 | $ 0 | $ 71 |
| BPS | 78 | 0 | 78 |
| BRC | 191 | 0 | 191 |
| CBK | (31) | 260 | 229 |
| DUB | 2 | 0 | 2 |
| GLM | 54 | 0 | 54 |
| GST | 21 | 0 | 21 |
| JPM | (1) | 0 | (1) |
| MBC | (1,368) | 1.240 | (128) |
| MYC | (11) | 0 | (11) |
| MYI | (1) | (10) | (11) |
| SCX | 4 | 0 | 4 |
| SOG | (996) | 1.030 | 34 |
| UAG | (1.076) | 760 | (316) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 71,58 | 73,77 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 20,33 | 19,08 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 0,03 | 0,00 |
| Investmentfonds | 5,51 | 5,00 |
| Pensionsgeschäfte | 1,37 | 0,23 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,03 | 0,00 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,16) | (0,19) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (1,98) | 0,77 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 1,28 | 1,06 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 80,62 | 81,26 |
| US-Schatzobligationen | 5,15 | 4,84 |
| Non-Agency-MBS | 0,54 | 0,51 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 1,01 | 0,80 |
| Staatsemissionen | 1,73 | 4,03 |
| Stammaktien | 0,52 | 0,35 |
| Optionsscheine | 0,00 | 0,00 |
| Kurzfristige Instrumente | 1,09 | k. A. |
| Investmentfonds | 5,51 | 5,00 |
| Pensionsgeschäfte | 1,37 | 0,23 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,03 | 0,00 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,01) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,18) | (0,01) |
| Zinsswaps | 0,03 | (0,18) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | 0,00 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf | 0,04 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,06) | 0,00 |
| Zinsswaps | k. A. | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | 0,37 | 0,03 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (2,33) | 0,74 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 3,29 | 1,34 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **ARGENTINIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 09.07.2030 | $ | 3.296 | $ 718 | 0,27 |
| 1,125 % fällig am 09.07.2035 | | 673 | 139 | 0,05 |
| Summe Argentinien | | | 857 | 0,32 |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Mineral Resources Ltd.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.11.2027 | | 700 | 684 | 0,25 |
| **BAHAMAS** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Bahamas Government International Bond** | | | | |
| 9,000 % fällig am 16.06.2029 | | 400 | 322 | 0,12 |
| **WEISSRUSSLAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Belarus Government International Bond** | | | | |
| 6,200 % fällig am 28.02.2030 | | 200 | 30 | 0,01 |
| 6,378 % fällig am 24.02.2031 | | 300 | 45 | 0,02 |
| Summe Belarus | | | 75 | 0,03 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco BTG Pactual S.A.** | | | | |
| 8,300 % fällig am 15.08.2024 | BRL | 10.000 | 1.764 | 0,66 |
| **Oi S.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.02.2035 | | 350 | 277 | 0,10 |
| 10,000 % fällig am 27.07.2025 | $ | 300 | 147 | 0,06 |
| **Vale S.A.** | | | | |
| 0,000 % (c) | BRL | 46.580 | 3.748 | 1,39 |
| Summe Brasilien | | | 5.936 | 2,21 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **WANDELANLEIHEN & WECHSEL** | | | | |
| **Bilibili, Inc.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.12.2026 | $ | 700 | 496 | 0,19 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Kaisa Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 9,375 % fällig am 30.06.2024 ^ | | 3.400 | 474 | 0,18 |
| 9,750 % fällig am 28.09.2023 ^ | | 700 | 97 | 0,03 |
| 11,700 % fällig am 11.11.2025 ^ | | 200 | 28 | 0,01 |
| **Poinsettia Finance Ltd.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 17.06.2031 | | 851 | 772 | 0,29 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 09.07.2023 ^ | | 400 | 61 | 0,02 |
| 7,250 % fällig am 14.06.2022 ^ | | 200 | 30 | 0,01 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 26.08.2028 | | 300 | 186 | 0,07 |
| | | | 1.648 | 0,61 |
| Summe Cayman Inseln | | | 2.144 | 0,80 |
| **CHILE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Alfa Desarrollo SpA** | | | | |
| 4,550 % fällig am 27.09.2051 | | 798 | 575 | 0,21 |
| **Empresa de los Ferrocarriles del Estado** | | | | |
| 3,068 % fällig am 18.08.2050 | | 5.100 | 3.082 | 1,15 |
| **Empresa Electrica Cochrane SpA** | | | | |
| 5,500 % fällig am 14.05.2027 | | 1.170 | 986 | 0,37 |
| | | | 4.643 | 1,73 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.01.2043 | CLP | 190.000 | 196 | 0,07 |
| Summe Chile | | | 4.839 | 1,80 |
| **CHINA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Huarong Universe Investment Holding Ltd.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 05.12.2022 | € | 1.200 | $ 1.211 | 0,45 |
| **Yango Justice International Ltd.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 17.02.2025 ^ | $ | 1.100 | 96 | 0,03 |
| Summe China | | | 1.307 | 0,48 |
| **KOLUMBIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Republic of Colombia** | | | | |
| 1,000 % fällig am 28.04.2028 | COP | 4.828.000 | 908 | 0,34 |
| **KONGO** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Congolese International Bond** | | | | |
| 6,000 % fällig am 30.06.2029 | $ | 705 | 604 | 0,22 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 1.082 | 120 | 0,04 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 3.663 | 424 | 0,16 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 18.386 | 2.032 | 0,76 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 5.237 | 606 | 0,22 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 6.197 | 684 | 0,25 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 2.673 | 284 | 0,11 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 3.264 | 378 | 0,14 |
| Summe Dänemark | | | 4.528 | 1,68 |
| **DOMINIKANISCHE REPUBLIK** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Dominican Republic Government International Bond** | | | | |
| 8,900 % fällig am 15.02.2023 | DOP | 87.100 | 1.585 | 0,59 |
| **GHANA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ghana Government International Bond** | | | | |
| 8,625 % fällig am 07.04.2034 | $ | 2.100 | 1.022 | 0,38 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Fortune Star BVI Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 02.10.2026 | € | 700 | 436 | 0,16 |
| 4,350 % fällig am 06.05.2023 | | 800 | 663 | 0,25 |
| Summe Hongkong | | | 1.099 | 0,41 |
| **UNGARN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Hungary Government International Bond** | | | | |
| 5,250 % fällig am 16.06.2029 | $ | 1.500 | 1.498 | 0,56 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Freeport Indonesia PT** | | | | |
| 5,315 % fällig am 14.04.2032 | | 1.200 | 1.094 | 0,41 |
| **Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT** | | | | |
| 3,398 % fällig am 09.06.2031 | | 1.400 | 1.090 | 0,40 |
| Summe Indonesien | | | 2.184 | 0,81 |
| **IRLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Black Diamond CLO DAC** | | | | |
| 0,860 % fällig am 20.01.2032 | € | 499 | 515 | 0,19 |
| **Cairn CLO DAC** | | | | |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | | 800 | 815 | 0,30 |
| **Carlyle Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,700 % fällig am 15.01.2031 | | 1.400 | 1.430 | 0,53 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.11.2031 | | 1.300 | 1.335 | 0,50 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 26.06.2030 | € | 1.386 | $ 1.424 | 0,53 |
| **Oak Hill European Credit Partners DAC** | | | | |
| 0,740 % fällig am 20.10.2031 | | 500 | 509 | 0,19 |
| | | | 6.028 | 2,24 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC** | | | | |
| 5,950 % fällig am 15.04.2030 ^(e) | $ | 900 | 99 | 0,04 |
| **Sovcombank Via SovCom Capital DAC** | | | | |
| 8,000 % fällig am 07.04.2030 ^(e) | | 400 | 28 | 0,01 |
| | | | 127 | 0,05 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **European Loan Conduit DAC** | | | | |
| 1,000 % fällig am 17.02.2030 | € | 299 | 308 | 0,11 |
| Summe Irland | | | 6.463 | 2,40 |
| **ISRAEL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bank Hapoalim B.M.** | | | | |
| 3,255 % fällig am 21.01.2032 (e) | $ | 600 | 516 | 0,19 |
| **ELFENBEINKÜSTE** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Republik Côte d'Ivoire** | | | | |
| 5,000 % fällig am 19.03.2027 | € | 1.000 | 1.005 | 0,37 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Corsair International Ltd.** | | | | |
| 4,850 % fällig am 28.01.2027 | | 1.700 | 1.678 | 0,62 |
| 5,200 % fällig am 28.01.2029 | | 800 | 781 | 0,29 |
| Summe Jersey, Kanalinseln | | | 2.459 | 0,91 |
| **JORDANIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Jordan Government International Bond** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.01.2028 | $ | 600 | 561 | 0,21 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **FEL Energy SARL** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.12.2040 | | 2.637 | 1.919 | 0,71 |
| **Guara Norte SARL** | | | | |
| 5,198 % fällig am 15.06.2034 | | 2.528 | 2.055 | 0,77 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 23.05.2023 ^(e) | | 1.600 | 112 | 0,04 |
| Summe Luxemburg | | | 4.086 | 1,52 |
| **MEXIKO** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Metalsa S.A. de C.V.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 04.05.2031 | | 800 | 567 | 0,21 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 6,375 % fällig am 23.01.2045 | | 1.800 | 1.094 | 0,41 |
| 6,500 % fällig am 02.06.2041 | | 4.000 | 2.503 | 0,93 |
| 7,690 % fällig am 23.01.2050 | | 1.100 | 751 | 0,28 |
| **Trust Fibra Uno** | | | | |
| 4,869 % fällig am 15.01.2030 | | 400 | 339 | 0,12 |
| 6,390 % fällig am 15.01.2050 | | 2.500 | 1.994 | 0,74 |
| Summe Mexiko | | | 7.248 | 2,69 |
| **MAROKKO** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Morocco Government International Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.12.2050 | | 900 | 529 | 0,20 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Mong Duong Finance Holdings BV** | | | | |
| 5,125 % fällig am 07.05.2029 | | 2.800 | 2.264 | 0,84 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Prosus NV** | | | | |
| 3,832 % fällig am 08.02.2051 | $ | 1.300 | $ 785 | 0,29 |
| **Republic of Angola Via Avenir BV** | | | | |
| 6,609 % fällig am 07.12.2023 | | 1.620 | 1.600 | 0,60 |
| 10,447 % fällig am 01.07.2023 | | 269 | 270 | 0,10 |
| Summe Niederlande | | | 4.919 | 1,83 |
| **PERU** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco de Credito del Peru S.A.** | | | | |
| 4,650 % fällig am 17.09.2024 | PEN | 2.600 | 634 | 0,23 |
| **Petroleos del Peru S.A.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 19.06.2047 | $ | 3.000 | 2.045 | 0,76 |
| | | | 2.679 | 0,99 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | PEN | 700 | 168 | 0,06 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 | | 2.600 | 645 | 0,24 |
| 6,950 % fällig am 12.08.2031 | | 2.800 | 700 | 0,26 |
| 8,200 % fällig am 12.08.2026 | | 14.700 | 4.046 | 1,51 |
| | | | 5.559 | 2,07 |
| Summe Peru | | | 8.238 | 3,06 |
| **PHILIPPINEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Globe Telecom, Inc.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 23.07.2035 | $ | 700 | 513 | 0,19 |
| **RUMÄNIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Romania Government International Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 14.04.2033 | € | 1.500 | 1.021 | 0,38 |
| 2,625 % fällig am 02.12.2040 | | 1.900 | 1.158 | 0,43 |
| 2,875 % fällig am 13.04.2042 | | 700 | 429 | 0,16 |
| Summe Rumänien | | | 2.608 | 0,97 |
| **RUSSLAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Russia Government International Bond** | | | | |
| 1,125 % fällig am 20.11.2027 | | 100 | 29 | 0,01 |
| 5,100 % fällig am 28.03.2035 ^ | $ | 200 | 53 | 0,02 |
| Summe Russland | | | 82 | 0,03 |
| **SENEGAL** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Senegal Government International Bond** | | | | |
| 6,750 % fällig am 13.03.2048 | | 800 | 512 | 0,19 |
| **SERBIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Serbia Government International Bond** | | | | |
| 1,500 % fällig am 26.06.2029 | € | 1.500 | 1.138 | 0,42 |
| 2,050 % fällig am 23.09.2036 | | 700 | 433 | 0,16 |
| 4,500 % fällig am 20.08.2032 | RSD | 39.300 | 284 | 0,11 |
| Summe Serbien | | | 1.855 | 0,69 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Transnet SOC Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 26.07.2022 | $ | 900 | 863 | 0,32 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 10,500 % fällig am 21.12.2026 | ZAR | 153.900 | 9.948 | 3,70 |
| Summe Südafrika | | | 10.811 | 4,02 |
| **SRI LANKA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Sri Lanka Government International Bond** | | | | |
| 5,750 % fällig am 18.04.2023 ^ | $ | 1.000 | 325 | 0,12 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **TUNESIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Banque Centrale de Tunisie Government International Bond** | | | | |
| 6,750 % fällig am 31.10.2023 | € | 800 | $ 583 | 0,22 |
| **TÜRKEI** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Turkish Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.09.2028 | $ | 523 | 436 | 0,16 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **SOCAR Turkey Enerji A/S** | | | | |
| 3,450 % fällig am 11.08.2026 | € | 1.400 | 1.383 | 0,52 |
| Summe Türkei | | | 1.819 | 0,68 |
| **UGANDA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Republic of Uganda Government International Bond** | | | | |
| 14,250 % fällig am 23.08.2029 | UGX | 1.291.900 | 331 | 0,12 |
| 16,250 % fällig am 08.11.2035 | | 1.132.300 | 297 | 0,11 |
| Summe Uganda | | | 628 | 0,23 |
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Kuwait Projects Co. SPC Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 23.02.2027 | $ | 1.700 | 1.370 | 0,51 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Finance Department Government of Sharjah** | | | | |
| 4,000 % fällig am 28.07.2050 | | 800 | 542 | 0,20 |
| Summe Vereinigte Arabische Emirate | | | 1.912 | 0,71 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Antofagasta PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 14.10.2030 | | 700 | 543 | 0,20 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Canada Square Funding PLC** | | | | |
| 1,550 % fällig am 17.10.2051 | £ | 543 | 659 | 0,25 |
| **Canterbury Finance PLC** | | | | |
| 1,953 % fällig am 16.05.2056 | | 224 | 272 | 0,10 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | |
| 1,775 % fällig am 16.12.2069 | | 191 | 231 | 0,09 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2045 | | 824 | 1.000 | 0,37 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | |
| 1,902 % fällig am 12.06.2053 | | 248 | 301 | 0,11 |
| | | | 2.463 | 0,92 |
| Summe Großbritannien | | | 3.006 | 1,12 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Aames Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 2,929 % fällig am 25.06.2035 | $ | 900 | 791 | 0,29 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,644 % fällig am 25.04.2035 | | 539 | 525 | 0,20 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.10.2036 | | 684 | 492 | 0,18 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 2,599 % fällig am 25.12.2035 | | 415 | 412 | 0,15 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 1,834 % fällig am 25.10.2036 | | 232 | 229 | 0,09 |
| 1,894 % fällig am 25.07.2036 | | 288 | 245 | 0,09 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 2,599 % fällig am 25.07.2034 | | 24 | 23 | 0,01 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.07.2036 | | 900 | 838 | 0,31 |
| | | | 3.555 | 1,32 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 15.01.2051 | | 2.000 | 1.358 | 0,51 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 3,850 % fällig am 01.04.2061 | $ | 1.900 | $ 1.253 | 0,47 |
| **DAE Funding LLC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 15.02.2024 | | 400 | 379 | 0,14 |
| 2,625 % fällig am 20.03.2025 | | 600 | 559 | 0,21 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 3,550 % fällig am 07.10.2022 | | 200 | 199 | 0,07 |
| **Oracle Corp.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 01.04.2040 | | 700 | 524 | 0,19 |
| 4,100 % fällig am 25.03.2061 (f) | | 1.900 | 1.348 | 0,50 |
| **Southern California Edison Co.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 01.02.2051 | | 1.200 | 816 | 0,30 |
| **Stillwater Mining Co.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 16.11.2026 | | 600 | 502 | 0,19 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 15.11.2060 | | 2.600 | 1.901 | 0,71 |
| | | | 8.839 | 3,29 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,964 % fällig am 25.11.2036 | | 800 | 793 | 0,29 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.02.2042 | | 24.500 | 20.783 | 7,73 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 2,500 % fällig am 30.04.2024 | | 5.600 | 5.552 | 2,06 |
| | | | 26.335 | 9,79 |
| Summe USA | | | 39.522 | 14,69 |
| **USBEKISTAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ipoteka-Bank** | | | | |
| 5,500 % fällig am 19.11.2025 | | 700 | 649 | 0,24 |
| **Uzbek Industrial and Construction Bank ATB** | | | | |
| 5,750 % fällig am 02.12.2024 | | 700 | 644 | 0,24 |
| Summe Usbekistan | | | 1.293 | 0,48 |
| **JUNGFERNINSELN (BRITISCH)** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **1MDB Global Investments Ltd.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 09.03.2023 | | 2.600 | 2.522 | 0,94 |
| **SAMBIA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Zambia Government International Bond** | | | | |
| 13,000 % fällig am 25.01.2031 | ZMW | 4.500 | 152 | 0,06 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | | |
| 51,049 % fällig am 30.09.2022 (a)(b) | ARS | 5.900 | 20 | 0,01 |
| **ISRAEL TREASURY BILLS** | | | | |
| 0,010 % fällig am 07.10.2022 (a)(b) | ILS | 19.000 | 5.412 | 2,01 |
| 0,455 % fällig am 08.02.2023 (a)(b) | | 11.000 | 3.120 | 1,16 |
| 0,860 % fällig am 03.05.2023 (a)(b) | | 8.600 | 2.429 | 0,90 |
| | | | 10.961 | 4,07 |
| **JAPAN TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,138) % fällig am 08.08.2022 (a)(b) | ¥ | 1.480.000 | 10.896 | 4,05 |
| (0,106) % fällig am 29.08.2022 (a)(b) | | 1.430.000 | 10.528 | 3,91 |
| | | | 21.424 | 7,96 |
| **MALAYSIA TREASURY BILLS** | | | | |
| 2,281 % fällig am 17.11.2022 (a)(b) | MYR | 22.800 | 5.121 | 1,90 |
| 2,326 % fällig am 17.11.2022 (a)(b) | | 23.200 | 5.210 | 1,94 |
| | | | 10.331 | 3,84 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **U.S. TREASURY BILLS** | | | |
| 0,633 % fällig am 19.07.2022 (a)(b)(g) | $ 2.800 | $ 2.799 | 1,04 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 45.535 | 16,92 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | **$ 179.294** | **66,64** |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (d) | 6.300 | $ 624 | 0,23 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$ 26.781** | **9,95** |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d) | 2.629.399 | 26.157 | 9,72 |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MBC | 1,490 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 51.200 | U.S. Treasury Notes 1,250 % - 1,375 % fällig am 15.08.2031 - 15.11.2031 | $ (52.946) | $ 51.200 | $ 51.202 | 19,03 |
| SSB | 0,400 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 8.841 | U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026 | (9.018) | 8.841 | 8.841 | 3,29 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (61.964)** | **$ 60.041** | **$ 60.043** | **22,32** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month SOFR June Futures | Short | 09.2023 | 135 | $ 43 | 0,02 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 49 | 41 | 0,01 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 341 | (167) | (0,06) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 236 | 223 | 0,08 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2022 | 13 | 58 | 0,02 |
| | | | | $ 198 | 0,07 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 198** | **0,07** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 1,250 % | 15.09.2031 | SGD 1.000 | $ (12) | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 1,250 | 15.09.2031 | 1.000 | 95 | 0,03 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,562 | 14.02.2024 | $ 22.300 | 426 | 0,16 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,580 | 02.01.2025 | BRL 10.000 | (240) | (0,09) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 6,220 | 02.01.2025 | 4.600 | (85) | (0,03) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,675 | 02.01.2023 | 14.500 | 98 | 0,04 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,745 | 02.01.2025 | 10.500 | 144 | 0,05 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 6,950 | 04.01.2027 | 8.300 | (192) | (0,07) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 8,570 | 04.01.2027 | 11.900 | 238 | 0,09 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 8,615 | 02.01.2025 | 6.000 | (46) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,120 | 04.01.2027 | 2.500 | (32) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,206 | 04.01.2027 | 9.400 | (114) | (0,04) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,446 | 04.01.2027 | 28.200 | (301) | (0,11) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,665 | 02.01.2024 | 5.800 | (37) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,755 | 02.01.2024 | 22.000 | (134) | (0,05) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 10,800 | 02.01.2024 | 51.900 | 307 | 0,11 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,833 | 02.01.2024 | 31.800 | (187) | (0,07) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,995 | 02.01.2024 | 15.300 | (82) | (0,03) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,055 | 04.01.2027 | 22.200 | (175) | (0,07) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,065 | 02.01.2024 | 10.600 | (53) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,148 | 02.01.2024 | 2.600 | (12) | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 11,170 | 04.01.2027 | 24.800 | 172 | 0,06 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 11,920 % | 02.01.2024 | BRL | 99.100 | $ 327 | 0,12 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,290 | 02.01.2024 | | 54.800 | (206) | (0,08) |
| Erhalt | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,500 | 16.03.2027 | CNY | 35.200 | 21 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 2,690 | 24.07.2024 | COP | 7.257.000 | 235 | 0,09 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 2,740 | 24.07.2024 | | 7.084.900 | (228) | (0,08) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 3,100 | 26.11.2025 | | 2.651.000 | 118 | 0,04 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,060 | 26.11.2025 | | 14.071.000 | 527 | 0,20 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,110 | 23.03.2026 | | 4.493.200 | (166) | (0,06) |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,651 | 26.11.2025 | | 2.624.800 | (87) | (0,03) |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,050 | 16.07.2026 | | 34.330.400 | (1.181) | (0,44) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 6,130 | 26.10.2026 | | 25.320.800 | 666 | 0,25 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 6,885 | 31.01.2025 | | 24.609.000 | 345 | 0,13 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,080 | 02.02.2027 | | 1.622.900 | 30 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,090 | 28.04.2028 | | 1.750.200 | 37 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,130 | 31.01.2027 | | 8.865.000 | 159 | 0,06 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,130 | 28.04.2028 | | 618.500 | 13 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,140 | 28.04.2028 | | 1.855.800 | 38 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,320 | 31.03.2027 | | 2.908.000 | (23) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,560 | 30.03.2027 | | 4.424.200 | (25) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,686 | 30.03.2027 | | 26.334.600 | (119) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,750 | 15.12.2026 | KRW | 37.908.900 | (2.193) | (0,82) |
| Erhalt | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,750 | 15.12.2031 | | 19.488.000 | 1.906 | 0,71 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,750 | 16.06.2031 | $ | 2.500 | 276 | 0,10 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,000 | 16.12.2025 | | 7.900 | (770) | (0,29) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 17.06.2025 | | 400 | (32) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 17.06.2030 | | 3.070 | (491) | (0,18) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 16.12.2050 | | 1.500 | 510 | 0,19 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 16.06.2051 | | 4.500 | 665 | 0,25 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 16.06.2051 | | 6.800 | 982 | 0,36 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 21.06.2024 | | 7.100 | (145) | (0,05) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 18.12.2024 | | 270 | 12 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 18.12.2029 | | 4.100 | 307 | 0,11 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 | 15.12.2031 | | 2.700 | 343 | 0,13 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 21.12.2046 | | 1.800 | (255) | (0,09) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 5,757 | 14.04.2026 | ZAR | 96.300 | (393) | (0,15) |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 6,665 | 09.01.2023 | | 20.100 | (12) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 6,670 | 13.12.2022 | | 83.500 | (31) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 0,700 | 24.11.2022 | CLP | 966.100 | 39 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 0,905 | 24.11.2023 | | 1.293.300 | 154 | 0,06 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 0,975 | 03.04.2023 | | 110.000 | (7) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,070 | 07.04.2023 | | 675.000 | (51) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,070 | 10.12.2023 | | 1.218.000 | (139) | (0,05) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,080 | 10.12.2023 | | 1.218.000 | (139) | (0,05) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,090 | 10.12.2023 | | 2.828.000 | (328) | (0,12) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,183 | 27.03.2023 | | 357.900 | (29) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,190 | 19.03.2023 | | 970.000 | (72) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,200 | 27.03.2023 | | 103.400 | (5) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,345 | 11.06.2025 | | 1.350.000 | 236 | 0,09 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,900 | 01.03.2023 | | 565.000 | 36 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,947 | 23.11.2027 | | 999.000 | 231 | 0,09 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,950 | 05.05.2026 | | 1.239.600 | (238) | (0,09) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,965 | 24.11.2027 | | 851.000 | 196 | 0,07 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,020 | 30.04.2026 | | 1.300.000 | (245) | (0,09) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,110 | 01.03.2023 | | 1.030.000 | 66 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,120 | 01.03.2023 | | 1.290.000 | 82 | 0,03 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,183 | 04.12.2027 | | 2.661.000 | (594) | (0,22) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,360 | 22.01.2025 | | 1.099.200 | (167) | (0,06) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,640 | 01.03.2026 | | 795.000 | 133 | 0,05 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,530 | 06.07.2026 | | 1.995.000 | 288 | 0,11 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 4,000 | 06.07.2028 | | 1.019.000 | 153 | 0,06 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,130 | 01.03.2025 | | 1.820.000 | 134 | 0,05 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,180 | 01.10.2028 | | 790.000 | 66 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,240 | 01.09.2030 | | 1.286.000 | 112 | 0,04 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,260 | 01.03.2026 | | 620.000 | 40 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,370 | 01.10.2028 | | 3.136.000 | 226 | 0,08 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,470 | 01.09.2030 | | 460.000 | 30 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,570 | 01.10.2028 | | 245.000 | 14 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,720 | 28.01.2025 | | 4.012.000 | 228 | 0,08 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,754 | 28.01.2025 | | 3.238.000 | 182 | 0,07 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,760 | 28.01.2025 | | 1.933.000 | 104 | 0,04 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,915 | 01.02.2025 | | 3.534.300 | 178 | 0,07 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,020 | 02.03.2029 | | 190.000 | (6) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,270 | 02.03.2027 | | 415.700 | (10) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,360 | 25.05.2027 | | 24.600 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,386 | 24.05.2027 | | 1.861.000 | (35) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,530 | 28.01.2023 | | 5.882.000 | (154) | (0,06) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,540 | 28.01.2023 | | 5.621.000 | (147) | (0,05) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,560 | 28.01.2023 | | 14.885.000 | (378) | (0,14) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,590 | 21.03.2027 | | 4.540.300 | (127) | (0,05) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,690 | 10.05.2025 | | 7.125.500 | (83) | (0,03) |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 0,670 | 28.01.2023 | CZK | 328.600 | 734 | 0,27 |
| Zahlung[1] | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,025 | 29.07.2030 | | 35.800 | (193) | (0,07) |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,224 % | 28.01.2031 | CZK | 68.900 | $ (799) | (0,30) |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,441 | 28.01.2023 | | 164.100 | (313) | (0,12) |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,575 | 26.03.2026 | | 28.100 | (169) | (0,06) |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,725 | 22.07.2026 | | 23.800 | (144) | (0,05) |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,815 | 28.01.2031 | | 34.200 | 336 | 0,12 |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 2,000 | 19.06.2024 | | 26.100 | (105) | (0,04) |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 2,255 | 15.01.2023 | | 122.200 | 188 | 0,07 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 3,490 | 18.01.2032 | | 10.600 | 52 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 3,680 | 03.03.2027 | | 78.400 | 208 | 0,08 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 4,164 | 14.03.2027 | | 73.600 | 170 | 0,06 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 4,220 | 14.03.2027 | | 73.500 | 162 | 0,06 |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 4,300 | 18.03.2027 | | 143.400 | (268) | (0,10) |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 4,310 | 15.03.2027 | | 19.100 | 39 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 4,320 | 15.03.2027 | | 7.200 | 15 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 5,606 | 28.06.2027 | | 54.800 | 10 | 0,00 |
| Erhalt[1] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2027 | € | 1.600 | 79 | 0,03 |
| Erhalt[1] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | | 2.300 | 234 | 0,09 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,550 | 15.12.2040 | | 300 | 122 | 0,05 |
| Erhalt | 6-Month HUF-BBR | 0,670 | 12.07.2022 | HUF | 230.200 | 9 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 1,500 | 19.06.2024 | | 1.427.600 | (574) | (0,21) |
| Erhalt | 6-Month HUF-BBR | 1,760 | 21.01.2030 | | 380.000 | 352 | 0,13 |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 1,958 | 19.03.2026 | | 398.600 | (232) | (0,09) |
| Erhalt | 6-Month HUF-BBR | 5,500 | 04.03.2027 | | 2.382.600 | 643 | 0,24 |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 6,280 | 18.03.2027 | | 2.363.300 | (443) | (0,16) |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 0,250 | 28.01.2023 | PLN | 57.900 | (667) | (0,25) |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 0,770 | 28.01.2023 | | 28.900 | 300 | 0,11 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 1,110 | 12.01.2031 | | 9.800 | 778 | 0,29 |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 1,165 | 28.01.2031 | | 4.400 | (197) | (0,07) |
| Erhalt[1] | 6-Month PLN-WIBOR | 1,215 | 29.07.2030 | | 10.300 | 378 | 0,14 |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 1,855 | 28.01.2031 | | 6.000 | (410) | (0,15) |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 1,933 | 17.01.2025 | | 11.800 | (394) | (0,15) |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 3,035 | 09.12.2026 | | 42.000 | 1.242 | 0,46 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 4,075 | 07.03.2027 | | 28.700 | 645 | 0,24 |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 4,830 | 18.03.2027 | | 28.300 | (426) | (0,16) |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 4,895 | 17.03.2027 | | 15.000 | (252) | (0,09) |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 4,920 | 17.03.2027 | | 15.000 | (249) | (0,09) |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 6,670 | 28.06.2027 | | 14.400 | (30) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 6,725 | 27.06.2027 | | 20.700 | 32 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 6,843 | 28.06.2027 | | 1.500 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,080 | 16.06.2025 | MXN | 16.400 | (89) | (0,03) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,700 | 12.09.2030 | | 35.400 | (329) | (0,12) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 5,770 | 09.10.2030 | | 150.700 | 1.376 | 0,51 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,850 | 19.08.2030 | | 12.100 | (107) | (0,04) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,875 | 16.08.2030 | | 16.800 | (147) | (0,05) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,880 | 16.08.2030 | | 8.700 | (76) | (0,03) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,920 | 16.08.2030 | | 9.100 | (79) | (0,03) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,240 | 10.07.2026 | | 156.300 | (680) | (0,25) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,383 | 30.08.2040 | | 23.200 | 277 | 0,10 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,480 | 28.05.2040 | | 69.300 | (301) | (0,11) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,495 | 17.07.2026 | | 140.500 | 609 | 0,23 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,505 | 17.07.2026 | | 102.100 | 441 | 0,16 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,520 | 03.08.2040 | | 5.700 | 64 | 0,02 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,520 | 06.08.2040 | | 8.100 | 92 | 0,03 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,533 | 03.08.2040 | | 10.900 | 123 | 0,05 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,580 | 01.01.2025 | | 29.700 | (92) | (0,03) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,580 | 03.08.2040 | | 6.000 | 66 | 0,02 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,830 | 27.12.2029 | | 19.900 | (111) | (0,04) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,845 | 02.07.2026 | | 118.100 | 355 | 0,13 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,570 | 19.11.2026 | | 145.200 | (526) | (0,20) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,675 | 04.06.2029 | | 65.100 | (207) | (0,08) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,480 | 24.03.2027 | | 121.900 | (151) | (0,06) |
| | | | | | | $ 2.282 | 0,85 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | | **$ 2.282** | **0,85** |

[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**

**DEVISENOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYI | Put - OTC GBP versus USD | $ 1,170 | 15.08.2022 | 7.263 | $ 75 | $ 43 | 0,02 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYI | Put - OTC GBP versus USD | $ 1,100 | 15.08.2022 | 10.895 | $ (32) | $ (11) | 0,00 |

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | | | | $ | | | | |
| | Brazil Government International Bond | (1,000) % | 20.12.2024 | 1.800 | $ 27 | $ 5 | $ 32 | 0,01 |
| BRC | Brazil Government International Bond | (1,000) | 20.12.2024 | 1.000 | 16 | 2 | 18 | 0,01 |
| CBK | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2024 | 100 | (1) | 1 | 0 | 0,00 |
| GST | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2024 | 2.000 | (23) | 26 | 3 | 0,00 |
| HUS | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2024 | 1.100 | (13) | 15 | 2 | 0,00 |
| JPM | Brazil Government International Bond | (1,000) | 20.12.2024 | 3.200 | 63 | (7) | 56 | 0,02 |
| | | | | | $ 69 | $ 42 | $ 111 | 0,04 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Montenegro Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2023 | € 500 | $ (39) | $ 24 | $ (15) | (0,01) |
| BRC | Argentina Government International Bond | 5,000 | 20.12.2023 | $ 4.400 | (673) | (626) | (1.299) | (0,48) |
| CBK | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 3.100 | (607) | (226) | (833) | (0,31) |
| JPM | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 8.300 | (398) | (291) | (689) | (0,26) |
| | Nigeria Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 600 | (14) | 12 | (2) | 0,00 |
| | State Oil Company of the Azerbaijan Republic | 5,000 | 20.06.2026 | 200 | 2 | (10) | (8) | 0,00 |
| | | | | | $ (1.729) | $ (1.117) | $ (2.846) | (1,06) |

(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.

## CROSS-CURRENCY SWAPS

| Kontrahent | Erhalt | Zahlung | Fälligkeits-datum | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl.0,282 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 07.06.2027 | $ 100 | ARS 4.488 | $ 0 | $ 87 | $ 87 | 0,03 |

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Erhalt | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,197 % | 18.03.2025 | KRW 10.794.000 | $ 0 | $ 517 | $ 517 | 0,19 |
| | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,750 | 15.06.2027 | MYR 21.600 | (38) | 19 | (19) | (0,01) |
| BPS | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,450 | 23.01.2025 | KRW 6.910.400 | 0 | (276) | (276) | (0,10) |
| | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 2,670 | 16.06.2026 | MYR 10.600 | 0 | (101) | (101) | (0,04) |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,890 | 18.09.2029 | THB 52.800 | 0 | (94) | (94) | (0,03) |
| CBK | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,050 | 18.03.2027 | 73.000 | 0 | (151) | (151) | (0,06) |
| GLM | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 0,868 | 18.03.2025 | 309.700 | 0 | (361) | (361) | (0,13) |
| | Erhalt | 6-Month THB-THBFIX | 1,000 | 15.12.2026 | 269.400 | 27 | 513 | 540 | 0,20 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,500 | 15.12.2031 | 282.900 | (121) | (840) | (961) | (0,36) |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,500 | 15.06.2027 | 162.100 | (18) | (22) | (40) | (0,01) |
| GST | Erhalt | 6-Month THB-THBFIX | 2,250 | 15.06.2027 | 157.800 | 100 | (7) | 93 | 0,03 |
| JPM | Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,020 | 06.06.2024 | CLP 770.000 | 0 | (82) | (82) | (0,03) |
| MYC | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,270 | 18.03.2030 | KRW 2.009.300 | 0 | (230) | (230) | (0,09) |
| | Erhalt | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,000 | 15.12.2026 | MYR 13.400 | 3 | 101 | 104 | 0,04 |
| | Erhalt | 6-Month THB-THBFIX | 1,000 | 15.12.2026 | THB 370.200 | 13 | 728 | 741 | 0,28 |
| | Erhalt | 6-Month THB-THBFIX | 1,265 | 24.01.2025 | 200.400 | 0 | 143 | 143 | 0,05 |
| | Erhalt | 6-Month THB-THBFIX | 1,310 | 21.01.2025 | 150.000 | 0 | 100 | 100 | 0,04 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,500 | 15.12.2031 | 190.500 | (57) | (591) | (648) | (0,24) |

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYI | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,340 % | 18.09.2029 | MYR 3.500 | $ 0 | $ (29) | $ (29) | (0,01) |
| SCX | Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,430 | 06.03.2025 | CNY 25.600 | 0 | 6 | 6 | 0,00 |
| | Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 3,020 | 04.02.2025 | 26.000 | 0 | 26 | 26 | 0,01 |
| | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 2,750 | 15.09.2026 | MYR 3.700 | 11 | (46) | (35) | (0,01) |
| | Erhalt | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,230 | 23.08.2024 | 6.500 | 0 | 8 | 8 | 0,00 |
| | Erhalt | 6-Month THB-THBFIX | 1,209 | 15.01.2025 | THB 199.300 | 0 | 148 | 148 | 0,05 |
| | Erhalt | 6-Month THB-THBFIX | 1,310 | 27.08.2024 | 50.000 | 0 | 27 | 27 | 0,01 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,428 | 13.12.2029 | 9.100 | 0 | (26) | (26) | (0,01) |
| UAG | Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,920 | 15.01.2025 | CNY 43.900 | 0 | 104 | 104 | 0,04 |
| | | | | | | $ (80) | $ (416) | $ (496) | (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 | 07.2022 | PEN | 24.427 | $ | 6.080 | $ 0 | $ (336) | $ (336) | (0,12) |
| | 07.2022 | $ | 348 | COP | 1.331.100 | 0 | (28) | (28) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 4.565 | DKK | 32.095 | 0 | (53) | (53) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 4.636 | PEN | 18.643 | 260 | (2) | 258 | 0,10 |
| | 08.2022 | DKK | 32.030 | $ | 4.565 | 54 | 0 | 54 | 0,02 |
| | 08.2022 | € | 5.947 | | 6.402 | 167 | 0 | 167 | 0,06 |
| | 08.2022 | ¥ | 1.480.000 | | 11.395 | 478 | 0 | 478 | 0,18 |
| | 08.2022 | MXN | 60.347 | | 2.973 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN | 7.480 | | 1.948 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 21.380 | € | 20.219 | 0 | (181) | (181) | (0,07) |
| | 09.2022 | IDR | 46.574.138 | $ | 3.150 | 45 | 0 | 45 | 0,02 |
| | 09.2022 | PEN | 7.977 | | 1.894 | 0 | (187) | (187) | (0,07) |
| | 11.2022 | MYR | 45.478 | | 10.345 | 39 | 0 | 39 | 0,01 |
| | 01.2023 | CNH | 44.408 | | 6.882 | 254 | 0 | 254 | 0,09 |
| | 02.2023 | $ | 6.875 | CNH | 44.408 | 0 | (245) | (245) | (0,09) |
| | 07.2023 | INR | 368.549 | $ | 4.581 | 82 | (8) | 74 | 0,03 |
| | 07.2023 | $ | 4.572 | INR | 368.549 | 0 | (65) | (65) | (0,02) |
| BPS | 07.2022 | HUF | 1.066.807 | $ | 2.801 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | PLN | 35.740 | | 7.989 | 51 | 0 | 51 | 0,02 |
| | 07.2022 | $ | 3.425 | HUF | 1.259.247 | 0 | (116) | (116) | (0,04) |
| | 07.2022 | | 8.746 | MXN | 179.893 | 185 | (15) | 170 | 0,06 |
| | 08.2022 | CNH | 44.408 | $ | 6.667 | 47 | 0 | 47 | 0,02 |
| | 08.2022 | € | 44 | | 47 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | INR | 1.889 | | 24 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | THB | 83 | | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 21.592 | | 735 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 2.081 | CLP | 1.813.146 | 0 | (159) | (159) | (0,06) |
| | 08.2022 | | 2.278 | PEN | 8.640 | 0 | (13) | (13) | (0,01) |
| | 08.2022 | ZAR | 62.046 | $ | 3.886 | 115 | 0 | 115 | 0,04 |
| | 09.2022 | CNH | 44.408 | | 6.704 | 85 | 0 | 85 | 0,03 |
| | 09.2022 | IDR | 215.642.327 | | 14.611 | 234 | 0 | 234 | 0,09 |
| | 09.2022 | MXN | 74.889 | | 3.671 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 09.2022 | MYR | 13.836 | | 3.178 | 41 | 0 | 41 | 0,02 |
| | 09.2022 | TWD | 20.854 | | 751 | 45 | 0 | 45 | 0,02 |
| | 09.2022 | $ | 6.651 | CNH | 44.408 | 0 | (31) | (31) | (0,01) |
| | 09.2022 | | 3.570 | IDR | 52.584.785 | 0 | (64) | (64) | (0,02) |
| | 10.2022 | CNH | 44.408 | $ | 6.691 | 70 | 0 | 70 | 0,03 |
| | 10.2022 | $ | 6.690 | CNH | 44.408 | 0 | (69) | (69) | (0,03) |
| | 10.2022 | | 985 | COP | 3.821.800 | 0 | (83) | (83) | (0,03) |
| | 11.2022 | CNH | 44.408 | $ | 6.786 | 163 | 0 | 163 | 0,06 |
| | 11.2022 | $ | 6.677 | CNH | 44.408 | 0 | (54) | (54) | (0,02) |
| | 11.2022 | ZAR | 15.762 | $ | 977 | 27 | 0 | 27 | 0,01 |
| | 12.2022 | CNH | 44.408 | | 6.804 | 178 | 0 | 178 | 0,07 |
| | 12.2022 | $ | 6.774 | CNH | 44.408 | 0 | (149) | (149) | (0,06) |
| | 01.2023 | | 6.791 | | 44.408 | 0 | (164) | (164) | (0,06) |
| | 02.2023 | ILS | 10.949 | $ | 3.254 | 79 | 0 | 79 | 0,03 |
| BRC | 07.2022 | $ | 5.857 | MYR | 25.663 | 0 | (30) | (30) | (0,01) |
| | 08.2022 | £ | 5.470 | $ | 6.743 | 94 | 0 | 94 | 0,03 |
| | 08.2022 | $ | 1.051 | SGD | 1.452 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 10.2022 | | 3.512 | COP | 14.210.017 | 0 | (159) | (159) | (0,06) |
| | 11.2022 | ZAR | 11.432 | $ | 712 | 23 | 0 | 23 | 0,01 |
| BSS | 07.2022 | $ | 401 | CLP | 342.576 | 0 | (36) | (36) | (0,01) |
| CBK | 07.2022 | BRL | 34.501 | $ | 6.690 | 93 | 0 | 93 | 0,03 |
| | 07.2022 | PEN | 198 | | 52 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 4.788 | BRL | 23.609 | 0 | (273) | (273) | (0,10) |
| | 07.2022 | | 26 | PEN | 95 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | VND | 10.112.180 | $ | 433 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN | 19.275 | | 5.059 | 12 | (5) | 7 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 6.638 | BRL | 34.501 | 0 | (97) | (97) | (0,04) |
| | 08.2022 | | 2.255 | IDR | 33.010.043 | 0 | (50) | (50) | (0,02) |
| | 08.2022 | | 241 | ¥ | 31.300 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 3.134 | PEN | 11.737 | 0 | (57) | (57) | (0,02) |
| | 08.2022 | ZAR | 9.233 | $ | 588 | 27 | 0 | 27 | 0,01 |
| | 09.2022 | $ | 203 | UYU | 8.254 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 10.2022 | ILS | 18.998 | $ | 5.597 | $ 136 | $ 0 | $ 136 | 0,05 |
| | 10.2022 | PEN | 10.554 | | 2.670 | 0 | (78) | (78) | (0,03) |
| | 11.2022 | ILS | 9.414 | | 2.986 | 269 | 0 | 269 | 0,10 |
| | 11.2022 | PEN | 6.800 | | 1.713 | 0 | (55) | (55) | (0,02) |
| | 11.2022 | $ | 949 | PKR | 217.111 | 93 | 0 | 93 | 0,03 |
| | 12.2022 | ILS | 35.391 | $ | 11.225 | 1.006 | 0 | 1.006 | 0,37 |
| | 12.2022 | PEN | 5.360 | | 1.377 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 12.2022 | $ | 1.577 | PEN | 6.615 | 138 | 0 | 138 | 0,05 |
| | 12.2022 | | 874 | VND | 20.695.760 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 05.2023 | ILS | 8.527 | $ | 2.518 | 32 | 0 | 32 | 0,01 |
| | 05.2023 | PEN | 3.123 | | 790 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | DKK | 8.743 | | 1.295 | 66 | 0 | 66 | 0,02 |
| | 07.2022 | PLN | 7.073 | | 1.621 | 50 | 0 | 50 | 0,02 |
| | 07.2022 | RON | 238 | | 51 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 26 | PEN | 94 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 32.139 | $ | 34.127 | 430 | 0 | 430 | 0,16 |
| | 08.2022 | £ | 2.088 | | 2.576 | 38 | 0 | 38 | 0,01 |
| | 08.2022 | TWD | 5.300 | | 178 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 5.213 | NOK | 51.710 | 26 | 0 | 26 | 0,01 |
| | 08.2022 | | 1.540 | THB | 53.467 | 0 | (25) | (25) | (0,01) |
| | 12.2022 | ZAR | 435 | $ | 28 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | MXN | 231.185 | | 11.321 | 0 | (133) | (133) | (0,05) |
| | 07.2022 | PLN | 304 | | 68 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2.255 | BRL | 10.892 | 0 | (172) | (172) | (0,06) |
| | 07.2022 | | 2.363 | CLP | 2.029.008 | 0 | (202) | (202) | (0,08) |
| | 07.2022 | | 2.020 | MYR | 8.841 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.086 | PEN | 4.023 | 0 | (30) | (30) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 26 | PLN | 114 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 1.710 | $ | 106 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | COP | 2.260.792 | | 561 | 22 | 0 | 22 | 0,01 |
| | 08.2022 | DOP | 50.833 | | 874 | 0 | (47) | (47) | (0,02) |
| | 08.2022 | EGP | 86.201 | | 4.465 | 0 | (23) | (23) | (0,01) |
| | 08.2022 | $ | 5.378 | CNH | 35.750 | 0 | (48) | (48) | (0,02) |
| | 08.2022 | | 3.051 | PEN | 11.772 | 37 | (2) | 35 | 0,01 |
| | 08.2022 | | 31 | TRY | 542 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 408 | ZAR | 5.996 | 0 | (44) | (44) | (0,02) |
| | 08.2022 | ZAR | 3.076 | $ | 190 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 09.2022 | EGP | 130.090 | | 6.685 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 14.223 | IDR | 209.631.680 | 0 | (247) | (247) | (0,09) |
| IND | 08.2022 | | 3.151 | CLP | 2.756.337 | 0 | (229) | (229) | (0,09) |
| | 08.2022 | | 2.278 | IDR | 33.554.940 | 0 | (37) | (37) | (0,01) |
| | 06.2024 | | 815 | TWD | 20.969 | 0 | (71) | (71) | (0,03) |
| JPM | 07.2022 | CLP | 4.928.510 | $ | 5.734 | 485 | 0 | 485 | 0,18 |
| | 07.2022 | MXN | 2.322 | | 118 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.879 | CZK | 44.053 | 0 | (20) | (20) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 434 | VND | 10.068.800 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | VND | 10.068.800 | $ | 432 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 2.941 | | 437 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | £ | 5.427 | | 6.630 | 34 | 0 | 34 | 0,01 |
| | 08.2022 | ¥ | 66.914 | | 512 | 18 | 0 | 18 | 0,01 |
| | 08.2022 | KRW | 2.628.575 | | 2.065 | 38 | 0 | 38 | 0,01 |
| | 08.2022 | SGD | 24 | | 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 61.756 | | 2.096 | 15 | 0 | 15 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 7.780 | £ | 6.260 | 0 | (172) | (172) | (0,06) |
| | 08.2022 | | 8.477 | SGD | 11.653 | 0 | (104) | (104) | (0,04) |
| | 08.2022 | | 1.110 | ZAR | 17.060 | 0 | (73) | (73) | (0,03) |
| | 09.2022 | TWD | 24.694 | $ | 888 | 53 | 0 | 53 | 0,02 |
| | 09.2022 | $ | 3.971 | EGP | 77.712 | 16 | 0 | 16 | 0,01 |
| | 11.2022 | | 307 | PKR | 67.847 | 19 | 0 | 19 | 0,01 |
| | 12.2022 | | 427 | VND | 10.068.800 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 06.2023 | | 1.504 | | 36.096.000 | 29 | 0 | 29 | 0,01 |
| MBC | 07.2022 | HUF | 16.655 | $ | 44 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2.255 | CLP | 1.886.326 | 0 | (246) | (246) | (0,09) |
| | 08.2022 | CNH | 6.689 | $ | 996 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 3.837 | CLP | 3.215.192 | 0 | (429) | (429) | (0,16) |
| | 08.2022 | | 2.489 | ZAR | 36.943 | 0 | (244) | (244) | (0,09) |
| | 09.2022 | MYR | 11.615 | $ | 2.665 | 31 | 0 | 31 | 0,01 |
| | 12.2022 | $ | 10.770 | ILS | 35.276 | 0 | (585) | (585) | (0,22) |
| | 05.2023 | CNH | 8.536 | $ | 1.272 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | COP | 1.331.100 | | 333 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK | 30.091 | | 4.465 | 234 | 0 | 234 | 0,09 |
| | 07.2022 | € | 19 | | 20 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 10.867 | CLP | 9.335.634 | 0 | (925) | (925) | (0,34) |
| | 07.2022 | | 957 | DKK | 6.736 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 6.722 | $ | 957 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 08.2022 | £ | 34 | | 42 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | INR | 3.173 | | 41 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | KRW | 3.402.172 | | 2.671 | 48 | 0 | 48 | 0,02 |
| | 08.2022 | TWD | 18.365 | | 623 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 3.256 | CNY | 21.862 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 330 | COP | 1.331.100 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.129 | € | 1.053 | 0 | (25) | (25) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 3.786 | THB | 130.434 | 0 | (91) | (91) | (0,03) |
| | 08.2022 | | 1.476 | ZAR | 23.657 | 0 | (39) | (39) | (0,01) |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 09.2022 | MYR | 14.290 | $ | 3.243 | $ 3 | $ 0 | $ 3 | 0,00 |
| | 09.2022 | TWD | 10.080 | | 361 | 20 | 0 | 20 | 0,01 |
| | 09.2022 | $ | 73 | TRY | 1.289 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RBC | 08.2022 | ¥ | 1.430.000 | $ | 11.308 | 744 | 0 | 744 | 0,28 |
| | 09.2022 | MXN | 5.848 | | 284 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 10.2022 | $ | 13.364 | MXN | 267.673 | 0 | (327) | (327) | (0,12) |
| SCX | 07.2022 | HUF | 6.702 | $ | 18 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 138 | ILS | 467 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 53 | PEN | 198 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 437 | VND | 10.112.180 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 11.865 | $ | 1.771 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 12.529 | | 13.440 | 304 | 0 | 304 | 0,11 |
| | 08.2022 | TRY | 97.884 | | 5.734 | 25 | 0 | 25 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 1.290 | CNH | 8.658 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 5.229 | CNY | 34.994 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 114 | € | 109 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 8.035 | IDR | 117.268.067 | 0 | (203) | (203) | (0,08) |
| | 08.2022 | ZAR | 21.293 | $ | 1.360 | 67 | 0 | 67 | 0,02 |
| | 09.2022 | MYR | 8.841 | | 2.024 | 19 | 0 | 19 | 0,01 |
| | 09.2022 | $ | 3.408 | COP | 13.689.104 | 0 | (162) | (162) | (0,06) |
| | 09.2022 | | 8.143 | MYR | 34.292 | 0 | (368) | (368) | (0,14) |
| | 09.2022 | ZAR | 397 | $ | 26 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 11.2022 | COP | 6.914.856 | | 1.627 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 11.2022 | $ | 374 | PKR | 81.632 | 18 | 0 | 18 | 0,01 |
| | 12.2022 | | 416 | VND | 9.867.631 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | CLP | 8.246.242 | $ | 9.552 | 770 | 0 | 770 | 0,29 |
| | 08.2022 | $ | 138 | ZAR | 2.046 | 0 | (14) | (14) | (0,01) |
| | 11.2022 | | 2.865 | ILS | 9.384 | 0 | (156) | (156) | (0,06) |
| TOR | 07.2022 | HUF | 1.642.360 | $ | 4.510 | 194 | 0 | 194 | 0,07 |
| | 08.2022 | ZAR | 965 | | 59 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | $ | 50 | HUF | 17.630 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 523 | ZAR | 8.416 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 08.2022 | CLP | 4.690.457 | $ | 5.365 | 405 | 0 | 405 | 0,15 |
| | 08.2022 | $ | 2.255 | PEN | 8.280 | 0 | (84) | (84) | (0,03) |
| | 08.2022 | | 114 | PHP | 5.984 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 08.2022 | ZAR | 958 | $ | 61 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 09.2022 | TRY | 60.240 | | 3.305 | 3 | (95) | (92) | (0,03) |
| | 09.2022 | $ | 788 | MXN | 15.694 | 0 | (19) | (19) | (0,01) |
| | 10.2022 | TRY | 30.221 | $ | 1.792 | 165 | 0 | 165 | 0,06 |
| | 11.2022 | $ | 1.533 | ZAR | 22.731 | 0 | (163) | (163) | (0,06) |
| | 12.2022 | TRY | 10.886 | $ | 491 | 0 | (64) | (64) | (0,02) |
| | 02.2023 | CNH | 44.408 | | 6.907 | 277 | 0 | 277 | 0,10 |
| | | | | | | $ 9.433 | $ (8.923) | $ 510 | 0,19 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Partially Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | € | 36 | $ | 38 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 6 | € | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CNY | 47.721 | $ | 7.117 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 89.568 | | 94.731 | 1.093 | 0 | 1.093 | 0,41 |
| | 07.2022 | $ | 12.711 | € | 12.131 | 0 | (28) | (28) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 3 | MXN | 65 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 5.715 | PLN | 25.524 | 0 | (58) | (58) | (0,02) |
| | 08.2022 | MXN | 65 | $ | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 7.117 | CNY | 47.741 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 70.015 | € | 66.446 | 0 | (421) | (421) | (0,16) |
| BRC | 07.2022 | | 5.062 | CNY | 34.005 | 16 | 0 | 16 | 0,01 |
| CBK | 07.2022 | € | 7.033 | $ | 7.538 | 184 | 0 | 184 | 0,07 |
| | 07.2022 | MXN | 65 | | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | BRL | 934 | | 185 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | € | 66.483 | | 69.941 | 436 | 0 | 436 | 0,16 |
| | 07.2022 | $ | 73.951 | € | 68.575 | 0 | (2.260) | (2.260) | (0,84) |
| | 08.2022 | | 70.028 | | 66.446 | 0 | (434) | (434) | (0,16) |
| MYI | 07.2022 | | 182 | BRL | 934 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | BRL | 934 | $ | 180 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | CNY | 41 | | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2.179 | CNY | 14.644 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | | 69.009 | € | 64.206 | 0 | (1.885) | (1.885) | (0,70) |
| | 07.2022 | | 676 | THB | 23.530 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | THB | 50.843 | $ | 1.447 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 54.352 | € | 50.579 | 0 | (1.474) | (1.474) | (0,55) |
| | 07.2022 | | 886 | RON | 4.102 | 0 | (19) | (19) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 801 | THB | 27.313 | 0 | (28) | (28) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 1.449 | | 50.843 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | | | | | | $ 1.757 | $ (6.638) | $ (4.881) | (1,81) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (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 | 07.2022 | $ 311 | £ 246 | $ 0 | $ (12) | $ (12) | (0,01) |
| BRC | 07.2022 | £ 17 | $ 21 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 23 | CNY 155 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 240 | £ 191 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | £ 74 | $ 93 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | PLN 113 | 25 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 25 | PLN 114 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | 22 | £ 18 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | € 28 | $ 29 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 7 | PLN 29 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | 30 | € 28 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | £ 37 | $ 46 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 35 | £ 29 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 19 | PLN 84 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 9 | CNY 61 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 18 | € 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | £ 239 | $ 291 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 12 | € 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 6 | THB 216 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 291 | £ 239 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | 308 | 245 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | PLN 0 | $ 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | THB 224 | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 0 | THB 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 6 | 224 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 7 | $ (35) | $ (28) | (0,01) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (7.511)** | **(2,79)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 261.085** | **97,04** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ 7.957** | **2,96** |
| **Nettovermögen** | **$ 269.042** | **100,00** |

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

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

**^** **Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a)** **Nullkuponwertpapier.**

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

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

**(d)** **Mit dem Fonds verbunden.**

**(e)** **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(f)** **Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeits-datum | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Oracle Corp. | 4,100 % | 25.03.2061 | 05.04.2021 - 16.04.2021 | $ 1.979 | $ 1.348 | 0,50 |

**(g)** **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 570 und Barmittel in Höhe von USD 9.396 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von USD 2.511 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 174.264 | $ 5.030 | $ 179.294 |
| Investmentfonds | 26.157 | 624 | 0 | 26.781 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 60.041 | 0 | 60.041 |
| Finanzderivate[3] | 0 | (5.016) | (15) | (5.031) |
| **Summen** | **$ 26.157** | **$ 229.913** | **$ 5.015** | **$ 261.085** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 260.774 | $ 4.484 | $ 265.258 |
| Investmentfonds | 15.188 | 0 | 0 | 15.188 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 688 | 0 | 688 |
| Finanzderivate[3] | 212 | 4.425 | (27) | 4.610 |
| **Summen** | **$ 15.400** | **$ 265.887** | **$ 4.457** | **$ 285.744** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 765 | $ (880) | $ (115) |
| BPS | 524 | (380) | 144 |
| BRC | (1.353) | 1.538 | 185 |
| BSS | (36) | 0 | (36) |
| CBK | 374 | 0 | 374 |
| DUB | 587 | (490) | 97 |
| GLM | (1.612) | 1.590 | (22) |
| GST | 96 | 0 | 96 |
| HUS | (2) | 0 | (2) |
| IND | (337) | 260 | (77) |
| JPM | (384) | 350 | (34) |
| MBC | (3.737) | 3.240 | (3.737) |
| MYC | 210 | (270) | (60) |
| MYI | (762) | 630 | (132) |
| RBC | 415 | (450) | (35) |
| SCX | (142) | 0 | (142) |
| SOG | (1.295) | 1.451 | 156 |
| TOR | 183 | (260) | (77) |
| UAG | (1.009) | 907 | (102) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 43,58 | 60,12 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 21,92 | 30,48 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 1,14 | 0,71 |
| Investmentfonds | 9,95 | 5,23 |
| Pensionsgeschäfte | 22,32 | 0,24 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,07 | 0,07 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,85 | (0,39) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (2,79) | 1,91 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Argentinien | 0,32 | 0,51 |
| Australien | 0,25 | 0,60 |
| Österreich | k. A. | 0,33 |
| Bahamas | 0,12 | 0,47 |
| Weissrussland | 0,03 | 0,14 |
| Bermuda | k. A. | 0,42 |
| Brasilien | 2,21 | 3,36 |
| Cayman-Inseln | 0,80 | 1,63 |
| Chile | 1,80 | 4,27 |
| China | 0,48 | 0,09 |
| Kolumbien | 0,34 | 0,85 |
| Kongo | 0,22 | k. A. |
| Costa Rica | k. A. | 0,09 |
| Dänemark | 1,68 | 2,09 |
| Dominikanische Republik | 0,59 | 1,04 |
| Ecuador | k. A. | 1,14 |
| Ägypten | k. A. | 1,40 |
| Frankreich | k. A. | 0,35 |
| Deutschland | k. A. | 0,61 |
| Ghana | 0,38 | 0,42 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Guatemala | k. A. | 0,15 |
| Hongkong | 0,41 | 0,53 |
| Ungarn | 0,56 | k. A. |
| Indien | k. A. | 0,91 |
| Indonesien | 0,81 | k. A. |
| Irland | 2,40 | 3,38 |
| Israel | 0,19 | 1,30 |
| Italien | k. A. | 0,55 |
| Elfenbeinküste | 0,37 | 0,93 |
| Japan | k. A. | 0,19 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,91 | k. A. |
| Jordanien | 0,21 | 0,87 |
| Kasachstan | k. A. | 0,38 |
| Luxemburg | 1,52 | 3,20 |
| Mauritius | k. A. | 0,18 |
| Mexiko | 2,69 | 4,17 |
| Marokko | 0,20 | 0,28 |
| Niederlande | 1,83 | 1,53 |
| Nigeria | k. A. | 0,71 |
| Norwegen | k. A. | 0,19 |
| Oman | k. A. | 0,55 |
| Pakistan | k. A. | 0,21 |
| Paraguay | k. A. | 0,16 |
| Peru | 3,06 | 3,76 |
| Philippinen | 0,19 | k. A. |
| Rumänien | 0,97 | 1,92 |
| Russland | 0,03 | k. A. |
| Saudi-Arabien | k. A. | 0,67 |
| Senegal | 0,19 | k. A. |
| Serbien | 0,69 | 0,69 |
| Singapur | k. A. | 4,24 |
| Südafrika | 4,02 | 5,31 |
| Sri Lanka | 0,12 | 0,19 |
| Schweden | k. A. | 0,21 |
| Schweiz | k. A. | 0,37 |
| Thailand | k. A. | 1,00 |
| Tunesien | 0,22 | k. A. |
| Türkei | 0,68 | 1,30 |
| Ukraine | k. A. | 1,20 |
| Uganda | 0,23 | k. A. |
| Vereinigte Arabische Emirate | 0,71 | 1,65 |
| Großbritannien | 1,12 | 2,26 |
| USA | 14,69 | 13,26 |
| Usbekistan | 0,48 | k. A. |
| Jungferninseln (Britisch) | 0,94 | 0,90 |
| Sambia | 0,06 | 0,67 |
| Kurzfristige Instrumente | 16,92 | 11,53 |
| Investmentfonds | 9,95 | 5,23 |
| Pensionsgeschäfte | 22,32 | 0,24 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,07 | 0,07 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | k. A. | 0,01 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | k. A. | 0,00 |
| Zinsswaps | 0,85 | (0,40) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Devisenoptionen | 0,02 | 0,09 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Devisenoptionen | 0,00 | (0,04) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf | 0,04 | 0,01 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (1,06) | (0,35) |
| Cross-Currency Swaps | 0,03 | 0,03 |
| Zinsswaps | (0,19) | 0,02 |
| Volatilitätsswaps | k. A. | 0,02 |
| Devisenterminkontrakte | 0,19 | 1,39 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (1,82) | 0,74 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 2,96 | 1,63 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **ARGENTINIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 09.07.2030 | $ | 99 | $ 21 | 0,09 |
| 1,125 % fällig am 09.07.2035 | | 105 | 21 | 0,08 |
| Summe Argentinien | | | 42 | 0,17 |
| **ASERBAIDSCHAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Steas Funding DAC** | | | | |
| 7,230 % fällig am 17.03.2026 | | 200 | 187 | 0,73 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.08.2022 (c)(e) | | 23 | 0 | 0,00 |
| **Oi S.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.02.2035 | BRL | 50 | 40 | 0,15 |
| **Swiss Insured Brazil Power Finance SARL** | | | | |
| 9,850 % fällig am 16.07.2032 | | 2.663 | 443 | 1,73 |
| **Vale S.A.** | | | | |
| 0,000 % (e) | | 1.490 | 120 | 0,47 |
| Summe Brasilien | | | 603 | 2,35 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Interoceanica Finance Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 30.11.2025 (c) | $ | 24 | 21 | 0,08 |
| **Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar und 1,000 % PIK)** | | | | |
| 7,350 % fällig am 01.12.2026 ^(b) | | 50 | 31 | 0,12 |
| Summe Cayman Inseln | | | 52 | 0,20 |
| **CHILE** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.01.2043 | CLP | 5.000 | 5 | 0,02 |
| **CHINA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Flourish Century** | | | | |
| 6,600 % fällig am 04.02.2049 ^(h) | $ | 200 | 22 | 0,09 |
| **KOLUMBIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Empresas Publicas de Medellin ESP** | | | | |
| 7,625 % fällig am 10.09.2024 | COP | 540.000 | 121 | 0,47 |
| 8,375 % fällig am 08.11.2027 | | 489.000 | 94 | 0,37 |
| | | | 215 | 0,84 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Colombian TES** | | | | |
| 5,750 % fällig am 03.11.2027 | | 4.700.100 | 895 | 3,49 |
| 6,000 % fällig am 28.04.2028 | | 117.700 | 22 | 0,09 |
| 6,250 % fällig am 26.11.2025 | | 1.912.000 | 403 | 1,57 |
| 7,000 % fällig am 30.06.2032 | | 18.000 | 3 | 0,01 |
| 7,500 % fällig am 26.08.2026 | | 361.300 | 77 | 0,30 |
| 9,250 % fällig am 28.05.2042 | | 24.600 | 5 | 0,02 |
| **Financiera de Desarrollo Territorial S.A. Findeter** | | | | |
| 7,875 % fällig am 12.08.2024 | | 12.000 | 3 | 0,01 |
| **Republic of Colombia** | | | | |
| 1,000 % fällig am 11.03.2027 | | 102.000 | 19 | 0,07 |
| 1,000 % fällig am 09.07.2036 | | 25.000 | 4 | 0,02 |
| | | | 1.431 | 5,58 |
| Summe Kolumbien | | | 1.646 | 6,42 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | DKK | 239 | 26 | 0,10 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 54 | $ 6 | 0,02 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 110 | 13 | 0,05 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 610 | 67 | 0,26 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 20 | 2 | 0,01 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 2.090 | 239 | 0,93 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 226 | 25 | 0,10 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 352 | 40 | 0,16 |
| Summe Dänemark | | | 418 | 1,63 |
| **UNGARN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ungarische Entwicklungsbank** | | | | |
| 0,375 % fällig am 09.06.2026 | € | 100 | 90 | 0,35 |
| **IRLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Black Diamond CLO DAC** | | | | |
| 0,860 % fällig am 20.01.2032 | | 100 | 103 | 0,40 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.11.2031 | | 100 | 103 | 0,40 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 26.06.2030 | | 99 | 102 | 0,40 |
| | | | 308 | 1,20 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC** | | | | |
| 9,350 % fällig am 06.08.2022 ^ | RUB | 33.000 | 18 | 0,07 |
| Summe Irland | | | 326 | 1,27 |
| **ISRAEL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Leviathan Bond Ltd.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 30.06.2025 | $ | 100 | 94 | 0,37 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Israel Government International Bond** | | | | |
| 1,250 % fällig am 30.11.2022 | ILS | 2.700 | 772 | 3,01 |
| Summe Israel | | | 866 | 3,38 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Corsair International Ltd.** | | | | |
| 4,850 % fällig am 28.01.2027 | € | 100 | 99 | 0,38 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 23.05.2023 ^(g) | $ | 200 | 14 | 0,05 |
| **MAURITIUS** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Greenko Solar Mauritius Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 29.07.2026 | | 200 | 179 | 0,70 |
| **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 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 7,500 % fällig am 03.06.2027 | | 4.700 | 218 | 0,85 |
| 8,500 % fällig am 31.05.2029 | | 500 | 24 | 0,09 |
| | | | 242 | 0,94 |
| Summe Mexiko | | | 242 | 0,94 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Republic of Angola Via Avenir BV** | | | | |
| 6,609 % fällig am 07.12.2023 | $ | 15 | 15 | 0,06 |
| **PERU** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco de Credito del Peru S.A.** | | | | |
| 4,650 % fällig am 17.09.2024 | PEN | 1.230 | $ 300 | 1,17 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Fondo MIVIVIENDA S.A.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 14.02.2024 | | 130 | 34 | 0,13 |
| Summe Peru | | | 334 | 1,30 |
| **POLEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Poland Government International Bond** | | | | |
| 0,250 % fällig am 25.10.2026 | PLN | 300 | 50 | 0,20 |
| 2,750 % fällig am 25.10.2029 | | 200 | 34 | 0,13 |
| Summe Polen | | | 84 | 0,33 |
| **KATAR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Nakilat, Inc.** | | | | |
| 6,067 % fällig am 31.12.2033 | $ | 95 | 101 | 0,39 |
| **SERBIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Serbia Government International Bond** | | | | |
| 4,500 % fällig am 20.08.2032 | RSD | 5.900 | 43 | 0,17 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Development Bank of Southern Africa** | | | | |
| 8,600 % fällig am 21.10.2024 (h) | ZAR | 3.200 | 192 | 0,75 |
| **Eskom Holdings SOC Ltd.** | | | | |
| 7,850 % fällig am 02.04.2026 | | 5.000 | 288 | 1,12 |
| | | | 480 | 1,87 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 6,500 % fällig am 28.02.2041 | | 800 | 30 | 0,12 |
| 10,500 % fällig am 21.12.2026 | | 9.700 | 627 | 2,45 |
| | | | 657 | 2,57 |
| Summe Südafrika | | | 1.137 | 4,44 |
| **UGANDA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Republic of Uganda Government International Bond** | | | | |
| 14,250 % fällig am 23.08.2029 | UGX | 99.800 | 25 | 0,10 |
| 16,250 % fällig am 08.11.2035 | | 47.900 | 13 | 0,05 |
| Summe Uganda | | | 38 | 0,15 |
| **UKRAINE** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ukraine Government International Bond** | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.09.2023 | $ | 100 | 33 | 0,13 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Harbour Energy PLC** | | | | |
| 1,405 % fällig am 28.01.2054 | £ | 100 | 118 | 0,46 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.10.2037 | $ | 2 | 2 | 0,01 |
| 3,799 % fällig am 25.01.2035 | | 34 | 33 | 0,13 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,684 % fällig am 25.07.2045 | | 7 | 5 | 0,02 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 1,864 % fällig am 25.02.2037 | | 54 | 52 | 0,20 |
| 2,749 % fällig am 25.11.2035 | | 60 | 58 | 0,23 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | | |
| 1,684 % fällig am 25.11.2036 | | 2 | 1 | 0,00 |
| **Fieldstone Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 2,004 % fällig am 25.05.2036 | | 82 | 59 | 0,23 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **GSAMP Trust** | | | |
| 1,714 % fällig am 25.01.2037 | $ 49 | $ 31 | 0,12 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | |
| 2,224 % fällig am 25.11.2032 | 4 | 4 | 0,01 |
| **HSI Asset Loan Obligation Trust** | | | |
| 1,744 % fällig am 25.12.2036 | 2 | 1 | 0,00 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | |
| 1,684 % fällig am 25.05.2037 | 3 | 3 | 0,01 |
| 2,389 % fällig am 25.01.2035 | 23 | 22 | 0,09 |
| 2,419 % fällig am 25.03.2034 | 53 | 51 | 0,20 |
| **Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust** | | | |
| 2,974 % fällig am 25.02.2033 | 18 | 18 | 0,07 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | |
| 1,984 % fällig am 25.05.2036 | 9 | 9 | 0,03 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,764 % fällig am 25.03.2037 | 261 | 184 | 0,72 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | |
| 1,934 % fällig am 25.09.2037 | 13 | 13 | 0,05 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | |
| 1,704 % fällig am 25.06.2037 | 4 | 3 | 0,01 |
| 1,794 % fällig am 25.07.2037 | 63 | 56 | 0,22 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,844 % fällig am 25.10.2037 | 147 | 99 | 0,39 |
| **WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust** | | | |
| 1,864 % fällig am 25.05.2037 | 53 | 46 | 0,18 |
| **Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust** | | | |
| 1,684 % fällig am 25.10.2036 | 4 | 2 | 0,01 |
| | | 752 | 2,93 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **DAE Funding LLC** | | | |
| 1,550 % fällig am 01.08.2024 | 200 | 187 | 0,73 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | 242 | 252 | 0,98 |
| | | 439 | 1,71 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | |
| 3,538 % fällig am 25.07.2034 | 1 | 1 | 0,00 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 3,278 % fällig am 25.05.2047 ^ | 7 | 6 | 0,02 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | |
| 2,985 % fällig am 25.04.2037 | 197 | 155 | 0,61 |
| **Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust** | | | |
| 2,999 % fällig am 26.12.2046 ^ | 14 | 12 | 0,05 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,694 % fällig am 25.01.2037 | 2 | 2 | 0,01 |
| 3,396 % fällig am 25.09.2037 ^ | 91 | 83 | 0,33 |
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 3,213 % fällig am 25.08.2035 | 3 | 2 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,684 % fällig am 25.10.2033 | $ 1 | $ 1 | 0,00 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,867 % fällig am 25.01.2036 ^ | 1 | 1 | 0,00 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,264 % fällig am 25.07.2045 | 30 | 25 | 0,10 |
| 2,650 % fällig am 25.11.2037 | 76 | 64 | 0,25 |
| 3,016 % fällig am 25.12.2034 | 3 | 3 | 0,01 |
| **Lehman XS Trust** | | | |
| 2,004 % fällig am 25.09.2046 | 119 | 111 | 0,43 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | |
| 1,259 % fällig am 25.10.2037 | 51 | 47 | 0,18 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 | 4 | 4 | 0,02 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 3,145 % fällig am 25.02.2037 ^ | 7 | 7 | 0,03 |
| | | 524 | 2,05 |
| Summe USA | | 1.715 | 6,69 |
| **SAMBIA** | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Zambia Government International Bond** | | | |
| 12,000 % fällig am 22.03.2028 ZMW | 400 | 15 | 0,06 |
| 13,000 % fällig am 25.01.2031 | 3.500 | 118 | 0,46 |
| 15,000 % fällig am 16.02.2027 | 300 | 14 | 0,06 |
| Summe Sambia | | 147 | 0,58 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | |
| 51,049 % fällig am 30.09.2022 (c)(d) ARS | 200 | 1 | 0,00 |
| **ISRAEL TREASURY BILLS** | | | |
| (0,051) % fällig am 03.08.2022 (c)(d) ILS | 400 | 114 | 0,45 |
| 0,010 % fällig am 07.10.2022 (c)(d) | 3.600 | 1.025 | 4,00 |
| 0,455 % fällig am 08.02.2023 (c)(d) | 2.100 | 596 | 2,33 |
| 0,860 % fällig am 03.05.2023 (c)(d) | 1.600 | 452 | 1,76 |
| | | 2.187 | 8,54 |
| **JAPAN TREASURY BILLS** | | | |
| (0,150) % fällig am 20.09.2022 (c)(d) ¥ | 120.000 | 884 | 3,45 |
| (0,136) % fällig am 20.09.2022 (c)(d) | 50.000 | 368 | 1,44 |
| (0,109) % fällig am 11.07.2022 (c)(d) | 310.000 | 2.282 | 8,91 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| (0,098) % fällig am 11.07.2022 (c)(d) ¥ | 40.000 | $ 294 | 1,15 |
| | | 3.828 | 14,95 |
| **MALAYSIA TREASURY BILLS** | | | |
| 2,281 % fällig am 17.11.2022 (c)(d) MYR | 5.200 | 1.168 | 4,56 |
| 2,326 % fällig am 17.11.2022 (c)(d) | 5.700 | 1.280 | 4,99 |
| | | 2.448 | 9,55 |
| **SINGAPORE TREASURY BILLS** | | | |
| 1,161 % fällig am 08.07.2022 (c)(d) SGD | 3.900 | 2.802 | 10,93 |
| 1,312 % fällig am 22.07.2022 (c)(d) | 1.300 | 933 | 3,64 |
| | | 3.735 | 14,57 |
| **U.S. TREASURY BILLS** | | | |
| 0,611 % fällig am 19.07.2022 (c)(d) $ | 300 | 300 | 1,17 |
| 1,039 % fällig am 02.08.2022 (a)(c)(d) | 300 | 299 | 1,17 |
| 1,716 % fällig am 29.09.2022 (c)(d) | 300 | 299 | 1,17 |
| 2,103 % fällig am 25.10.2022 (c)(d) | 300 | 298 | 1,16 |
| | | 1.196 | 4,67 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 13.395 | 52,28 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | **$ 21.951** | **85,66** |
| | **AKTIEN** | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)** | 10.470 | 104 | 0,41 |
| **PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)** | 15.103 | 206 | 0,80 |
| | | 310 | 1,21 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)** | 22.600 | 2.236 | 8,72 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$ 2.546** | **9,93** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SSB | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 297 | U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026 | $ (303) | $ 297 | $ 297 | 1,16 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (303)** | **$ 297** | **$ 297** | **1,16** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month SOFR June Futures | Short | 09.2023 | 4 | $ 1 | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 1** | **0,00** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Boeing Co. | 1,000 % | 20.06.2023 | $ 100 | $ (1) | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Asia Ex-Japan 37 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2027 | $ 600 | $ (8) | (0,03) |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 % | 15.06.2032 | $ 500 | $ (15) | (0,06) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 4,100 | 02.01.2023 | BRL 4.500 | (62) | (0,24) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 5,100 | 02.01.2024 | 400 | 8 | 0,03 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 5,150 | 02.01.2023 | 8.000 | 112 | 0,43 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,250 | 02.01.2023 | 3.500 | (24) | (0,09) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,660 | 02.01.2025 | 3.300 | (91) | (0,36) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,863 | 02.01.2023 | 5.000 | (49) | (0,19) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,020 | 04.01.2027 | 1.500 | 52 | 0,20 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,050 | 02.01.2025 | 4.700 | 88 | 0,34 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 6,140 | 04.01.2027 | 7.300 | (204) | (0,80) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,250 | 04.01.2027 | 700 | 22 | 0,08 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,520 | 04.01.2027 | 10.200 | 296 | 1,15 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,950 | 04.01.2027 | 800 | 26 | 0,10 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 6,960 | 04.01.2027 | 6.500 | (149) | (0,58) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 7,195 | 02.01.2023 | 3.600 | 29 | 0,11 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 7,260 | 02.01.2023 | 1.400 | 11 | 0,04 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 7,310 | 02.01.2024 | 1.000 | (16) | (0,06) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 7,775 | 02.01.2024 | 1.700 | (24) | (0,09) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 7,800 | 04.01.2027 | 900 | (14) | (0,06) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 8,325 | 04.01.2027 | 300 | 7 | 0,03 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 8,355 | 04.01.2027 | 400 | (9) | (0,03) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 8,450 | 04.01.2027 | 300 | (6) | (0,03) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 8,675 | 04.01.2027 | 1.700 | 11 | 0,04 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 9,600 | 04.01.2027 | 2.700 | (13) | (0,05) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,206 | 04.01.2027 | 100 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 10,240 | 04.01.2027 | 500 | 4 | 0,02 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,665 | 02.01.2024 | 100 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,755 | 02.01.2024 | 300 | (2) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,833 | 02.01.2024 | 500 | (3) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,995 | 02.01.2024 | 100 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,995 | 04.01.2027 | 300 | (2) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,020 | 04.01.2027 | 200 | (1) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,045 | 04.01.2027 | 300 | (2) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,048 | 04.01.2027 | 400 | (3) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,050 | 04.01.2027 | 300 | (2) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,055 | 04.01.2027 | 300 | (2) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,065 | 02.01.2024 | 300 | (1) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,065 | 04.01.2027 | 300 | (2) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,130 | 04.01.2027 | 200 | (1) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,140 | 04.01.2027 | 300 | (2) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,148 | 02.01.2024 | 100 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 11,505 | 02.01.2024 | 500 | 2 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 11,530 | 02.01.2024 | 1.900 | 8 | 0,03 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 11,535 | 02.01.2024 | 600 | 2 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 11,540 | 02.01.2024 | 500 | 2 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 11,543 | 02.01.2024 | 500 | 2 | 0,01 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,105 | 02.01.2025 | 1.000 | (2) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,290 | 02.01.2024 | 600 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,425 | 02.01.2025 | 1.500 | (1) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 1,860 | 07.05.2025 | CNY 1.700 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 2,000 | 02.02.2023 | COP 9.125.800 | 100 | 0,39 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 2,148 | 25.09.2022 | 5.927.600 | 4 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 2,155 | 29.09.2022 | 806.700 | (3) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 2,630 | 24.07.2024 | 1.748.000 | 57 | 0,22 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 2,650 | 24.07.2024 | 2.178.000 | 71 | 0,28 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 2,740 | 24.07.2024 | 2.486.300 | (79) | (0,31) |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 2,750 | 24.07.2024 | 2.024.100 | (37) | (0,14) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 2,995 | 24.11.2025 | 113.800 | 5 | 0,02 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 3,080 | 13.01.2026 | 922.300 | (43) | (0,17) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 3,125 | 15.01.2026 | 386.000 | 18 | 0,07 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 3,145 % | 11.05.2023 | COP | 3.203.210 | $ (41) | (0,16) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 3,680 | 03.11.2027 | | 449.500 | 15 | 0,06 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 3,975 | 23.06.2027 | | 216.900 | 11 | 0,04 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,040 | 13.01.2031 | | 1.002.000 | 71 | 0,28 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,155 | 15.01.2031 | | 1.175.400 | 42 | 0,16 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,200 | 18.09.2030 | | 2.296.200 | (97) | (0,38) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,410 | 03.11.2027 | | 2.822.000 | 138 | 0,53 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,495 | 10.10.2024 | | 244.300 | (6) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,655 | 11.05.2026 | | 1.344.458 | 49 | 0,19 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,175 | 28.05.2027 | | 1.045.600 | 37 | 0,15 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 6,630 | 11.01.2027 | | 1.088.400 | 24 | 0,09 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 6,885 | 31.01.2025 | | 224.000 | 3 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,080 | 02.02.2027 | | 79.000 | 1 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,130 | 31.01.2027 | | 81.000 | 1 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,140 | 01.02.2027 | | 149.300 | 3 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,490 | 15.02.2023 | | 412.000 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,500 | 15.02.2025 | | 148.000 | 2 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,560 | 14.02.2024 | | 533.000 | 4 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,585 | 14.02.2027 | | 236.000 | (3) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,855 | 22.02.2025 | | 286.700 | 3 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,880 | 08.04.2029 | | 219.000 | 3 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,890 | 08.04.2027 | | 173.000 | 2 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,913 | 08.04.2027 | | 266.200 | 3 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,940 | 08.04.2027 | | 134.000 | 1 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,020 | 08.04.2025 | | 440.000 | 3 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,200 | 11.03.2027 | | 366.000 | (3) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,240 | 15.03.2027 | | 101.600 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,320 | 31.03.2027 | | 203.000 | (2) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,360 | 02.06.2027 | | 358.000 | (2) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,560 | 30.03.2027 | | 58.200 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,686 | 30.03.2027 | | 346.500 | (2) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,890 | 12.05.2029 | | 269.000 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 9,270 | 26.11.2025 | | 243.000 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 9,430 | 16.06.2027 | | 130.000 | 0 | 0,00 |
| Erhalt[5] | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 9,470 | 01.07.2025 | | 285.000 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,750 | 15.12.2026 | KRW | 1.453.400 | (83) | (0,33) |
| Erhalt | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,750 | 15.12.2031 | | 741.900 | 72 | 0,28 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 5,375 | 20.10.2026 | ZAR | 5.900 | 34 | 0,13 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 5,601 | 09.06.2026 | | 900 | (4) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 5,680 | 08.06.2026 | | 2.400 | (11) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 6,067 | 21.12.2026 | | 3.100 | 12 | 0,05 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 6,410 | 11.02.2023 | | 1.500 | 1 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,205 | 22.04.2027 | | 1.200 | 2 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,210 | 22.04.2027 | | 900 | 2 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 0,700 | 24.11.2022 | CLP | 53.800 | 1 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,290 | 05.11.2025 | | 123.100 | 24 | 0,09 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,582 | 02.02.2026 | | 40.000 | (8) | (0,03) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,640 | 12.01.2026 | | 293.300 | 60 | 0,23 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,935 | 10.03.2025 | | 288.700 | 47 | 0,18 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,950 | 05.05.2026 | | 318.600 | (60) | (0,24) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,020 | 30.04.2026 | | 335.000 | (63) | (0,24) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,080 | 01.06.2030 | | 62.000 | (19) | (0,08) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,110 | 01.06.2030 | | 20.000 | (6) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,270 | 15.03.2026 | | 682.000 | (127) | (0,49) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,545 | 05.02.2026 | | 88.000 | (14) | (0,05) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,565 | 27.11.2030 | | 35.000 | (9) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,585 | 27.11.2030 | | 35.000 | (9) | (0,03) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,640 | 01.03.2026 | | 326.000 | 54 | 0,21 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,680 | 12.01.2031 | | 325.000 | (91) | (0,36) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,000 | 14.06.2026 | | 436.000 | 65 | 0,25 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,120 | 05.02.2030 | | 29.000 | (6) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,215 | 14.01.2030 | | 143.000 | 32 | 0,12 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,245 | 15.03.2031 | | 142.400 | 34 | 0,13 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,520 | 14.06.2028 | | 13.800 | 2 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,900 | 14.06.2031 | | 224.000 | 44 | 0,17 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 4,695 | 01.03.2025 | | 200.000 | 17 | 0,07 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 4,870 | 15.11.2026 | | 53.000 | (4) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,045 | 14.12.2026 | | 23.300 | 2 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,100 | 15.11.2031 | | 10.000 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,110 | 14.12.2023 | | 165.200 | 8 | 0,03 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,120 | 15.11.2031 | | 10.000 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,130 | 01.03.2025 | | 80.000 | 5 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,170 | 14.12.2023 | | 68.900 | 3 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,180 | 01.10.2028 | | 35.000 | 3 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,240 | 01.09.2030 | | 60.000 | 5 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,260 | 01.03.2026 | | 60.000 | 4 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,370 | 01.10.2028 | | 17.900 | 1 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,400 | 01.10.2028 | | 35.000 | 2 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,420 | 01.10.2028 | | 76.000 | 5 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,470 | 01.09.2030 | | 50.000 | 3 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,570 | 01.10.2028 | | 70.000 | 4 | 0,02 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,610 | 08.02.2027 | | 62.000 | (3) | (0,01) |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,720 % | 28.01.2025 | CLP 26.000 | $ 0 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,725 | 07.02.2025 | 114.000 | 6 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,770 | 08.02.2025 | 196.000 | 10 | 0,04 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,785 | 06.01.2024 | 513.300 | (24) | (0,09) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,890 | 17.03.2032 | 12.100 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,910 | 21.01.2027 | 30.800 | (1) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,915 | 01.02.2025 | 92.800 | 4 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,930 | 17.03.2032 | 12.100 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,940 | 01.03.2025 | 50.000 | (2) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,975 | 11.02.2027 | 58.000 | (2) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,000 | 11.02.2027 | 114.000 | (4) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,010 | 16.02.2029 | 30.000 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,020 | 02.03.2029 | 2.900 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,030 | 10.02.2027 | 50.000 | (2) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,055 | 10.02.2027 | 28.000 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,110 | 01.09.2030 | 23.100 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,120 | 08.03.2027 | 18.700 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,130 | 16.02.2027 | 40.000 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,195 | 04.03.2027 | 58.600 | (2) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,195 | 04.04.2028 | 33.000 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,250 | 01.10.2028 | 4.600 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,255 | 08.04.2032 | 22.000 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,260 | 08.04.2032 | 21.000 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,270 | 02.03.2027 | 6.100 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,299 | 08.04.2032 | 24.000 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,300 | 11.03.2027 | 48.000 | 1 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,315 | 11.02.2025 | 92.000 | 3 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,333 | 05.04.2027 | 26.000 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,335 | 10.02.2025 | 50.000 | 2 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,350 | 10.02.2025 | 72.000 | 3 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,350 | 11.02.2025 | 179.000 | 6 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,350 | 15.03.2027 | 21.000 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,350 | 04.04.2027 | 27.000 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,360 | 25.05.2027 | 46.500 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,370 | 29.06.2029 | 39.000 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,380 | 03.06.2027 | 116.000 | (2) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,386 | 24.05.2027 | 103.000 | (2) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,420 | 24.03.2029 | 16.000 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,550 | 15.06.2032 | 16.000 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,590 | 16.06.2032 | 49.000 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,610 | 17.06.2032 | 40.300 | 1 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,625 | 04.04.2025 | 86.000 | 2 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,628 | 04.04.2025 | 126.000 | 3 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,670 | 05.04.2025 | 83.000 | 2 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,850 | 01.03.2026 | 80.000 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,040 | 10.05.2027 | 25.600 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,110 | 15.06.2027 | 28.000 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,160 | 16.06.2027 | 199.000 | (3) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,160 | 22.06.2027 | 22.500 | 0 | 0,00 |
| Zahlung[3] | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,214 | 21.09.2025 | 49.000 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,280 | 21.03.2025 | 217.000 | (2) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,540 | 13.06.2025 | 13.200 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,550 | 13.06.2025 | 13.300 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,690 | 10.05.2025 | 76.800 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 9,540 | 13.05.2023 | 113.000 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,575 | 26.03.2026 | CZK 700 | (4) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,872 | 05.08.2026 | 1.200 | (4) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 3,490 | 18.01.2032 | 4.100 | 20 | 0,08 |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 3,530 | 27.12.2026 | 1.100 | (2) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 3,930 | 18.01.2027 | 7.700 | (22) | (0,08) |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 4,164 | 14.03.2027 | 6.400 | 15 | 0,06 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 4,220 | 14.03.2027 | 6.300 | 14 | 0,05 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 4,310 | 15.03.2027 | 1.200 | 2 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 4,320 | 15.03.2027 | 400 | 1 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 4,490 | 25.03.2027 | 2.000 | 3 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 4,560 | 25.03.2027 | 2.000 | 3 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 4,700 | 29.03.2027 | 1.200 | 2 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 5,606 | 28.06.2027 | 1.300 | 0 | 0,00 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | € 400 | 41 | 0,16 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 0,980 | 09.06.2030 | PLN 300 | 23 | 0,09 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 2,950 | 13.12.2026 | 1.500 | 46 | 0,18 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 4,075 | 07.03.2027 | 800 | 19 | 0,07 |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 4,135 | 08.02.2027 | 500 | (11) | (0,04) |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 4,320 | 09.03.2027 | 150 | 3 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 4,350 | 09.03.2027 | 150 | 3 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 4,885 | 22.03.2027 | 200 | 3 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 5,175 | 24.03.2027 | 600 | 9 | 0,03 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 5,285 | 25.03.2027 | 300 | 4 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 5,290 | 25.03.2027 | 300 | 4 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 5,340 | 28.03.2027 | 100 | 1 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 5,470 | 08.04.2027 | 600 | 7 | 0,03 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 5,550 | 08.04.2027 | 400 | 4 | 0,02 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 5,575 % | 08.04.2027 | PLN 400 | $ 4 | 0,02 |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 5,980 | 13.04.2027 | 500 | (4) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 5,985 | 13.04.2027 | 500 | (4) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 6,010 | 13.04.2027 | 400 | (3) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 6,725 | 27.06.2027 | 700 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 6,755 | 10.05.2027 | 600 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 6,843 | 28.06.2027 | 300 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 6,940 | 09.06.2027 | 800 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 7,725 | 23.06.2027 | 600 | 5 | 0,02 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 4,145 | 13.02.2023 | MXN 49.000 | 81 | 0,31 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 4,290 | 16.02.2023 | 10.900 | (17) | (0,07) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 4,300 | 16.02.2023 | 16.700 | (27) | (0,10) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 4,340 | 12.02.2024 | 34.000 | (138) | (0,53) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 4,515 | 17.08.2022 | 23.900 | (6) | (0,02) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 4,530 | 15.11.2022 | 14.600 | (13) | (0,05) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 4,540 | 21.02.2024 | 3.300 | 13 | 0,05 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 4,680 | 16.03.2023 | 19.000 | (32) | (0,12) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 4,700 | 25.08.2022 | 33.700 | (9) | (0,04) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 4,730 | 06.02.2026 | 3.600 | (25) | (0,10) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 4,830 | 22.07.2025 | 1.400 | 8 | 0,03 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 4,840 | 19.02.2025 | 2.700 | 14 | 0,06 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 4,850 | 19.02.2025 | 3.700 | 20 | 0,08 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 4,880 | 07.11.2025 | 11.900 | (74) | (0,29) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 4,900 | 22.03.2023 | 8.300 | 13 | 0,05 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 4,920 | 10.04.2023 | 5.800 | 10 | 0,04 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 4,943 | 12.02.2026 | 2.300 | 15 | 0,06 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 4,950 | 12.02.2026 | 3.500 | 23 | 0,09 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 5,120 | 29.09.2025 | 8.200 | 21 | 0,08 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 5,282 | 29.03.2023 | 19.600 | 29 | 0,11 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 5,325 | 09.06.2023 | 14.300 | 28 | 0,11 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 5,520 | 21.03.2024 | 21.000 | 68 | 0,26 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,605 | 26.03.2024 | 500 | (2) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,650 | 22.03.2024 | 11.000 | (34) | (0,13) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,800 | 06.04.2026 | 5.000 | (26) | (0,10) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 5,893 | 05.06.2025 | 9.200 | 40 | 0,16 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,360 | 22.03.2023 | 12.300 | 27 | 0,11 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,380 | 19.08.2026 | 6.700 | (31) | (0,12) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,398 | 16.07.2026 | 4.100 | 18 | 0,07 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,415 | 16.07.2026 | 1.600 | 7 | 0,03 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,463 | 18.05.2040 | 800 | 9 | 0,04 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,670 | 19.06.2026 | 400 | 2 | 0,01 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,720 | 19.06.2026 | 300 | 1 | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,845 | 02.07.2026 | 900 | 3 | 0,01 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,070 | 27.08.2031 | 2.100 | 12 | 0,05 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,100 | 13.06.2031 | 3.900 | 24 | 0,09 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,110 | 28.11.2023 | 8.900 | (15) | (0,06) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,165 | 02.10.2026 | 700 | (2) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,180 | 02.10.2026 | 1.600 | (5) | (0,02) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,240 | 16.12.2026 | 2.800 | 9 | 0,04 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,250 | 05.10.2026 | 390 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,250 | 16.12.2026 | 3.300 | 11 | 0,04 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,270 | 23.11.2023 | 31.500 | (48) | (0,19) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,285 | 12.10.2026 | 600 | (2) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,418 | 27.10.2031 | 1.400 | (6) | (0,03) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,450 | 16.10.2026 | 300 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,510 | 04.02.2027 | 2.900 | 8 | 0,03 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,525 | 26.09.2031 | 1.100 | (5) | (0,02) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,533 | 07.01.2027 | 2.000 | (5) | (0,02) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,643 | 18.11.2031 | 2.300 | 9 | 0,04 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,650 | 29.09.2031 | 290 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,690 | 16.10.2031 | 1.500 | (6) | (0,02) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,784 | 13.11.2031 | 6.500 | 23 | 0,09 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,790 | 09.02.2024 | 12.800 | 17 | 0,07 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,800 | 13.11.2031 | 1.800 | 6 | 0,02 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,900 | 19.02.2032 | 1.200 | (4) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,950 | 20.02.2032 | 2.000 | (6) | (0,02) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,050 | 24.02.2032 | 1.800 | (5) | (0,02) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,431 | 24.05.2027 | 2.900 | 3 | 0,01 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,750 | 05.04.2024 | 3.100 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,975 | 03.06.2027 | 3.400 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 9,060 | 18.06.2027 | 1.400 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 9,070 | 04.06.2026 | 600 | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ 556 | 2,16 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 547** | **2,13** |

(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.

(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 | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYI | Call - OTC EUR versus CZK | CZK 26,330 | 10.05.2023 | 39 | $ 2 | $ 1 | 0,00 |
| | Put - OTC EUR versus CZK | 26,330 | 10.05.2023 | 39 | 1 | 2 | 0,01 |
| | Put - OTC EUR versus USD | $ 0,950 | 29.07.2022 | 451 | 1 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC GBP versus USD | 1,170 | 15.08.2022 | 471 | 5 | 3 | 0,01 |
| SOG | Call - OTC EUR versus CZK | CZK 26,000 | 08.05.2023 | 39 | 1 | 1 | 0,01 |
| | Put - OTC EUR versus CZK | 26,000 | 08.05.2023 | 39 | 1 | 1 | 0,00 |
| UAG | Call - OTC EUR versus CZK | 25,975 | 08.05.2023 | 39 | 1 | 1 | 0,01 |
| | Put - OTC EUR versus CZK | 25,975 | 08.05.2023 | 39 | 1 | 1 | 0,00 |
| | Call - OTC EUR versus CZK | 26,200 | 08.05.2023 | 39 | 2 | 1 | 0,00 |
| | Put - OTC EUR versus CZK | 26,200 | 08.05.2023 | 39 | 1 | 1 | 0,01 |
| | | | | | $ 16 | $ 12 | 0,05 |

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month JPY-LIBOR | Erhalt | 1,000 % | 26.04.2024 | 100.000 | $ 4 | $ 2 | 0,01 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/-verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | Call - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Kauf | 0,700 % | 17.08.2022 | 2.300 | $ (1) | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,300 | 17.08.2022 | 2.300 | (2) | (4) | (0,02) |
| | | | | | | $ (3) | $ (4) | (0,02) |

### DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYI | Put - OTC GBP versus USD | $ 1,100 | 15.08.2022 | 707 | $ (2) | $ (1) | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | QNB Finance Ltd. | 1,000 % | 20.06.2023 | $ 100 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |

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

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

## CROSS-CURRENCY SWAPS

| Kontrahent | Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,282 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 07.06.2027 | $ 60 | ARS 2.693 | $ 0 | $ 52 | $ 52 | 0,20 |
| | Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,333 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 30.05.2024 | 170 | 7.557 | (1) | 147 | 146 | 0,57 |
| | | | | | | $ (1) | $ 199 | $ 198 | 0,77 |

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,170 % | 25.01.2023 | COP 55.400 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,265 | 14.06.2029 | CLP 11.100 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | Erhalt | 6-Month THB-THBFIX | 1,000 | 15.12.2026 | THB 19.100 | 2 | 36 | 38 | 0,15 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,500 | 15.12.2031 | 9.800 | (4) | (29) | (33) | (0,13) |
| MYC | Erhalt | 6-Month THB-THBFIX | 1,000 | 15.12.2026 | 12.800 | 0 | 26 | 26 | 0,10 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,500 | 15.12.2031 | 6.600 | (2) | (21) | (23) | (0,08) |
| SCX | Erhalt | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,880 | 17.09.2024 | CNY 1.000 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | | | | | | $ (4) | $ 8 | $ 4 | 0,02 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | DKK | 275 | $ | 41 | $ 3 | $ 0 | $ 3 | 0,01 |
| | 07.2022 | £ | 313 | | 382 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 07.2022 | HUF | 47.564 | | 132 | 7 | 0 | 7 | 0,03 |
| | 07.2022 | MXN | 816 | | 40 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | SGD | 3.890 | | 2.849 | 54 | 0 | 54 | 0,21 |
| | 07.2022 | $ | 150 | CLP | 130.276 | 0 | (11) | (11) | (0,04) |
| | 07.2022 | | 49 | COP | 187.425 | 0 | (4) | (4) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 345 | DKK | 2.425 | 0 | (4) | (4) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 30 | PEN | 119 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 08.2022 | DKK | 2.420 | $ | 345 | 4 | 0 | 4 | 0,02 |
| | 08.2022 | MXN | 1.864 | | 85 | 0 | (6) | (6) | (0,02) |
| | 08.2022 | PEN | 253 | | 66 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 36 | PEN | 135 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | EGP | 679 | $ | 35 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10.2022 | $ | 28 | COP | 115.060 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 11.2022 | MYR | 10.776 | $ | 2.451 | 9 | 0 | 9 | 0,04 |
| | 11.2022 | ZAR | 1.249 | | 78 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 12.2022 | PEN | 350 | | 92 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01.2023 | CNH | 3.310 | | 513 | 19 | 0 | 19 | 0,07 |
| | 02.2023 | $ | 512 | CNH | 3.310 | 0 | (18) | (18) | (0,07) |
| | 04.2023 | PLN | 1.113 | € | 221 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| BPS | 07.2022 | CLP | 146.501 | $ | 169 | 13 | 0 | 13 | 0,05 |
| | 07.2022 | € | 890 | | 957 | 26 | 0 | 26 | 0,10 |
| | 07.2022 | £ | 82 | | 102 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 07.2022 | HUF | 48.669 | | 128 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 33.700 | | 251 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 07.2022 | MXN | 7.562 | | 376 | 1 | 0 | 1 | 0,01 |
| | 07.2022 | PLN | 1.914 | | 428 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 43 | CLP | 35.034 | 0 | (6) | (6) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 31 | DKK | 220 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.722 | € | 1.637 | 0 | (11) | (11) | (0,04) |
| | 07.2022 | | 29 | £ | 24 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 342 | MXN | 7.156 | 13 | 0 | 13 | 0,05 |
| | 08.2022 | CNH | 3.310 | $ | 497 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 08.2022 | COP | 267.409 | | 69 | 5 | 0 | 5 | 0,02 |
| | 08.2022 | € | 1.375 | | 1.448 | 9 | 0 | 9 | 0,03 |
| | 08.2022 | IDR | 1.838.240 | | 125 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 08.2022 | THB | 22 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 2.172 | | 74 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 105 | CLP | 91.334 | 0 | (8) | (8) | (0,03) |
| | 08.2022 | | 183 | IDR | 2.697.819 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 979 | INR | 76.331 | 0 | (17) | (17) | (0,07) |
| | 08.2022 | | 1.518 | MXN | 33.350 | 124 | 0 | 124 | 0,48 |
| | 08.2022 | ZAR | 3.701 | $ | 227 | 3 | (1) | 2 | 0,01 |
| | 09.2022 | CNH | 3.310 | | 500 | 6 | 0 | 6 | 0,02 |
| | 09.2022 | MYR | 2.116 | | 486 | 6 | 0 | 6 | 0,02 |
| | 09.2022 | TRY | 810 | | 44 | 0 | (1) | (1) | (0,01) |
| | 09.2022 | $ | 25 | CLP | 23.056 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 496 | CNH | 3.310 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 09.2022 | | 371 | MXN | 7.562 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 486 | TWD | 13.502 | 0 | (29) | (29) | (0,11) |
| | 10.2022 | CNH | 3.310 | $ | 499 | 5 | 0 | 5 | 0,02 |
| | 10.2022 | PEN | 1.440 | | 353 | 0 | (23) | (23) | (0,09) |
| | 10.2022 | $ | 499 | CNH | 3.310 | 0 | (5) | (5) | (0,02) |
| | 10.2022 | | 59 | COP | 228.954 | 0 | (5) | (5) | (0,02) |
| | 10.2022 | ZAR | 465 | $ | 30 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 11.2022 | CNH | 3.310 | | 506 | 12 | 0 | 12 | 0,05 |
| | 11.2022 | $ | 498 | CNH | 3.310 | 0 | (4) | (4) | (0,02) |
| | 11.2022 | ZAR | 458 | $ | 28 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 12.2022 | CNH | 3.310 | | 507 | 13 | 0 | 13 | 0,05 |
| | 12.2022 | TRY | 1.552 | | 120 | 41 | 0 | 41 | 0,16 |
| | 12.2022 | $ | 505 | CNH | 3.310 | 0 | (11) | (11) | (0,04) |
| | 12.2022 | | 700 | PEN | 2.942 | 63 | 0 | 63 | 0,25 |
| | 01.2023 | | 506 | CNH | 3.310 | 0 | (12) | (12) | (0,05) |
| | 02.2023 | ILS | 2.090 | $ | 621 | 15 | 0 | 15 | 0,06 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 05.2023 | € | 18 | CZK | 469 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | CZK | 412 | $ | 18 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | HUF | 10.795 | | 29 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 410.000 | | 3.366 | 348 | 0 | 348 | 1,35 |
| | 07.2022 | $ | 26 | BRL | 128 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 895 | MYR | 3.922 | 0 | (5) | (5) | (0,02) |
| | 08.2022 | TRY | 884 | $ | 52 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 201 | IDR | 2.968.212 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 283 | SGD | 391 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 10.2022 | | 156 | COP | 606.840 | 0 | (13) | (13) | (0,05) |
| | 11.2022 | ZAR | 546 | $ | 37 | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| BSS | 07.2022 | CLP | 9.426 | | 11 | 1 | 0 | 1 | 0,01 |
| CBK | 07.2022 | COP | 112.966 | | 30 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 07.2022 | € | 66 | | 71 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 07.2022 | MXN | 961 | | 47 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 33 | CLP | 27.970 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 80 | VND | 1.844.650 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | VND | 1.844.650 | $ | 79 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | ILS | 400 | | 128 | 13 | 0 | 13 | 0,05 |
| | 08.2022 | KRW | 36.099 | | 28 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | MXN | 168 | | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN | 1.867 | | 490 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 768 | | 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 485 | PEN | 1.821 | 0 | (8) | (8) | (0,03) |
| | 08.2022 | | 97 | RUB | 8.309 | 48 | 0 | 48 | 0,19 |
| | 08.2022 | ZAR | 785 | $ | 50 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 09.2022 | COP | 345.283 | | 89 | 7 | 0 | 7 | 0,03 |
| | 09.2022 | $ | 91 | MXN | 1.874 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 10.2022 | COP | 566.800 | $ | 135 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 10.2022 | ILS | 3.600 | | 1.060 | 26 | 0 | 26 | 0,10 |
| | 10.2022 | MXN | 850 | | 40 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 10.2022 | $ | 15 | COP | 58.380 | 0 | (1) | (1) | (0,01) |
| | 11.2022 | PEN | 130 | $ | 33 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 11.2022 | $ | 5 | PEN | 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11.2022 | | 51 | PKR | 11.603 | 5 | 0 | 5 | 0,02 |
| | 11.2022 | | 81 | VND | 1.909.575 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 12.2022 | PEN | 7.056 | $ | 1.682 | 0 | (149) | (149) | (0,58) |
| | 12.2022 | $ | 829 | PEN | 3.422 | 58 | 0 | 58 | 0,23 |
| | 12.2022 | | 79 | VND | 1.873.880 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 12.2022 | VND | 23.700 | $ | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03.2023 | $ | 61 | PEN | 236 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 05.2023 | ILS | 1.586 | $ | 469 | 6 | 0 | 6 | 0,02 |
| | 05.2023 | PEN | 221 | | 56 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | DKK | 572 | | 84 | 4 | 0 | 4 | 0,02 |
| | 07.2022 | MXN | 1.250 | | 63 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 1.456 | PLN | 6.351 | 0 | (45) | (45) | (0,18) |
| | 07.2022 | | 502 | RON | 2.353 | 0 | (6) | (6) | (0,02) |
| | 08.2022 | | 402 | THB | 13.945 | 0 | (7) | (7) | (0,03) |
| | 08.2022 | | 46 | TWD | 1.380 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 02.2023 | ZAR | 798 | $ | 48 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | BRL | 5.120 | | 988 | 9 | 0 | 9 | 0,03 |
| | 07.2022 | CLP | 118.858 | | 138 | 11 | 0 | 11 | 0,04 |
| | 07.2022 | MXN | 13.640 | | 668 | 0 | (7) | (7) | (0,03) |
| | 07.2022 | PLN | 136 | | 31 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | RSD | 5.968 | | 55 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 07.2022 | SGD | 1.296 | | 943 | 12 | 0 | 12 | 0,05 |
| | 07.2022 | $ | 1.204 | BRL | 6.068 | 0 | (44) | (44) | (0,17) |
| | 07.2022 | | 110 | CLP | 90.414 | 0 | (14) | (14) | (0,05) |
| | 07.2022 | | 5 | DOP | 279 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 490 | MYR | 2.143 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 135 | PEN | 500 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 41 | PLN | 183 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | COP | 4.331.747 | $ | 1.073 | 41 | 0 | 41 | 0,16 |
| | 08.2022 | DOP | 11.879 | | 206 | 0 | (9) | (9) | (0,04) |
| | 08.2022 | RUB | 12.896 | | 136 | 0 | (89) | (89) | (0,35) |
| | 08.2022 | $ | 980 | BRL | 5.120 | 0 | (9) | (9) | (0,04) |
| | 08.2022 | | 406 | CNH | 2.699 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 44 | PEN | 167 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | EGP | 962 | $ | 49 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 11 | HKD | 86 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10.2022 | COP | 113.935 | $ | 28 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 10.2022 | $ | 748 | MXN | 15.304 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 10.2022 | ZAR | 1.683 | $ | 107 | 5 | 0 | 5 | 0,02 |
| | 11.2022 | $ | 237 | DOP | 13.379 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 12.2022 | | 322 | PEN | 1.351 | 29 | 0 | 29 | 0,11 |
| | 05.2023 | ZAR | 1.402 | $ | 84 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| IND | 07.2022 | ¥ 310.000 | 2.536 | $ 255 | $ 0 | 255 | 0,99 |
| | 08.2022 | TWD 6.210 | 211 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ 200 | CLP 175.203 | 0 | (15) | (15) | (0,06) |
| | 08.2022 | 69 | ZAR 1.074 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 06.2024 | 82 | TWD 2.110 | 0 | (7) | (7) | (0,03) |
| JPM | 07.2022 | BRL 174 | $ 36 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 07.2022 | EGP 1.335 | 69 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN 952 | 47 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 47 | CLP 40.332 | 0 | (4) | (4) | (0,02) |
| | 07.2022 | 1.051 | CZK 24.645 | 0 | (11) | (11) | (0,04) |
| | 08.2022 | CNH 465 | $ 69 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR 5.736.642 | 388 | 4 | 0 | 4 | 0,02 |
| | 08.2022 | TRY 873 | 51 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 1.298 | KRW 1.652.655 | 0 | (24) | (24) | (0,09) |
| | 08.2022 | 4 | PHP 201 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 2.285 | SGD 3.141 | 0 | (28) | (28) | (0,11) |
| | 08.2022 | 546 | TWD 16.078 | 0 | (4) | (4) | (0,02) |
| | 08.2022 | 44 | ZAR 669 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 08.2022 | ZMW 2.641 | $ 108 | 0 | (48) | (48) | (0,19) |
| | 09.2022 | $ 575 | TWD 15.989 | 0 | (34) | (34) | (0,13) |
| | 11.2022 | 19 | PKR 4.199 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 12.2022 | 66 | TRY 1.175 | 0 | (6) | (6) | (0,02) |
| | 06.2023 | 29 | VND 696.000 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | CLP 4.716 | $ 6 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | € 6 | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 200 | CLP 170.139 | 0 | (19) | (19) | (0,07) |
| | 07.2022 | 252 | ¥ 33.500 | 0 | (6) | (6) | (0,02) |
| | 07.2022 | 58 | MXN 1.199 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH 1.058 | $ 158 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR 592.653 | 40 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | INR 29.482 | $ 377 | 5 | 0 | $ 5 | 0,02 |
| | 08.2022 | PEN 70 | 18 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 536 | CLP 449.552 | 0 | (60) | (60) | (0,23) |
| | 08.2022 | 190 | € 180 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 08.2022 | 54 | RUB 4.587 | 26 | 0 | 26 | 0,10 |
| | 09.2022 | MYR 1.774 | $ 407 | 5 | 0 | 5 | 0,02 |
| | 10.2022 | COP 680.152 | 163 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 05.2023 | $ 74 | CNH 499 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | BRL 902 | $ 185 | 12 | 0 | 12 | 0,05 |
| | 07.2022 | CLP 85.894 | 101 | 9 | 0 | 9 | 0,04 |
| | 07.2022 | COP 74.459 | 19 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK 2.508 | 372 | 19 | 0 | 19 | 0,08 |
| | 07.2022 | $ 16 | CLP 14.142 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | 72 | DKK 509 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | 2.926 | ¥ 370.052 | 0 | (202) | (202) | (0,78) |
| | 08.2022 | DKK 508 | $ 72 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | THB 987 | 28 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | TRY 1.443 | 87 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ 873 | CNY 5.863 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | 18 | COP 74.459 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | 226 | IDR 3.339.110 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 08.2022 | 1.641 | INR 128.201 | 0 | (24) | (24) | (0,09) |
| | 08.2022 | 1.679 | KRW 2.139.035 | 0 | (30) | (30) | (0,12) |
| | 08.2022 | 987 | THB 34.019 | 0 | (24) | (24) | (0,09) |
| | 08.2022 | 162 | TWD 4.781 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | 125 | ZAR 2.003 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 08.2022 | ZAR 1.532 | $ 98 | 4 | 0 | 4 | 0,02 |
| | 09.2022 | MYR 524 | 119 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | TRY 1.641 | 89 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 09.2022 | $ 234 | TWD 6.526 | 0 | (13) | (13) | (0,05) |
| | 10.2022 | COP 130.596 | $ 31 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10.2022 | $ 2 | COP 7.746 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11.2022 | ILS 2.700 | $ 840 | 61 | 0 | 61 | 0,24 |
| | 12.2022 | TRY 1.706 | 135 | 48 | 0 | 48 | 0,19 |
| | 05.2023 | CZK 185 | € 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RBC | 08.2022 | KRW 413.268 | $ 327 | 8 | 0 | 8 | 0,03 |
| | 08.2022 | $ 28 | BRL 148 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 51 | PEN 190 | 0 | (1) | (1) | (0,01) |
| | 10.2022 | MXN 2.040 | $ 102 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 10.2022 | $ 443 | MXN 8.864 | 0 | (11) | (11) | (0,04) |
| RYL | 08.2022 | IDR 687.141 | $ 47 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | NOK 415 | 42 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | $ 381 | ILS 1.286 | 0 | (14) | (14) | (0,06) |
| | 08.2022 | CNH 1.877 | $ 280 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | PHP 3.480 | 66 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ 91 | CNH 611 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 1.402 | CNY 9.385 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 08.2022 | 999 | IDR 14.577.690 | 0 | (25) | (25) | (0,10) |
| | 08.2022 | 298 | NOK 2.955 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 08.2022 | 68 | ZAR 1.028 | 0 | (6) | (6) | (0,02) |
| | 09.2022 | MYR 2.353 | $ 538 | 5 | 0 | 5 | 0,02 |
| | 09.2022 | $ 199 | COP 801.368 | 0 | (9) | (9) | (0,04) |
| | 09.2022 | 1.483 | MYR 6.243 | 0 | (67) | (67) | (0,26) |
| | 10.2022 | 64 | ZAR 961 | 0 | (6) | (6) | (0,03) |
| | 11.2022 | COP 1.894.800 | $ 446 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 11.2022 | $ 25 | PKR 5.457 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 04.2023 | KES 1.600 | $ 12 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | CLP 57.234 | 66 | 5 | 0 | 5 | 0,02 |
| | 07.2022 | € 671 | 721 | 20 | 0 | 20 | 0,08 |
| | 07.2022 | $ 28 | DKK 200 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 03.2023 | KES | 1.166 | $ | 9 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| | 05.2023 | CZK | 312 | € | 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 08.2022 | TWD | 979 | $ | 33 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | € | 50 | | 53 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | ¥ | 170.000 | | 1.273 | 15 | 0 | 15 | 0,06 |
| UAG | 07.2022 | CLP | 24.505 | | 29 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 18 | CLP | 14.142 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 14 | CZK | 338 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 867 | HUF | 304.082 | 0 | (68) | (68) | (0,27) |
| | 07.2022 | | 41 | ZAR | 652 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | CLP | 270.221 | $ | 309 | 23 | 0 | 23 | 0,09 |
| | 08.2022 | KRW | 63.640 | | 50 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | TRY | 1.816 | | 111 | 5 | 0 | 5 | 0,02 |
| | 08.2022 | TWD | 944 | | 32 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 30 | PEN | 115 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 602 | PHP | 31.599 | 0 | (29) | (29) | (0,11) |
| | 08.2022 | ZAR | 452 | $ | 29 | 1 | 0 | 1 | 0,01 |
| | 09.2022 | CLP | 551 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | MXN | 7.190 | | 361 | 9 | 0 | 9 | 0,03 |
| | 09.2022 | TRY | 1.987 | | 113 | 3 | (2) | 1 | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 4 | HKD | 31 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 993 | TRY | 17.600 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 10.2022 | | 622 | MXN | 12.722 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 10.2022 | | 79 | ZAR | 1.181 | 0 | (8) | (8) | (0,03) |
| | 11.2022 | ZAR | 1.545 | $ | 95 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 12.2022 | $ | 130 | TRY | 2.083 | 0 | (24) | (24) | (0,09) |
| | 02.2023 | CNH | 3.310 | $ | 515 | 21 | 0 | 21 | 0,08 |
| | 05.2023 | € | 1 | CZK | 29 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 1.725 | $ (1.483) | $ 242 | 0,94 |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **$ 454** | **1,77** |
| **Summe Anlagen** | | | | | | | | **$ 25.796** | **100,65** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | | | | | | | **$ (167)** | **(0,65)** |
| **Nettovermögen** | | | | | | | | **$ 25.629** | **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 | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Development Bank of Southern Africa | 8,600 % | 21.10.2024 | 07.10.2021 | $ 215 | $ 192 | 0,75 |
| Flourish Century | 6,600 | 04.02.2049 | 25.08.2021 | 197 | 22 | 0,09 |
| | | | | $ 412 | $ 214 | 0,84 |

Barmittel in Höhe von USD 320 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 260 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 21.578 | $ 373 | $ 21.951 |
| Investmentfonds | 310 | 2.236 | 0 | 2.546 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 297 | 0 | 297 |
| Finanzderivate[3] | 0 | 1.002 | 0 | 1.002 |
| **Summen** | **$ 310** | **$ 25.113** | **$ 373** | **$ 25.796** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 25.257 | $ 318 | $ 25.575 |
| Investmentfonds | 2.833 | 0 | 0 | 2.833 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 193 | 0 | 193 |
| Finanzderivate[3] | 0 | 520 | 0 | 520 |
| **Summen** | **$ 2.833** | **$ 25.970** | **$ 318** | **$ 29.121** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 56 | $ 0 | $ 56 |
| BPS | 233 | (280) | (47) |
| BRC | 331 | (270) | 61 |
| BSS | 1 | 0 | 1 |
| CBK | 13 | 0 | 13 |
| DUB | (52) | 0 | (52) |
| GLM | 128 | (10) | 118 |
| GST | (4) | 0 | (4) |
| IND | 232 | 0 | 232 |
| JPM | (153) | 260 | 107 |
| MBC | (45) | 0 | (45) |
| MYC | 3 | 0 | 3 |
| MYI | (142) | 0 | (142) |
| RBC | (2) | 0 | (2) |
| RYL | 1 | 0 | 1 |
| SCX | (121) | 0 | (121) |
| SOG | 26 | 0 | 26 |
| TOR | 15 | 0 | 15 |
| UAG | (66) | 0 | (66) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 34,12 | 58,69 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 50,04 | 25,70 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 1,50 | 1,54 |
| Investmentfonds | 9,93 | 9,52 |
| Pensionsgeschäfte | 1,16 | 0,65 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,00 | k. A. |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 2,13 | 0,39 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 1,77 | 1,36 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Argentinien | 0,17 | 0,21 |
| Aserbaidschan | 0,73 | k. A. |
| Brasilien | 2,35 | 2,69 |
| Cayman-Inseln | 0,20 | 2,19 |
| Chile | 0,02 | 3,05 |
| China | 0,09 | k. A. |
| Kolumbien | 6,42 | 4,90 |
| Dänemark | 1,63 | 1,86 |
| Ägypten | k. A. | 0,67 |
| Frankreich | k. A. | 0,11 |
| Ungarn | 0,35 | 0,38 |
| Indien | k. A. | 1,35 |
| Irland | 1,27 | 2,62 |
| Israel | 3,38 | 11,76 |
| Italien | k. A. | 0,38 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,38 | k. A. |
| Luxemburg | 0,05 | 0,70 |
| Malaysia | k. A. | 0,65 |
| Mauritius | 0,70 | 0,72 |
| Mexiko | 0,94 | 0,86 |
| Niederlande | 0,06 | 0,07 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Nigeria | k. A. | 0,17 |
| Peru | 1,30 | 1,30 |
| Polen | 0,33 | k. A. |
| Katar | 0,39 | 0,39 |
| Serbien | 0,17 | 0,20 |
| Singapur | k. A. | 0,68 |
| Südafrika | 4,44 | 4,85 |
| Spanien | k. A. | 0,78 |
| Uganda | 0,15 | k. A. |
| Ukraine | 0,13 | 0,79 |
| Großbritannien | 0,46 | k. A. |
| USA | 6,69 | 6,37 |
| Sambia | 0,58 | 0,92 |
| Kurzfristige Instrumente | 52,28 | 34,31 |
| Investmentfonds | 9,93 | 9,52 |
| Pensionsgeschäfte | 1,16 | 0,65 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,00 | k. A. |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,00 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,03) | 0,01 |
| Zinsswaps | 2,16 | 0,38 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Devisenoptionen | 0,05 | 0,08 |
| Zinsswapoptionen | 0,01 | k. A. |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,02) | k. A. |
| Devisenoptionen | 0,00 | (0,01) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,00 | (0,01) |
| Cross-Currency Swaps | 0,77 | 0,62 |
| Zinsswaps | 0,02 | (0,01) |
| Volatilitätsswaps | k. A. | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | 0,94 | 0,69 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (0,65) | 2,15 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **Acef Holding S.C.A.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 14.06.2028 | € | 100 | $ 84 | 0,06 |
| 1,250 % fällig am 26.04.2030 | | 300 | 236 | 0,16 |
| **AIB Group PLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 30.05.2031 | | 400 | 380 | 0,25 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.11.2031 | $ | 250 | 278 | 0,18 |
| **American Express Co.** | | | | |
| 4,050 % fällig am 03.05.2029 | | 500 | 491 | 0,33 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 3,100 % fällig am 15.06.2050 | | 200 | 139 | 0,09 |
| 3,800 % fällig am 15.08.2029 | | 150 | 138 | 0,09 |
| **Asian Development Bank** | | | | |
| 6,550 % fällig am 26.01.2025 | ZAR | 42.000 | 2.490 | 1,65 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (e)(f) | € | 400 | 403 | 0,27 |
| **Banco BTG Pactual S.A.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 11.01.2026 | $ | 600 | 534 | 0,35 |
| **Banco de Sabadell S.A.** | | | | |
| 0,875 % fällig am 16.06.2028 | € | 100 | 86 | 0,06 |
| **Banco do Brasil S.A.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 11.01.2029 | $ | 400 | 367 | 0,24 |
| **Banco Mercantil del Norte S.A.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 24.01.2032 (e)(f) | | 200 | 164 | 0,11 |
| **BanColombia S.A.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 29.01.2025 | | 400 | 369 | 0,24 |
| **Bank Mandiri Persero Tbk PT** | | | | |
| 2,000 % fällig am 19.04.2026 | | 200 | 181 | 0,12 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 2,687 % fällig am 22.04.2032 | | 200 | 168 | 0,11 |
| **Banque Ouest Africaine de Developpement** | | | | |
| 2,750 % fällig am 22.01.2033 | € | 470 | 395 | 0,26 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 4,836 % fällig am 09.05.2028 | $ | 400 | 385 | 0,25 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (e)(f) | £ | 200 | 239 | 0,16 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (e)(f) | $ | 200 | 197 | 0,13 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 2,871 % fällig am 19.04.2032 | | 200 | 165 | 0,11 |
| 4,625 % fällig am 25.02.2031 (e)(f) | | 200 | 148 | 0,10 |
| **Boston Properties LP** | | | | |
| 2,550 % fällig am 01.04.2032 | | 400 | 319 | 0,21 |
| **Broadstone Net Lease LLC** | | | | |
| 2,600 % fällig am 15.09.2031 | | 200 | 163 | 0,11 |
| **Brookfield Finance UK PLC** | | | | |
| 2,340 % fällig am 30.01.2032 | | 550 | 443 | 0,29 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 14.09.2028 (e)(f) | € | 200 | 145 | 0,10 |
| **Castellum Helsinki Finance Holding Abp** | | | | |
| 0,875 % fällig am 17.09.2029 | | 300 | 214 | 0,14 |
| **CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund** | | | | |
| 0,900 % fällig am 12.10.2029 | | 500 | 414 | 0,27 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 2,976 % fällig am 05.11.2030 | $ | 200 | 175 | 0,12 |
| **Citycon Treasury BV** | | | | |
| 1,625 % fällig am 12.03.2028 | € | 300 | 231 | 0,15 |
| **Corporate Office Properties LP** | | | | |
| 2,000 % fällig am 15.01.2029 | $ | 100 | 81 | 0,05 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 14.01.2030 | € | 300 | 222 | 0,15 |
| 2,750 % fällig am 22.01.2028 | £ | 300 | 282 | 0,19 |
| **Credit Agricole Assurances S.A.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 06.10.2031 | € | 200 | 158 | 0,10 |
| **Crown Castle International Corp.** | | | | |
| 3,100 % fällig am 15.11.2029 | $ | 550 | 486 | 0,32 |
| **CTP NV** | | | | |
| 1,250 % fällig am 21.06.2029 | € | 400 | 292 | 0,19 |
| 1,500 % fällig am 27.09.2031 | | 400 | 254 | 0,17 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 3,035 % fällig am 28.05.2032 (g) | $ | 350 | 277 | 0,18 |
| 3,742 % fällig am 07.01.2033 | | 500 | 364 | 0,24 |
| **EQT AB** | | | | |
| 0,875 % fällig am 14.05.2031 | € | 100 | $ 76 | 0,05 |
| **Equinix, Inc.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.05.2031 | $ | 50 | 41 | 0,03 |
| 3,900 % fällig am 15.04.2032 | | 260 | 235 | 0,16 |
| **First American Financial Corp.** | | | | |
| 2,400 % fällig am 15.08.2031 | | 600 | 463 | 0,31 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 4,687 % fällig am 09.06.2025 | | 200 | 189 | 0,13 |
| 5,584 % fällig am 18.03.2024 | | 200 | 199 | 0,13 |
| **FS KKR Capital Corp.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 12.10.2028 | | 450 | 359 | 0,24 |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 29.07.2026 | € | 400 | 337 | 0,22 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 2,383 % fällig am 21.07.2032 | $ | 800 | 648 | 0,43 |
| **Goodman U.S. Finance Five LLC** | | | | |
| 4,625 % fällig am 04.05.2032 | | 700 | 688 | 0,46 |
| **GPT Wholesale Office Fund** | | | | |
| 3,222 % fällig am 05.11.2031 | AUD | 400 | 222 | 0,15 |
| **Grainger PLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 03.07.2030 | £ | 100 | 102 | 0,07 |
| **Growthpoint Properties International Pty. Ltd.** | | | | |
| 5,872 % fällig am 02.05.2023 | $ | 200 | 200 | 0,13 |
| **Hanwha Life Insurance Co. Ltd.** | | | | |
| 3,379 % fällig am 04.02.2032 | | 300 | 274 | 0,18 |
| **HAT Holdings LLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.06.2026 | | 610 | 526 | 0,35 |
| 3,750 % fällig am 15.09.2030 | | 230 | 184 | 0,12 |
| **Host Hotels & Resorts LP** | | | | |
| 2,900 % fällig am 15.12.2031 | | 100 | 79 | 0,05 |
| 3,375 % fällig am 15.12.2029 | | 800 | 678 | 0,45 |
| 3,500 % fällig am 15.09.2030 | | 240 | 205 | 0,14 |
| **Howard Hughes Corp.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 01.02.2031 | | 700 | 519 | 0,34 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 3,973 % fällig am 22.05.2030 | | 200 | 184 | 0,12 |
| 5,250 % fällig am 16.09.2022 (e)(f) | € | 600 | 620 | 0,41 |
| **Hudson Pacific Properties LP** | | | | |
| 3,950 % fällig am 01.11.2027 | $ | 250 | 238 | 0,16 |
| **Indian Railway Finance Corp. Ltd.** | | | | |
| 3,570 % fällig am 21.01.2032 | | 950 | 815 | 0,54 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 4,250 % fällig am 16.05.2031 (e)(f) | | 200 | 137 | 0,09 |
| 4,875 % fällig am 16.05.2029 (e)(f) | | 700 | 574 | 0,38 |
| **Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung** | | | | |
| 3,000 % fällig am 27.09.2023 | | 10.950 | 10.949 | 7,24 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 4,198 % fällig am 01.06.2032 | | 200 | 147 | 0,10 |
| 5,017 % fällig am 26.06.2024 | | 200 | 191 | 0,13 |
| 6,250 % fällig am 16.05.2024 (e)(f) | € | 200 | 199 | 0,13 |
| **Kilroy Realty LP** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.11.2032 | $ | 640 | 500 | 0,33 |
| 2,650 % fällig am 15.11.2033 | | 200 | 155 | 0,10 |
| **Kookmin Bank** | | | | |
| 2,500 % fällig am 04.11.2030 (f) | | 200 | 169 | 0,11 |
| **Lendlease Finance Ltd.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 27.10.2027 | AUD | 700 | 430 | 0,28 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 2,000 % fällig am 17.01.2034 | € | 500 | 369 | 0,24 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | |
| 2,201 % fällig am 10.07.2031 | $ | 200 | 162 | 0,11 |
| **MPT Operating Partnership LP** | | | | |
| 3,375 % fällig am 24.04.2030 | £ | 200 | 195 | 0,13 |
| **Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen** | | | | |
| 5,875 % fällig am 23.05.2042 | $ | 400 | 403 | 0,27 |
| **Nationstar Mortgage Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.11.2031 | | 300 | 230 | 0,15 |
| **NE Property BV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 20.01.2030 | € | 200 | 149 | 0,10 |
| 3,375 % fällig am 14.07.2027 | | 300 | 270 | 0,18 |
| **New Immo Holding S.A.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 26.11.2026 | | 200 | 183 | 0,12 |
| **Nexi SpA** | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.04.2026 | | 650 | 555 | 0,37 |
| **Nomura Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,172 % fällig am 14.07.2028 | $ | 200 | $ 169 | 0,11 |
| **OneMain Finance Corp.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.01.2027 | | 826 | 662 | 0,44 |
| **Owl Rock Capital Corp.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 11.06.2028 | | 200 | 157 | 0,10 |
| **PennyMac Financial Services, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.09.2031 | | 200 | 150 | 0,10 |
| **Rexford Industrial Realty LP** | | | | |
| 2,150 % fällig am 01.09.2031 | | 100 | 79 | 0,05 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 3,823 % fällig am 03.11.2028 | | 200 | 186 | 0,12 |
| **Segro Capital SARL** | | | | |
| 1,875 % fällig am 23.03.2030 | € | 250 | 229 | 0,15 |
| **Sirius Real Estate Ltd.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 22.06.2026 | | 400 | 362 | 0,24 |
| 1,750 % fällig am 24.11.2028 | | 200 | 162 | 0,11 |
| **SLM Corp.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 02.11.2026 | $ | 900 | 728 | 0,48 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 26.05.2026 (e)(f) | | 200 | 163 | 0,11 |
| **Sofina S.A.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 23.09.2028 | € | 200 | 165 | 0,11 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 2,678 % fällig am 29.06.2032 | $ | 500 | 402 | 0,27 |
| 3,603 % fällig am 12.01.2033 (g) | | 200 | 164 | 0,11 |
| 7,750 % fällig am 02.04.2023 (e)(f) | | 400 | 396 | 0,26 |
| **Starwood Property Trust, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.07.2026 | | 680 | 577 | 0,38 |
| 4,375 % fällig am 15.01.2027 | | 310 | 270 | 0,18 |
| **SVB Financial Group** | | | | |
| 4,570 % fällig am 29.04.2033 | | 370 | 348 | 0,23 |
| **Svenska Handelsbanken AB** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.03.2031 (e)(f) | | 200 | 164 | 0,11 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 4,375 % fällig am 10.02.2031 (e)(f) | | 200 | 147 | 0,10 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 5,459 % fällig am 30.06.2035 | | 300 | 243 | 0,16 |
| **VIA Outlets BV** | | | | |
| 1,750 % fällig am 15.11.2028 | € | 500 | 437 | 0,29 |
| **VICI Properties LP** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.02.2025 | $ | 500 | 468 | 0,31 |
| **Vonovia SE** | | | | |
| 2,375 % fällig am 25.03.2032 | € | 200 | 172 | 0,11 |
| **Weyerhaeuser Co.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 15.03.2032 | $ | 85 | 98 | 0,06 |
| **Workspace Group PLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 11.03.2028 | £ | 200 | 200 | 0,13 |
| **ZF Finance GmbH** | | | | |
| 2,000 % fällig am 06.05.2027 | € | 400 | 324 | 0,21 |
| 2,250 % fällig am 03.05.2028 | | 100 | 77 | 0,05 |
| | | | 44.304 | 29,31 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 31.07.2043 | £ | 500 | 604 | 0,40 |
| **Accor S.A.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 29.11.2028 | € | 900 | 750 | 0,50 |
| **Allegion U.S. Holding Co., Inc.** | | | | |
| 3,550 % fällig am 01.10.2027 | $ | 200 | 184 | 0,12 |
| **Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.09.2029 | € | 600 | 469 | 0,31 |
| **Ball Corp.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.09.2031 | $ | 580 | 469 | 0,31 |
| **BCP Modular Services Finance PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.11.2028 | € | 100 | 83 | 0,05 |
| **Berkeley Group PLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 11.08.2031 | £ | 650 | 583 | 0,39 |
| **Boise Cascade Co.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.07.2030 | $ | 380 | 333 | 0,22 |
| **CDW LLC** | | | | |
| 3,569 % fällig am 01.12.2031 | | 500 | 414 | 0,27 |
| **Cellnex Finance Co. S.A.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 07.07.2041 | | 200 | 138 | 0,09 |
| **DaVita, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.02.2031 | | 400 | 288 | 0,19 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Fair Isaac Corp.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.06.2028 | $ | 610 | $ 541 | 0,36 |
| **Faurecia SE** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.02.2027 | € | 500 | 409 | 0,27 |
| **Ford Motor Co.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.02.2032 | $ | 80 | 60 | 0,04 |
| **Fortune Brands Home & Security, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.09.2029 | | 150 | 130 | 0,09 |
| **Gap, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.10.2029 | | 200 | 141 | 0,09 |
| 3,875 % fällig am 01.10.2031 | | 300 | 210 | 0,14 |
| **GN Store Nord A/S** | | | | |
| 0,875 % fällig am 25.11.2024 | € | 400 | 396 | 0,26 |
| **Graphic Packaging International LLC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 01.02.2029 | | 400 | 342 | 0,23 |
| **Hilton Domestic Operating Co., Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.02.2032 | $ | 380 | 303 | 0,20 |
| 4,000 % fällig am 01.05.2031 | | 200 | 167 | 0,11 |
| **InterContinental Hotels Group PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 08.10.2028 | £ | 500 | 554 | 0,37 |
| **JCDecaux S.A.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 07.02.2030 | € | 300 | 257 | 0,17 |
| **JDE Peet's NV** | | | | |
| 2,250 % fällig am 24.09.2031 | $ | 600 | 469 | 0,31 |
| **John Lewis PLC** | | | | |
| 6,125 % fällig am 21.01.2025 | £ | 200 | 251 | 0,17 |
| **Lendlease Europe Finance PLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 02.12.2033 | | 400 | 380 | 0,25 |
| **Lenovo Group Ltd.** | | | | |
| 3,421 % fällig am 02.11.2030 | $ | 400 | 341 | 0,22 |
| **Level 3 Financing, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.07.2029 | | 80 | 62 | 0,04 |
| **Liberty Utilities Finance GP** | | | | |
| 2,050 % fällig am 15.09.2030 | | 300 | 246 | 0,16 |
| **Lindblad Expeditions LLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.02.2027 | | 300 | 258 | 0,17 |
| **Marks & Spencer PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 19.05.2026 | £ | 100 | 107 | 0,07 |
| 4,500 % fällig am 10.07.2027 | | 350 | 364 | 0,24 |
| **Metalsa S.A. de C.V.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 04.05.2031 | $ | 150 | 106 | 0,07 |
| **Natura Cosmeticos S.A.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 03.05.2028 | | 600 | 495 | 0,33 |
| **Nemak S.A.B. de C.V.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 20.07.2028 | € | 400 | 301 | 0,20 |
| **Newell Brands, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.06.2025 | $ | 200 | 197 | 0,13 |
| **NextEra Energy Operating Partners LP** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.10.2026 | | 180 | 165 | 0,11 |
| **Nokia Oyj** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.05.2028 | € | 400 | 383 | 0,25 |
| **NXP BV** | | | | |
| 2,500 % fällig am 11.05.2031 | $ | 250 | 206 | 0,14 |
| 5,000 % fällig am 15.01.2033 | | 1.000 | 977 | 0,65 |
| **Pearson Funding PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 04.06.2030 | £ | 100 | 115 | 0,08 |
| **Prosus NV** | | | | |
| 3,061 % fällig am 13.07.2031 | $ | 600 | 442 | 0,29 |
| 3,257 % fällig am 19.01.2027 | | 300 | 261 | 0,17 |
| **RELX Capital, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 20.05.2032 | | 800 | 814 | 0,54 |
| **ReNew Power Pvt Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 05.03.2027 | | 200 | 183 | 0,12 |
| **Rexel S.A.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.12.2028 | € | 300 | 244 | 0,16 |
| **Schaeffler AG** | | | | |
| 3,375 % fällig am 12.10.2028 | | 200 | 170 | 0,11 |
| **Sixt SE** | | | | |
| 1,750 % fällig am 09.12.2024 | | 200 | 205 | 0,14 |
| **Standard Industries, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 21.11.2026 | | 600 | 493 | 0,33 |
| **Sunnova Energy Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.09.2026 | $ | 550 | 479 | 0,32 |
| **Travis Perkins PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 17.02.2026 | £ | 400 | 424 | 0,28 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Verallia S.A.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 14.05.2028 | € | 500 | $ 431 | 0,28 |
| 1,875 % fällig am 10.11.2031 | | 500 | 391 | 0,26 |
| **VeriSign, Inc.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 15.06.2031 | $ | 650 | 524 | 0,35 |
| **Vilmorin & Cie S.A.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 26.03.2028 | € | 300 | 244 | 0,16 |
| **Vmed O2 UK Financing PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.07.2031 | $ | 600 | 486 | 0,32 |
| **Wabtec Transportation Netherlands BV** | | | | |
| 1,250 % fällig am 03.12.2027 | € | 400 | 342 | 0,23 |
| **Weir Group PLC** | | | | |
| 2,200 % fällig am 13.05.2026 | $ | 400 | 352 | 0,23 |
| **Zenith Finco PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 30.06.2027 | £ | 200 | 196 | 0,13 |
| | | | 19.929 | 13,19 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **AES Corp.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 15.01.2031 | $ | 300 | 241 | 0,16 |
| **Atlantica Sustainable Infrastructure PLC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.06.2028 | | 200 | 174 | 0,12 |
| **Azure Power Energy Ltd.** | | | | |
| 3,575 % fällig am 19.08.2026 | | 193 | 160 | 0,11 |
| **Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 25.03.2027 | | 196 | 156 | 0,10 |
| **Clearway Energy Operating LLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.02.2031 | | 630 | 510 | 0,34 |
| **Enel Finance International NV** | | | | |
| 2,250 % fällig am 12.07.2031 | | 400 | 314 | 0,21 |
| **Greenko Dutch BV** | | | | |
| 3,850 % fällig am 29.03.2026 | | 194 | 165 | 0,11 |
| **Greenko Power Ltd.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 13.12.2028 | | 196 | 157 | 0,10 |
| **Greenko Solar Mauritius Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 29.07.2026 | | 200 | 179 | 0,12 |
| **Iberdrola International BV** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.09.2033 | | 250 | 284 | 0,19 |
| **India Green Energy Holdings** | | | | |
| 5,375 % fällig am 29.04.2024 | | 250 | 234 | 0,15 |
| **India Green Power Holdings** | | | | |
| 4,000 % fällig am 22.02.2027 | | 250 | 196 | 0,13 |
| **Leeward Renewable Energy Operations LLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.07.2029 | | 500 | 400 | 0,26 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,200 % fällig am 02.12.2026 | AUD | 400 | 244 | 0,16 |
| **Pattern Energy Operations LP** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.08.2028 | $ | 500 | 436 | 0,29 |
| **Southern California Edison Co.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.06.2031 | | 400 | 336 | 0,22 |
| 3,650 % fällig am 01.06.2051 | | 200 | 156 | 0,10 |
| **Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 24.04.2033 | | 329 | 310 | 0,20 |
| **TerraForm Power Operating LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 31.01.2028 | | 230 | 209 | 0,14 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 03.09.2041 | | 300 | 225 | 0,15 |
| **Vodafone Group PLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 04.06.2081 | | 113 | 76 | 0,05 |
| | | | 5.162 | 3,41 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 69.395 | 45,91 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.08.2059 | | 3.616 | 3.514 | 2,32 |
| 4,000 % fällig am 01.11.2059 | | 160 | 160 | 0,11 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.07.2052 | | 500 | 434 | 0,29 |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 | | 1.750 | 1.574 | 1,04 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2052 | | 12.800 | 12.626 | 8,35 |
| | | | 18.308 | 12,11 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2031 | | 1.337 | 1.273 | 0,84 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 0,750 % fällig am 15.02.2045 | $ | 196 | $ 176 | 0,12 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2046 | | 500 | 475 | 0,31 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 | | 781 | 800 | 0,53 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 2,375 % fällig am 31.03.2029 | | 2.100 | 2.011 | 1,33 |
| | | | 4.735 | 3,13 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **1211 Avenue of the Americas Trust** | | | | |
| 4,280 % fällig am 10.08.2035 | | 1.395 | 1.305 | 0,86 |
| **280 Park Avenue Mortgage Trust** | | | | |
| 2,271 % fällig am 15.09.2034 | | 1.597 | 1.553 | 1,03 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 6,479 % fällig am 25.10.2036 | | 71 | 65 | 0,04 |
| **Barclays Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 0,749 % fällig am 10.08.2033 (a) | | 9.200 | 159 | 0,10 |
| 4,216 % fällig am 10.08.2033 | | 105 | 101 | 0,07 |
| 4,498 % fällig am 10.08.2035 | | 1.600 | 1.521 | 1,01 |
| 4,715 % fällig am 10.08.2033 | | 2.190 | 2.003 | 1,33 |
| 5,122 % fällig am 10.08.2035 | | 350 | 315 | 0,21 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.06.2046 ^ | | 900 | 791 | 0,52 |
| **Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 3,960 % fällig am 10.02.2036 | | 1.000 | 936 | 0,62 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Trust** | | | | |
| 3,196 % fällig am 10.07.2034 | | 600 | 599 | 0,40 |
| 3,303 % fällig am 10.07.2034 | | 1.500 | 1.498 | 0,99 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,752 % fällig am 19.03.2037 | | 1.417 | 1.203 | 0,80 |
| **European Loan Conduit DAC** | | | | |
| 1,678 % fällig am 22.07.2029 | £ | 897 | 1.066 | 0,71 |
| **Independence Plaza Trust** | | | | |
| 3,763 % fällig am 10.07.2035 | $ | 345 | 335 | 0,22 |
| 3,911 % fällig am 10.07.2035 | | 1.940 | 1.873 | 1,24 |
| 4,158 % fällig am 10.07.2035 | | 132 | 127 | 0,08 |
| 4,356 % fällig am 10.07.2035 | | 1.050 | 998 | 0,66 |
| **InTown Hotel Portfolio Trust** | | | | |
| 2,775 % fällig am 15.01.2033 | | 1.325 | 1.309 | 0,87 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 3,722 % fällig am 05.07.2032 | | 1.470 | 1.469 | 0,97 |
| **Liberty Street Trust** | | | | |
| 4,501 % fällig am 10.02.2036 | | 1.200 | 1.149 | 0,76 |
| **Madison Avenue Mortgage Trust** | | | | |
| 4,108 % fällig am 15.08.2034 | | 935 | 881 | 0,58 |
| **MortgageIT Trust** | | | | |
| 2,224 % fällig am 25.08.2035 | | 470 | 452 | 0,30 |
| **Natixis Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 3,917 % fällig am 15.11.2032 | | 1.220 | 1.200 | 0,79 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 2,004 % fällig am 25.12.2036 | | 80 | 71 | 0,05 |
| **Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust** | | | | |
| 3,430 % fällig am 25.04.2037 | | 51 | 45 | 0,03 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,269 % fällig am 25.04.2035 | | 64 | 61 | 0,04 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,577 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 95 | 89 | 0,06 |
| **Worldwide Plaza Trust** | | | | |
| 3,715 % fällig am 10.11.2036 | | 1.795 | 1.546 | 1,02 |
| | | | 24.720 | 16,36 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,674 % fällig am 25.05.2035 | | 1.275 | 1.206 | 0,80 |
| **Argent Securities Trust** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.06.2036 | | 2.056 | 692 | 0,46 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,124 % fällig am 25.08.2036 | | 1.287 | 1.171 | 0,77 |
| 2,749 % fällig am 25.02.2035 | | 70 | 70 | 0,05 |
| **BNC Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,984 % fällig am 25.10.2036 | | 110 | 84 | 0,05 |
| **Centex Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,539 % fällig am 25.10.2035 | | 117 | 117 | 0,08 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 77 | 70 | 0,05 |
| 2,144 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 359 | 339 | 0,22 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,164 % fällig am 25.03.2036 | $ 1.446 | $ 1.258 | 0,83 |
| 2,374 % fällig am 25.12.2035 | 1.116 | 1.067 | 0,71 |
| **GSAMP Trust** | | | |
| 2,104 % fällig am 25.06.2036 | 1.957 | 1.199 | 0,79 |
| 2,524 % fällig am 25.11.2035 ^ | 100 | 96 | 0,06 |
| **Lehman XS Trust** | | | |
| 1,944 % fällig am 25.02.2037 | 728 | 714 | 0,47 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,774 % fällig am 25.11.2036 | 549 | 402 | 0,27 |
| 1,934 % fällig am 25.08.2036 | 2.689 | 1.488 | 0,98 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | |
| 2,299 % fällig am 25.09.2035 | 500 | 478 | 0,32 |
| **Mosaic Solar Loans LLC** | | | |
| 4,450 % fällig am 20.06.2042 | 591 | 580 | 0,38 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | |
| 2,124 % fällig am 25.10.2036 | 679 | 653 | 0,43 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | |
| 2,599 % fällig am 25.05.2035 | 1.405 | 1.218 | 0,81 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,914 % fällig am 25.07.2036 ^ | $ 1.309 | $ 1.249 | 0,83 |
| **Structured Asset Securities Corp. Trust** | | | |
| 6,617 % fällig am 25.05.2031 | 82 | 71 | 0,05 |
| | | 14.222 | 9,41 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Chile Government International Bond** | | | |
| 2,750 % fällig am 31.01.2027 | 300 | 281 | 0,19 |
| 3,500 % fällig am 31.01.2034 | 300 | 267 | 0,18 |
| **Korea Development Bank** | | | |
| 4,800 % fällig am 10.06.2023 | IDR 1.150.000 | 77 | 0,05 |
| **Mexico Government International Bond** | | | |
| 2,250 % fällig am 12.08.2036 | € 870 | 634 | 0,42 |
| **Romania Government International Bond** | | | |
| 1,750 % fällig am 13.07.2030 | 600 | 448 | 0,30 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Serbia Government International Bond** | | | |
| 1,000 % fällig am 23.09.2028 | 400 | 306 | 0,20 |
| **South Africa Government International Bond** | | | |
| 10,500 % fällig am 21.12.2026 | ZAR 8.500 | $ 549 | 0,36 |
| | | 2.562 | 1,70 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **U.S. TREASURY BILLS** | | | |
| 0,589 % fällig am 12.07.2022 (b)(c)(h) | $ 2.400 | 2.400 | 1,59 |
| 0,683 % fällig am 05.07.2022 (b)(c) | 3.900 | 3.900 | 2,58 |
| 0,813 % fällig am 28.07.2022 (b)(c) | 3.300 | 3.298 | 2,18 |
| 1,416 % fällig am 04.10.2022 (b)(c) | 1.500 | 1.494 | 0,99 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 11.092 | 7,34 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | **$ 145.034** | **95,96** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 1,480 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 16.600 | U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2025 | $ (16.919) | $ 16.600 | $ 16.601 | 10,98 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (16.919)** | **$ 16.600** | **$ 16.601** | **10,98** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 47 | $ (19) | (0,01) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 117 | 80 | 0,05 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2022 | 10 | 12 | 0,01 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2022 | 14 | 63 | 0,04 |
| | | | | $ 136 | 0,09 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CME Kaufoptionen mit Ausübungskurs von @ USD 98,000 auf 3-Month SOFR December Futures | $ 98,000 | 15.12.2023 | 3 | $ (2) | $ (2) | 0,00 |
| Call - CME Verkaufoptionen mit Ausübungskurs von @ USD 96,500 auf 3-Month SOFR December Futures | 96,500 | 15.12.2023 | 3 | (3) | (4) | 0,00 |
| | | | | $ (5) | $ (6) | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ 130** | **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 | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| British Telecommunications PLC | 1,000 % | 20.06.2028 | € 200 | $ (7) | (0,01) |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.12.2028 | 900 | (31) | (0,02) |
| Tesco PLC | 1,000 | 20.06.2028 | 100 | (5) | 0,00 |
| Valeo S.A. | 1,000 | 20.06.2026 | 400 | (21) | (0,01) |
| Valeo S.A. | 1,000 | 20.06.2028 | 300 | (29) | (0,02) |
| | | | | $ (93) | (0,06) |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 % | 21.09.2027 | £ 900 | $ 31 | 0,02 |
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2032 | 1.610 | 142 | 0,09 |
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2052 | 1.530 | 533 | 0,35 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 15.12.2026 | ¥ 330.000 | 12 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 16.06.2028 | 890.000 | 101 | 0,07 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,400 | 15.06.2032 | 330.000 | 19 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,500 | 15.03.2042 | 170.000 | 35 | 0,02 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,573 | 28.02.2027 | $ 300 | (14) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,618 | 09.02.2029 | 200 | (12) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,620 | 18.04.2027 | 300 | (14) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,650 | 08.02.2032 | 250 | (22) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,730 | 24.02.2032 | 150 | (12) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,765 | 16.03.2032 | 300 | (24) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,770 | 14.02.2032 | 150 | (12) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,783 | 22.04.2027 | 400 | (16) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,788 | 03.05.2027 | 500 | (20) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,817 | 05.04.2032 | 150 | (11) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,872 | 06.04.2032 | 150 | (10) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,888 | 22.03.2029 | 200 | (10) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,928 | 25.03.2027 | 300 | (10) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,250 | 17.06.2027 | 400 | (8) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,370 | 21.06.2027 | 400 | (6) | 0,00 |
| Erhalt[3] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,430 | 30.09.2027 | 460 | 8 | 0,01 |
| Erhalt[3] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,450 | 04.10.2027 | 460 | 8 | 0,01 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,605 | 28.06.2027 | 400 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,500 | 16.06.2028 | 150 | 14 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,750 | 16.06.2031 | 100 | 11 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 15.12.2026 | 6.000 | (498) | (0,33) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 16.06.2051 | 40 | 6 | 0,00 |
| Zahlung[3] | 3-Month USD-LIBOR | 1,270 | 04.11.2023 | 1.800 | (8) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,350 | 20.01.2027 | 200 | 14 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,360 | 15.02.2027 | 550 | 38 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,380 | 04.01.2027 | 500 | (32) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,418 | 20.01.2027 | 250 | (16) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,420 | 24.02.2027 | 400 | 27 | 0,02 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,425 | 18.01.2027 | 500 | (31) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,443 | 18.01.2027 | 500 | (31) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,450 | 17.02.2027 | 500 | 33 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,450 | 16.07.2031 | 50 | 6 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 15.12.2028 | 800 | (82) | (0,05) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 12.01.2029 | 110 | 10 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,518 | 20.01.2029 | 150 | (13) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,535 | 15.10.2031 | 200 | (24) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,550 | 20.01.2027 | 700 | (39) | (0,03) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,570 | 11.01.2027 | 200 | (11) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,570 | 12.01.2027 | 100 | (6) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,580 | 16.02.2027 | 300 | (17) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,600 | 15.02.2027 | 2.200 | (121) | (0,08) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,630 | 26.01.2029 | 150 | (12) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,650 | 24.02.2027 | 1.300 | (69) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,655 | 24.01.2032 | 150 | (16) | (0,01) |
| Zahlung[3] | 3-Month USD-LIBOR | 1,700 | 06.03.2024 | 500 | (8) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,700 | 17.02.2027 | 2.100 | (105) | (0,07) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,700 | 12.01.2029 | 400 | (28) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,735 | 12.01.2032 | 150 | (15) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,785 | 12.08.2051 | 50 | 12 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,815 | 24.01.2052 | 50 | (11) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,867 | 26.01.2052 | 50 | (10) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 18.02.2032 | 200 | (15) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 15.12.2051 | 200 | (47) | (0,03) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2027 | € 4.200 | 274 | 0,18 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | 7.860 | 969 | 0,64 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2052 | 400 | 131 | 0,09 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 13.05.2027 | 700 | (23) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.05.2027 | 400 | (13) | (0,01) |
| | | | | | $ 931 | 0,62 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 838** | **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.

(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

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,150 % | 01.12.2023 | 400 | $ (1) | $ (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,650 | 01.12.2023 | 400 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,350 | 16.08.2022 | 200 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 16.08.2022 | 200 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,310 | 19.08.2022 | 200 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,010 | 19.08.2022 | 200 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 26.08.2022 | 1.000 | (5) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,850 | 26.08.2022 | 1.000 | (5) | (10) | (0,01) |
| BPS | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 11.04.2023 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 11.04.2023 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 28.04.2023 | 400 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 28.04.2023 | 400 | (1) | (1) | 0,00 |
| CBK | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,690 | 02.04.2024 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,690 | 02.04.2024 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 01.09.2022 | 500 | (4) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 01.09.2022 | 500 | (4) | (5) | (0,01) |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,755 | 30.09.2022 | 300 | (2) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,955 | 30.09.2022 | 300 | (2) | (3) | 0,00 |
| DUB | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,920 | 13.10.2023 | 300 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,920 | 13.10.2023 | 300 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,790 | 08.04.2024 | 200 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,790 | 08.04.2024 | 200 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 02.09.2022 | 600 | (3) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 02.09.2022 | 600 | (3) | (4) | (0,01) |
| GLM | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,870 | 02.11.2022 | 7.000 | (14) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,270 | 02.11.2022 | 7.000 | (14) | (160) | (0,11) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,920 | 13.10.2023 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,920 | 13.10.2023 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,018 | 20.10.2023 | 200 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,018 | 20.10.2023 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,140 | 23.10.2023 | 200 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,140 | 23.10.2023 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,190 | 23.10.2023 | 200 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,190 | 23.10.2023 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,225 | 23.10.2023 | 200 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,225 | 23.10.2023 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,973 | 25.10.2023 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,973 | 25.10.2023 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,841 | 27.10.2023 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,841 | 27.10.2023 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,088 | 03.11.2023 | 200 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,088 | 03.11.2023 | 200 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,910 | 10.11.2023 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,910 | 10.11.2023 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 17.11.2023 | 400 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 17.11.2023 | 400 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,150 | 20.11.2023 | 400 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,650 | 20.11.2023 | 400 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 07.12.2023 | 400 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 07.12.2023 | 400 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,697 | 02.04.2024 | 500 | (4) | (4) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,697 | 02.04.2024 | 500 | (4) | (3) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,721 | 08.04.2024 | 200 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,721 | 08.04.2024 | 200 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 05.04.2023 | 400 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 05.04.2023 | 400 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 11.04.2023 | 700 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 11.04.2023 | 700 | (1) | (3) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 26.04.2023 | 400 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 26.04.2023 | 400 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 15.05.2023 | 500 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 15.05.2023 | 500 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,370 | 18.08.2022 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,070 | 18.08.2022 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 06.09.2022 | 600 | (4) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 06.09.2022 | 600 | (4) | (5) | (0,01) |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 | 07.09.2022 | 600 | (4) | (4) | (0,01) |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,100 | 07.09.2022 | 600 | (4) | (5) | (0,01) |
| MYC | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,993 | 11.10.2023 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,993 | 11.10.2023 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | | $ (147) | $ (279) | (0,18) |

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SAL | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | $ 99,563 | 07.07.2022 | 400 | $ (2) | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 100,281 | 07.07.2022 | 300 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | $ (3) | $ (1) | 0,00 |

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYC | South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2026 | $ 1.000 | $ (44) | $ (35) | $ (79) | (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.

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYC | Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,880 % | 30.09.2027 | $ 1.300 | $ 0 | $ (12) | $ (12) | (0,01) |
| | Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,900 | 04.10.2027 | 1.300 | 0 | (12) | (12) | (0,01) |
| | | | | | | $ 0 | $ (24) | $ (24) | (0,02) |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | ZAR | 935 | $ | 62 | $ 5 | $ 0 | $ 5 | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 603 | | 636 | 4 | (1) | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | £ | 305 | | 380 | 9 | 0 | 9 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 296 | AUD | 430 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 403 | CAD | 519 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.535 | € | 1.450 | 0 | (15) | (15) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 180 | £ | 148 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 2.530 | ¥ | 335.600 | 0 | (53) | (53) | (0,04) |
| | 08.2022 | | 207 | NOK | 1.972 | 0 | (7) | (7) | (0,01) |
| BPS | 07.2022 | BRL | 7.599 | $ | 1.474 | 20 | 0 | 20 | 0,01 |
| | 07.2022 | MXN | 9.557 | | 476 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 457 | MXN | 9.557 | 17 | 0 | 17 | 0,01 |
| | 08.2022 | € | 250 | $ | 265 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 1.462 | BRL | 7.599 | 0 | (21) | (21) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 817 | CAD | 1.057 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 224 | € | 212 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 558 | MXN | 12.249 | 46 | 0 | 46 | 0,03 |
| | 09.2022 | | 469 | | 9.557 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| BRC | 08.2022 | | 143 | NOK | 1.397 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| CBK | 08.2022 | | 432 | AUD | 613 | 0 | (10) | (10) | (0,01) |
| DUB | 08.2022 | € | 17.837 | $ | 18.940 | 239 | 0 | 239 | 0,16 |
| | 08.2022 | £ | 4.844 | | 5.975 | 88 | 0 | 88 | 0,06 |
| | 12.2022 | ZAR | 600 | | 38 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 02.2023 | $ | 85 | ZAR | 1.415 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | | 1.618 | BRL | 8.038 | 0 | (81) | (81) | (0,05) |
| | 07.2022 | | 171 | MXN | 3.498 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 05.2023 | | 149 | ZAR | 2.486 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| JPM | 08.2022 | | 255 | € | 241 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| MBC | 08.2022 | IDR | 73.530 | $ | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 342 | CAD | 438 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 250 | CLP | 209.721 | 0 | (28) | (28) | (0,02) |
| | 08.2022 | | 1.604 | € | 1.490 | 0 | (42) | (42) | (0,03) |
| | 08.2022 | | 178 | £ | 147 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 312 | ¥ | 41.900 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | € | 56 | $ | 59 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 197.816 | | 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 94 | € | 89 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 08.2022 | £ | 124 | $ | 156 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 181 | £ | 145 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 09.2022 | ZAR | 547 | $ | 35 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SOG | 08.2022 | $ 436 | NOK 4.277 | $ 0 | $ (3) | $ (3) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | BRL 439 | $ 92 | 8 | 0 | 8 | 0,01 |
| | 08.2022 | AUD 105 | 76 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | ZAR 410 | 26 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09.2022 | MXN 1.658 | 83 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 10.2022 | $ 237 | MXN 4.844 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 11.2022 | 168 | ZAR 2.740 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR 2.740 | $ 174 | 9 | 0 | 9 | 0,01 |
| | | | | $ 470 | $ (286) | $ 184 | 0,12 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) ausschüttend und R AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | AUD 14.457 | $ 10.038 | $ 97 | $ 0 | $ 97 | 0,06 |
| | 07.2022 | $ 13.333 | AUD 18.518 | 0 | (599) | (599) | (0,40) |
| | 08.2022 | 10.040 | 14.457 | 0 | (97) | (97) | (0,06) |
| BPS | 07.2022 | 372 | 538 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | AUD 10.510 | $ 7.231 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 7.233 | AUD 10.510 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | AUD 566 | $ 407 | 18 | 0 | 18 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ 14.533 | AUD 20.222 | 0 | (627) | (627) | (0,41) |
| SCX | 07.2022 | AUD 12.571 | $ 8.645 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 8.647 | AUD 12.571 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | 13.406 | 18.768 | 0 | (500) | (500) | (0,33) |
| | | | | $ 119 | $ (1.829) | $ (1.710) | (1,13) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | $ 228 | CHF 218 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | 4 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | 228 | 218 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | CHF 210 | $ 221 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 228 | CHF 218 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 221 | 210 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | CHF 6 | $ 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 2 | $ (2) | $ 0 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | € 31 | $ 33 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 1.603 | € 1.516 | 0 | (19) | (19) | (0,01) |
| BPS | 07.2022 | € 28.493 | $ 29.999 | 212 | 0 | 212 | 0,14 |
| | 07.2022 | $ 4.763 | € 4.518 | 0 | (39) | (39) | (0,03) |
| | 08.2022 | 28.498 | 27.045 | 0 | (171) | (171) | (0,11) |
| CBK | 07.2022 | € 58 | $ 62 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | 27.056 | 28.463 | 177 | 0 | 177 | 0,12 |
| | 07.2022 | $ 30.982 | € 28.738 | 1 | (940) | (939) | (0,62) |
| | 08.2022 | 28.503 | 27.045 | 0 | (177) | (177) | (0,12) |
| MYI | 07.2022 | € 7.832 | $ 8.413 | 226 | 0 | 226 | 0,15 |
| SOG | 07.2022 | $ 30.630 | € 28.498 | 0 | (837) | (837) | (0,56) |
| UAG | 07.2022 | 26.920 | 25.051 | 0 | (730) | (730) | (0,48) |
| | | | | $ 618 | $ (2.913) | $ (2.295) | (1,52) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | $ 182 | £ 144 | $ 0 | $ (7) | $ (7) | (0,01) |
| BPS | 07.2022 | 5 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | 182 | 144 | 0 | (7) | (7) | (0,01) |
| CBK | 07.2022 | £ 6 | $ 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | 5 | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | $ 182 | £ 144 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | £ 138 | $ 168 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 169 | £ 138 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 0 | $ (20) | $ (20) | (0,02) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | SEK 1.475 | $ 151 | $ 7 | $ 0 | $ 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 4.086 | SEK 39.879 | 0 | (195) | (195) | (0,13) |
| CBK | 07.2022 | 4.247 | 41.549 | 0 | (192) | (192) | (0,13) |
| GLM | 07.2022 | 85 | 832 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 4.412 | 43.120 | 0 | (205) | (205) | (0,13) |
| | | | | $ 7 | $ (596) | $ (589) | (0,39) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | SGD 55 | $ 39 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 86 | SGD 118 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | 39 | 55 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | SGD 110 | $ 79 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 79 | SGD 110 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | SGD 3 | $ 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | $ 1 | SGD 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 87 | 119 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | 90 | 124 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | $ 0 | $ (4) | $ (4) | 0,00 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (4.817)** | **(3,19)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 157.785** | **104,40** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ (6.645)** | **(4,40)** |
| **Nettovermögen** | **$ 151.140** | **100,00** |

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Nullkuponwertpapier.

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

(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Eingeschränkte Wertpapiere:

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeits-datum | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Deutsche Bank AG | 3,035 % | 28.05.2032 | 25.08.2021 - 02.09.2021 | $ 360 | $ 277 | 0,18 |
| Standard Chartered PLC | 3,603 | 12.01.2033 | 05.01.2022 | 200 | 164 | 0,11 |
| | | | | $ 560 | $ 441 | 0,29 |

(h) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurde zum 30. Juni 2022 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von USD 411 und Barmittel in Höhe von USD 4.460 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 2.096 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 145.034 | $ 0 | $ 145.034 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 16.600 | 0 | 16.600 |
| Finanzderivate[3] | 0 | (3.849) | 0 | (3.849) |
| **Summen** | **$ 0** | **$ 157.785** | **$ 0** | **$ 157.785** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 122.326 | $ 0 | $ 122.326 |
| Finanzderivate[3] | 0 | 1.270 | 0 | 1.270 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (204) | 0 | (204) |
| **Summen** | **$ 0** | **$ 123.392** | **$ 0** | **$ 123.392** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (893) | $ 670 | $ (223) |
| BPS | 65 | (60) | 5 |
| BRC | (8) | 0 | (8) |
| CBK | (214) | 0 | (214) |
| DUB | 315 | 411 | 726 |
| GLM | (313) | 260 | (53) |
| JPM | (3) | 0 | (3) |
| MBC | (1.622) | 1.510 | (112) |
| MYC | (105) | 0 | (105) |
| MYI | 225 | (20) | 205 |
| SAL | (1) | 0 | (1) |
| SCX | (212) | 0 | (212) |
| SOG | (840) | 870 | 30 |
| UAG | (1.211) | 1.150 | (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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 40,47 | 42,95 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 54,20 | 52,99 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 1,29 | 1,85 |
| Pensionsgeschäfte | 10,98 | k. A. |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,09 | (0,06) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,56 | 0,14 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (3,19) | 0,93 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | k. A. | (0,16) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 45,91 | 50,66 |
| US-Regierungsbehörden | 12,11 | 4,26 |
| US-Schatzobligationen | 3,13 | 2,72 |
| Non-Agency-MBS | 16,36 | 11,55 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 9,41 | 4,24 |
| Staatsemissionen | 1,70 | 2,39 |
| Kurzfristige Instrumente | 7,34 | 21,97 |
| Pensionsgeschäfte | 10,98 | k. A. |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,09 | (0,06) |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | 0,00 | k. A. |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,06) | (0,03) |
| Zinsswaps | 0,62 | 0,17 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Devisenoptionen | k. A. | 0,00 |
| Zinsswapoptionen | (0,18) | (0,03) |
| Optionen auf Wertpapiere | 0,00 | (0,01) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,05) | k. A. |
| Zinsswaps | (0,02) | 0,01 |
| Devisenterminkontrakte | 0,12 | 0,10 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (3,06) | 0,86 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | k. A. | (0,16) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (4,40) | 1,36 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | |
| 3,374 % fällig am 22.06.2026 | $ | 214 | € 197 | 0,01 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **AMCO - Asset Management Co. SpA** | | | | |
| 1,500 % fällig am 17.07.2023 | € | 9.000 | 9.035 | 0,44 |
| **Annington Funding PLC** | | | | |
| 1,650 % fällig am 12.07.2024 | | 1.100 | 1.073 | 0,05 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 11.09.2025 | | 3.000 | 2.750 | 0,13 |
| **Banca Carige SpA** | | | | |
| 0,625 % fällig am 28.10.2029 | | 6.600 | 5.979 | 0,29 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (f)(h) | | 1.200 | 1.156 | 0,06 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 14.01.2026 (f)(h) | | 5.200 | 4.390 | 0,21 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,237 % fällig am 25.04.2024 | | 900 | 900 | 0,04 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (h) | $ | 9.100 | 8.792 | 0,43 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 06.10.2023 | £ | 3.502 | 4.058 | 0,20 |
| 2,885 % fällig am 31.01.2027 | € | 4.000 | 3.893 | 0,19 |
| 3,125 % fällig am 17.01.2024 | £ | 8.700 | 9.969 | 0,48 |
| 4,375 % fällig am 15.03.2028 (f)(h) | $ | 200 | 147 | 0,01 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (f)(h) | | 700 | 659 | 0,03 |
| **Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL** | | | | |
| 2,200 % fällig am 24.07.2025 | € | 2.600 | 2.428 | 0,12 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 25.02.2030 (f)(h) | $ | 200 | 143 | 0,01 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 14.09.2028 (f)(h) | € | 200 | 138 | 0,01 |
| 6,750 % fällig am 13.06.2024 (f)(h) | | 2.000 | 1.931 | 0,09 |
| **China Construction Bank Europe S.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 28.06.2024 (c) | | 6.300 | 6.073 | 0,30 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 27.10.2022 | $ | 2.500 | 2.394 | 0,12 |
| 4,412 % fällig am 31.03.2031 | | 8.100 | 7.408 | 0,36 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 3,250 % fällig am 29.12.2026 (f)(h) | € | 1.400 | 1.148 | 0,06 |
| 4,625 % fällig am 29.12.2025 (f)(h) | | 3.800 | 3.504 | 0,17 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 27.01.2031 | | 6.500 | 4.322 | 0,21 |
| 1,625 % fällig am 23.04.2027 | | 700 | 560 | 0,03 |
| 2,750 % fällig am 12.05.2026 | | 8.000 | 7.128 | 0,35 |
| 2,750 % fällig am 22.01.2028 | £ | 4.500 | 4.042 | 0,20 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,862 % fällig am 31.05.2024 | € | 6.800 | 6.825 | 0,33 |
| 1,000 % fällig am 07.06.2023 | | 1.300 | 1.293 | 0,06 |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (h) | $ | 2.600 | 2.493 | 0,12 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 3,250 % fällig am 02.04.2026 | € | 6.000 | 5.864 | 0,28 |
| 4,194 % fällig am 01.04.2031 | $ | 2.500 | 2.118 | 0,10 |
| 7,250 % fällig am 12.09.2025 (f)(h) | | 7.300 | 6.068 | 0,29 |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (f)(h) | | 2.200 | 1.947 | 0,09 |
| **CTP NV** | | | | |
| 0,500 % fällig am 21.06.2025 | € | 3.200 | 2.730 | 0,13 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,750 % fällig am 17.02.2027 | | 6.200 | 5.489 | 0,27 |
| 1,375 % fällig am 03.09.2026 | | 7.400 | 6.884 | 0,33 |
| 1,625 % fällig am 20.01.2027 | | 3.000 | 2.690 | 0,13 |
| 2,222 % fällig am 18.09.2024 | $ | 1.900 | 1.753 | 0,08 |
| 4,500 % fällig am 30.11.2026 (f)(h) | € | 200 | 156 | 0,01 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.01.2028 (c) | | 4.300 | 3.876 | 0,19 |
| 0,010 % fällig am 22.01.2027 | | 8.500 | 7.860 | 0,38 |
| 0,500 % fällig am 17.01.2025 | | 3.500 | 3.421 | 0,17 |
| **DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH** | | | | |
| 2,500 % fällig am 25.01.2027 | | 6.500 | 5.396 | 0,26 |
| **Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial** | | | | |
| 0,010 % fällig am 23.06.2028 | | 10.500 | 9.429 | 0,46 |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | |
| 0,250 % fällig am 20.01.2032 | € | 4.200 | € 3.544 | 0,17 |
| **Europäische Union** | | | | |
| 0,000 % fällig am 06.07.2026 (c) | | 1.100 | 1.039 | 0,05 |
| 0,000 % fällig am 04.07.2029 (c) | | 1.000 | 882 | 0,04 |
| 0,000 % fällig am 04.07.2031 (c) | | 4.200 | 3.515 | 0,17 |
| 0,250 % fällig am 22.04.2036 | | 23.000 | 17.426 | 0,85 |
| 0,450 % fällig am 04.07.2041 | | 8.600 | 5.997 | 0,29 |
| 0,450 % fällig am 02.05.2046 | | 930 | 608 | 0,03 |
| 0,700 % fällig am 06.07.2051 | | 1.000 | 650 | 0,03 |
| 0,750 % fällig am 04.01.2047 | | 7.700 | 5.393 | 0,26 |
| **Fab Sukuk Co. Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 05.03.2023 | $ | 1.500 | 1.438 | 0,07 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028 | € | 2.400 | 2.224 | 0,11 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 0,092 % fällig am 07.12.2022 | | 6.400 | 6.354 | 0,31 |
| 1,744 % fällig am 19.07.2024 | | 3.500 | 3.242 | 0,16 |
| 2,748 % fällig am 14.06.2024 | £ | 6.500 | 6.984 | 0,34 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 24.02.2025 | € | 3.400 | 3.209 | 0,16 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 0,555 % fällig am 30.04.2024 | | 14.100 | 14.108 | 0,69 |
| 0,579 % fällig am 07.02.2025 | | 7.300 | 7.268 | 0,35 |
| 2,870 % fällig am 15.03.2024 | $ | 1.700 | 1.629 | 0,08 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 23.03.2023 (f)(h) | | 2.400 | 2.254 | 0,11 |
| 6,500 % fällig am 20.05.2024 | £ | 1.800 | 2.188 | 0,11 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 3,875 % fällig am 16.05.2027 (f)(h) | $ | 200 | 139 | 0,01 |
| 4,875 % fällig am 16.05.2029 (f)(h) | | 8.200 | 6.427 | 0,31 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.03.2028 (f)(h) | € | 250 | 201 | 0,01 |
| **JAB Holdings BV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 18.05.2028 | | 5.100 | 4.540 | 0,22 |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 0,375 % fällig am 01.07.2024 | | 800 | 784 | 0,04 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 2.682 | 282 | 0,01 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 3.535 | 384 | 0,02 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 12.748 | 1.498 | 0,07 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.09.2028 (c) | € | 6.500 | 5.871 | 0,29 |
| 0,000 % fällig am 15.06.2029 (c) | | 11.100 | 9.818 | 0,48 |
| 0,000 % fällig am 15.09.2031 (c) | | 17.900 | 14.974 | 0,73 |
| 2,000 % fällig am 15.11.2029 (b) | | 17.100 | 17.301 | 0,84 |
| 5,000 % fällig am 19.03.2024 | AUD | 200 | 135 | 0,01 |
| **Landesbank Baden-Wuerttemberg** | | | | |
| 2,000 % fällig am 24.02.2025 | $ | 3.300 | 3.046 | 0,15 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 1,000 % fällig am 02.05.2023 | € | 1.100 | 1.094 | 0,05 |
| 1,375 % fällig am 07.03.2024 | | 6.100 | 5.993 | 0,29 |
| **Liberty Mutual Group, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 23.05.2059 | | 10.700 | 9.679 | 0,47 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.03.2027 | £ | 4.000 | 5.087 | 0,25 |
| **Metropolitan Life Global Funding** | | | | |
| 0,900 % fällig am 08.06.2023 | $ | 3.400 | 3.184 | 0,15 |
| **New York Life Global Funding** | | | | |
| 2,900 % fällig am 17.01.2024 | | 5.000 | 4.740 | 0,23 |
| **Nexi SpA** | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.04.2026 | € | 9.550 | 7.800 | 0,38 |
| **NN Group NV** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2026 (f) | | 400 | 387 | 0,02 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 163.580 | 16.810 | 0,82 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 60.676 | 5.977 | 0,29 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 8.302 | 974 | 0,05 |
| **Nova Kreditna Banka Maribor d.d.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 27.01.2025 | € | 5.200 | 4.912 | 0,24 |
| **Nova Ljubljanska Banka d.d.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 05.02.2030 | € | 1.800 | € 1.584 | 0,08 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.10.2043 | DKK | 9.135 | 992 | 0,05 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 716.780 | 71.757 | 3,49 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 42.452 | 4.423 | 0,21 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2047 | | 4 | 1 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 156.155 | 16.886 | 0,82 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 57.610 | 6.769 | 0,33 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2053 | | 5.688 | 647 | 0,03 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2036 | | 389 | 51 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 29 | 4 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2053 | | 4.700 | 591 | 0,03 |
| 3,500 % fällig am 01.10.2053 | | 38.900 | 5.049 | 0,25 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2047 | | 67 | 8 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 96.408 | 10.144 | 0,49 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 15.000 | 1.766 | 0,09 |
| 2,500 % fällig am 01.04.2036 | | 1 | 0 | 0,00 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.09.2025 | $ | 600 | 567 | 0,03 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 15.02.2024 | € | 7.300 | 7.189 | 0,35 |
| **TP ICAP Finance PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 26.01.2024 | £ | 4.039 | 4.647 | 0,23 |
| **UBS AG** | | | | |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (h) | $ | 5.550 | 5.325 | 0,26 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 1,250 % fällig am 17.04.2025 | € | 1.600 | 1.563 | 0,08 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 1,625 % fällig am 03.07.2025 | | 7.700 | 7.399 | 0,36 |
| 3,127 % fällig am 03.06.2032 (i) | $ | 4.400 | 3.288 | 0,16 |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | | 3.400 | 3.369 | 0,16 |
| **Vonovia Finance BV** | | | | |
| 5,000 % fällig am 02.10.2023 | | 500 | 482 | 0,02 |
| | | | 546.802 | 26,60 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **Atlantia SpA** | | | | |
| 1,875 % fällig am 12.02.2028 | € | 10.150 | 7.927 | 0,39 |
| **Bacardi Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 03.07.2023 | | 1.000 | 1.007 | 0,05 |
| **Coty, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.04.2026 | | 6.800 | 6.033 | 0,29 |
| **Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide** | | | | |
| 1,625 % fällig am 09.07.2024 | | 6.000 | 5.813 | 0,28 |
| **GN Store Nord A/S** | | | | |
| 0,875 % fällig am 25.11.2024 | | 3.300 | 3.125 | 0,15 |
| **Holding d'Infrastructures de Transport SASU** | | | | |
| 1,475 % fällig am 18.01.2031 | | 4.900 | 3.986 | 0,19 |
| **Informa PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 05.07.2023 | | 5.400 | 5.314 | 0,26 |
| **IQVIA, Inc.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.09.2025 | | 2.100 | 2.021 | 0,10 |
| **Market Bidco Finco PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 04.11.2027 | | 4.600 | 3.666 | 0,18 |
| **Molnlycke Holding AB** | | | | |
| 1,750 % fällig am 28.02.2024 | | 400 | 398 | 0,02 |
| 1,875 % fällig am 28.02.2025 | | 400 | 392 | 0,02 |
| **Nissan Motor Co. Ltd.** | | | | |
| 1,940 % fällig am 15.09.2023 | | 4.400 | 4.379 | 0,21 |
| **Oracle Corp.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 01.04.2040 | $ | 2.800 | 2.006 | 0,10 |
| 3,600 % fällig am 01.04.2050 | | 3.000 | 1.999 | 0,10 |
| 3,850 % fällig am 01.04.2060 | | 1.200 | 789 | 0,04 |
| **Organon & Co.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 30.04.2028 | € | 1.000 | 840 | 0,04 |
| **Owens Corning** | | | | |
| 4,300 % fällig am 15.07.2047 | $ | 622 | 486 | 0,02 |
| **Teleperformance** | | | | |
| 1,875 % fällig am 02.07.2025 | € | 200 | 197 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Ubisoft Entertainment S.A.** | | | | | |
| 0,878 % fällig am 24.11.2027 | € | 2.300 | € | 1.900 | 0,09 |
| 1,289 % fällig am 30.01.2023 | | 4.400 | | 4.402 | 0,22 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.04.2027 | £ | 2.100 | | 2.217 | 0,11 |
| | | | | 58.897 | 2,87 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | | |
| **Electricite de France S.A.** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 01.12.2027 (f) | € | 6.600 | | 4.671 | 0,23 |
| 2,875 % fällig am 15.12.2026 (f) | | 12.800 | | 9.984 | 0,49 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.11.2022 | $ | 100 | | 96 | 0,00 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 08.02.2029 | | 2.000 | | 1.853 | 0,09 |
| | | | | 16.604 | 0,81 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | | 622.303 | 30,28 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | | |
| 1,001 % fällig am 25.07.2037 | | 5 | | 5 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.06.2036 | | 38 | | 36 | 0,00 |
| **Freddie Mac** | | | | | |
| 1,150 % fällig am 15.01.2038 | | 600 | | 571 | 0,03 |
| 1,295 % fällig am 15.01.2038 (a) | | 600 | | 32 | 0,00 |
| 2,485 % fällig am 01.09.2037 | | 1.080 | | 1.069 | 0,05 |
| 3,500 % fällig am 01.10.2047 | | 2.877 | | 2.694 | 0,13 |
| **Ginnie Mae** | | | | | |
| 1,253 % fällig am 20.08.2066 | | 7 | | 7 | 0,00 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.10.2029 - 01.08.2041 | | 690 | | 677 | 0,03 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.08.2052 | | 23.900 | | 21.275 | 1,04 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2052 | | 17.400 | | 15.992 | 0,78 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2052 | | 15.600 | | 14.719 | 0,72 |
| | | | | 57.077 | 2,78 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)** | | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.02.2051 | | 14.100 | | 10.411 | 0,50 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2048 | | 3.751 | | 3.432 | 0,17 |
| | | | | 13.843 | 0,67 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | | |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | | |
| 2,683 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 7 | | 6 | 0,00 |
| **Alba PLC** | | | | | |
| 0,962 % fällig am 25.11.2042 | £ | 307 | | 341 | 0,02 |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | | | |
| 3,562 % fällig am 25.09.2045 | $ | 0 | | 0 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.03.2047 | | 434 | | 341 | 0,02 |
| **Avon Finance PLC** | | | | | |
| 1,690 % fällig am 20.09.2048 | £ | 5.157 | | 5.961 | 0,29 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | | |
| 2,212 % fällig am 20.05.2047 | $ | 68 | | 61 | 0,00 |
| **Barley Hill PLC** | | | | | |
| 1,892 % fällig am 27.08.2058 | £ | 2.322 | | 2.666 | 0,13 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | | |
| 2,380 % fällig am 25.10.2035 | $ | 30 | | 29 | 0,00 |
| 2,913 % fällig am 25.07.2036 | | 235 | | 160 | 0,01 |
| 3,048 % fällig am 25.07.2033 | | 4 | | 4 | 0,00 |
| **Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust** | | | | | |
| 2,999 % fällig am 26.12.2046 ^ | | 72 | | 58 | 0,00 |
| **Business Mortgage Finance PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.08.2040 | € | 3 | | 3 | 0,00 |
| **Canada Square Funding PLC** | | | | | |
| 1,550 % fällig am 17.10.2051 | £ | 6.358 | | 7.379 | 0,36 |
| **Canterbury Finance PLC** | | | | | |
| 1,940 % fällig am 16.05.2057 | | 1.208 | | 1.404 | 0,07 |
| **Charter Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 1,540 % fällig am 16.01.2057 | | 2.203 | | 2.555 | 0,12 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | | | |
| 2,968 % fällig am 25.01.2036 | $ | 2.427 | | 2.105 | 0,10 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 93 | | 50 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,360 % fällig am 25.03.2034 | $ | 1 | € | 1 | 0,00 |
| 2,480 % fällig am 25.11.2035 | | 18 | | 16 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | | |
| 4,255 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 324 | | 293 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | | |
| 2,266 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 566 | | 485 | 0,02 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | | |
| 1,476 % fällig am 25.12.2035 | | 4 | | 3 | 0,00 |
| 2,044 % fällig am 25.07.2046 | | 126 | | 110 | 0,01 |
| 2,074 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 1.537 | | 931 | 0,05 |
| 2,272 % fällig am 20.11.2035 | | 296 | | 257 | 0,01 |
| 3,473 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 47 | | 41 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 25.06.2035 ^ | | 4 | | 3 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 204 | | 105 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 294 | | 174 | 0,01 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | | |
| 2,204 % fällig am 25.04.2035 | | 125 | | 105 | 0,01 |
| 2,264 % fällig am 25.03.2035 | | 155 | | 124 | 0,01 |
| 2,364 % fällig am 25.02.2035 | | 159 | | 133 | 0,01 |
| 2,592 % fällig am 25.04.2035 | | 104 | | 81 | 0,00 |
| 3,042 % fällig am 20.05.2036 ^ | | 51 | | 46 | 0,00 |
| **Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,004 % fällig am 25.08.2047 | | 3.280 | | 2.655 | 0,13 |
| **Dilosk RMBS DAC** | | | | | |
| 0,382 % fällig am 20.02.2060 | € | 3.932 | | 3.906 | 0,19 |
| 0,528 % fällig am 20.12.2060 | | 5.403 | | 5.333 | 0,26 |
| **Dutch Property Finance BV** | | | | | |
| 0,215 % fällig am 28.04.2051 | | 3.024 | | 3.016 | 0,15 |
| 0,235 % fällig am 28.07.2058 | | 3.129 | | 3.103 | 0,15 |
| 0,285 % fällig am 28.04.2059 | | 4.743 | | 4.710 | 0,23 |
| 0,320 % fällig am 28.10.2059 | | 4.600 | | 4.542 | 0,22 |
| 1,250 % fällig am 28.04.2050 | | 5.300 | | 5.274 | 0,26 |
| **European Loan Conduit DAC** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 17.02.2030 | | 5.274 | | 5.206 | 0,25 |
| **Eurosail PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 13.03.2045 | | 1.117 | | 1.098 | 0,05 |
| 1,698 % fällig am 10.12.2044 | £ | 54 | | 62 | 0,00 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | | |
| 1,565 % fällig am 16.03.2070 | | 4.388 | | 5.066 | 0,25 |
| 1,775 % fällig am 16.12.2069 | | 2.520 | | 2.915 | 0,14 |
| 1,795 % fällig am 16.09.2069 | | 2.052 | | 2.381 | 0,12 |
| 2,065 % fällig am 16.06.2070 | | 2.863 | | 3.314 | 0,16 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | | | |
| 2,801 % fällig am 25.03.2035 | $ | 33 | | 21 | 0,00 |
| **Glenbeigh Issuer DAC** | | | | | |
| 0,578 % fällig am 24.03.2046 | € | 1.375 | | 1.358 | 0,07 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 18.03.2039 | | 289 | | 285 | 0,01 |
| 1,048 % fällig am 18.06.2038 | £ | 87 | | 100 | 0,01 |
| 2,193 % fällig am 18.06.2039 | $ | 68 | | 63 | 0,00 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,867 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 4 | | 4 | 0,00 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,260 % fällig am 19.05.2033 | | 3 | | 3 | 0,00 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,703 % fällig am 25.05.2053 | £ | 12.867 | | 14.920 | 0,73 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,004 % fällig am 25.09.2046 | $ | 587 | | 505 | 0,03 |
| 2,916 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 85 | | 74 | 0,00 |
| **Jubilee Place BV** | | | | | |
| 0,552 % fällig am 17.10.2057 | € | 2.597 | | 2.564 | 0,13 |
| **Kentmere PLC** | | | | | |
| 1,305 % fällig am 28.01.2042 | £ | 1.505 | | 1.730 | 0,08 |
| **Lanebrook Mortgage Transaction PLC** | | | | | |
| 1,852 % fällig am 12.06.2057 | | 2.906 | | 3.365 | 0,16 |
| **Mansard Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,529 % fällig am 15.12.2049 | | 1.234 | | 1.403 | 0,07 |
| **MASTR Asset Securitization Trust** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 ^ | $ | 99 | | 69 | 0,00 |
| **Miravet SARL** | | | | | |
| 0,494 % fällig am 26.05.2065 | € | 5.740 | | 5.757 | 0,28 |
| **Newgate Funding PLC** | | | | | |
| 2,589 % fällig am 15.12.2050 | £ | 269 | | 299 | 0,02 |
| **Paragon Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,651 % fällig am 15.05.2045 | | 2.774 | | 3.206 | 0,16 |
| **Polaris PLC** | | | | | |
| 1,730 % fällig am 23.12.2058 | £ | 4.059 | € | 4.649 | 0,23 |
| 1,740 % fällig am 23.10.2059 | | 3.557 | | 4.077 | 0,20 |
| 2,065 % fällig am 27.05.2057 | | 4.633 | | 5.372 | 0,26 |
| **Precise Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 1,952 % fällig am 12.12.2055 | | 4.016 | | 4.643 | 0,23 |
| **Primrose Residential DAC** | | | | | |
| 0,238 % fällig am 24.03.2061 | € | 6.108 | | 6.023 | 0,29 |
| 0,488 % fällig am 24.10.2061 | | 6.113 | | 6.043 | 0,29 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.03.2047 | $ | 1.124 | | 990 | 0,05 |
| 1,984 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 1.262 | | 574 | 0,03 |
| 1,984 % fällig am 25.06.2046 | | 323 | | 78 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 50 | | 43 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 359 | | 298 | 0,01 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 | | 1.364 | | 1.098 | 0,05 |
| **Residential Mortgage Securities PLC** | | | | | |
| 2,040 % fällig am 20.06.2070 | £ | 5.180 | | 6.000 | 0,29 |
| **Resloc UK PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.12.2043 | € | 870 | | 812 | 0,04 |
| **Ripon Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,351 % fällig am 28.08.2056 | £ | 8.282 | | 9.525 | 0,46 |
| **RMAC PLC** | | | | | |
| 1,571 % fällig am 12.06.2046 | | 174 | | 200 | 0,01 |
| **RMAC Securities PLC** | | | | | |
| 1,021 % fällig am 12.06.2044 | | 67 | | 75 | 0,00 |
| 1,041 % fällig am 12.06.2044 | | 1.186 | | 1.301 | 0,06 |
| **Silverstone Master Issuer PLC** | | | | | |
| 1,216 % fällig am 21.01.2070 | | 6.831 | | 7.933 | 0,39 |
| **Southern Pacific Securities PLC** | | | | | |
| 1,838 % fällig am 10.03.2044 | | 257 | | 299 | 0,01 |
| **Stanlington PLC** | | | | | |
| 1,702 % fällig am 12.06.2056 | | 4.333 | | 4.919 | 0,24 |
| **Stratton Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2060 | | 17.230 | | 19.859 | 0,97 |
| 1,652 % fällig am 12.03.2052 | | 6.395 | | 7.339 | 0,36 |
| 1,674 % fällig am 25.09.2051 | | 4.190 | | 4.841 | 0,24 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | | |
| 1,567 % fällig am 25.02.2036 ^ | $ | 309 | | 283 | 0,01 |
| 2,004 % fällig am 25.06.2036 | | 51 | | 47 | 0,00 |
| 2,095 % fällig am 19.07.2035 | | 4 | | 3 | 0,00 |
| 2,295 % fällig am 19.12.2034 | | 76 | | 68 | 0,00 |
| 2,295 % fällig am 19.02.2035 | | 76 | | 68 | 0,00 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2045 | £ | 2.453 | | 2.846 | 0,14 |
| 1,527 % fällig am 20.05.2045 | | 8.468 | | 9.800 | 0,48 |
| 1,605 % fällig am 20.10.2051 | | 9.661 | | 11.187 | 0,54 |
| **Tower Bridge Funding PLC** | | | | | |
| 1,407 % fällig am 20.11.2063 | | 4.517 | | 5.183 | 0,25 |
| **Trinity Square PLC** | | | | | |
| 1,300 % fällig am 15.07.2059 | | 8.138 | | 9.393 | 0,46 |
| **Tudor Rose Mortgages** | | | | | |
| 1,390 % fällig am 20.06.2048 | | 4.120 | | 4.730 | 0,23 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | | |
| 2,002 % fällig am 12.12.2054 | | 6.059 | | 6.984 | 0,34 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | | |
| 3,201 % fällig am 25.05.2037 ^ | $ | 700 | | 624 | 0,03 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | | |
| 1,226 % fällig am 25.02.2047 ^ | | 2.775 | | 2.462 | 0,12 |
| **Wells Fargo Alternative Loan Trust** | | | | | |
| 3,411 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 27 | | 23 | 0,00 |
| | | | | 265.030 | 12,89 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **Accunia European CLO DAC** | | | | | |
| 0,950 % fällig am 15.07.2030 | € | 6.548 | | 6.465 | 0,31 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.07.2036 | $ | 542 | | 206 | 0,01 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | | |
| 2,329 % fällig am 25.01.2036 | | 708 | | 674 | 0,03 |
| **Aqueduct European CLO DAC** | | | | | |
| 0,640 % fällig am 20.07.2030 | € | 5.348 | | 5.271 | 0,26 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Ares European CLO DAC** | | | | | |
| 0,610 % fällig am 15.04.2030 | € | 3.217 | € | 3.154 | 0,15 |
| 0,660 % fällig am 15.10.2030 | | 4.691 | | 4.607 | 0,22 |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | | 15.300 | | 14.961 | 0,73 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.06.2037 | $ | 77 | | 62 | 0,00 |
| **Aurium CLO DAC** | | | | | |
| 0,670 % fällig am 16.04.2030 | € | 6.084 | | 5.988 | 0,29 |
| 0,730 % fällig am 16.01.2031 | | 4.600 | | 4.519 | 0,22 |
| **Auto ABS French Leases FCT** | | | | | |
| 0,149 % fällig am 29.06.2033 | | 8.900 | | 8.912 | 0,43 |
| **Bain Capital Euro DAC** | | | | | |
| 0,740 % fällig am 20.01.2032 | | 4.800 | | 4.658 | 0,23 |
| **Bavarian Sky S.A.** | | | | | |
| 0,206 % fällig am 20.05.2027 | | 2.087 | | 2.092 | 0,10 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | | |
| 3,424 % fällig am 25.07.2035 | $ | 714 | | 661 | 0,03 |
| **Black Diamond CLO DAC** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 03.10.2029 | € | 617 | | 616 | 0,03 |
| **BlueMountain Fuji EUR CLO DAC** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 15.07.2030 | | 2.929 | | 2.884 | 0,14 |
| 0,720 % fällig am 15.01.2031 | | 4.600 | | 4.482 | 0,22 |
| 0,910 % fällig am 15.01.2033 | | 2.000 | | 1.924 | 0,09 |
| 1,050 % fällig am 15.01.2031 | | 100 | | 97 | 0,01 |
| **BNPP AM Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 15.10.2031 | | 1.037 | | 1.020 | 0,05 |
| **Bridgepoint CLO DAC** | | | | | |
| 1,210 % fällig am 15.01.2034 | | 1.600 | | 1.572 | 0,08 |
| **Bumper UK Finance PLC** | | | | | |
| 1,440 % fällig am 20.12.2030 | £ | 4.137 | | 4.796 | 0,23 |
| **Cairn CLO DAC** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 20.10.2028 | € | 211 | | 210 | 0,01 |
| 0,670 % fällig am 31.01.2030 | | 4.958 | | 4.876 | 0,24 |
| 0,710 % fällig am 25.04.2032 | | 1.400 | | 1.371 | 0,07 |
| 0,790 % fällig am 25.07.2029 | | 2.756 | | 2.728 | 0,13 |
| **Carlyle Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,630 % fällig am 15.08.2030 | | 7.432 | | 7.286 | 0,35 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,730 % fällig am 25.01.2032 | | 5.000 | | 4.889 | 0,24 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.11.2031 | | 4.600 | | 4.519 | 0,22 |
| **Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC** | | | | | |
| 0,284 % fällig am 15.12.2029 | | 4.737 | | 4.746 | 0,23 |
| **Compartment VCL** | | | | | |
| 0,213 % fällig am 21.01.2028 | | 3.647 | | 3.665 | 0,18 |
| **Contego CLO BV** | | | | | |
| 0,770 % fällig am 15.10.2030 | | 3.750 | | 3.670 | 0,18 |
| **Contego CLO DAC** | | | | | |
| 0,640 % fällig am 23.01.2030 | | 4.595 | | 4.518 | 0,22 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.06.2035 | $ | 4.385 | | 3.907 | 0,19 |
| 1,844 % fällig am 25.06.2047 | | 3.628 | | 3.333 | 0,16 |
| 1,884 % fällig am 25.11.2037 | | 2.100 | | 1.869 | 0,09 |
| 2,464 % fällig am 25.10.2047 | | 1.325 | | 1.223 | 0,06 |
| 4,444 % fällig am 25.07.2036 | | 88 | | 80 | 0,00 |
| **CVC Cordatus Loan Fund DAC** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 21.07.2030 | € | 23.129 | | 22.830 | 1,11 |
| 0,650 % fällig am 15.10.2031 | | 3.400 | | 3.319 | 0,16 |
| 0,780 % fällig am 15.08.2032 | | 3.300 | | 3.232 | 0,16 |
| **Ellington Loan Acquisition Trust** | | | | | |
| 2,674 % fällig am 25.05.2037 | $ | 3.017 | | 2.818 | 0,14 |
| **FACT Master S.A.** | | | | | |
| 0,002 % fällig am 20.11.2025 | € | 889 | | 888 | 0,04 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.11.2036 | $ | 192 | | 181 | 0,01 |
| **Grosvenor Place CLO BV** | | | | | |
| 0,720 % fällig am 30.10.2029 | € | 1.813 | | 1.805 | 0,09 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | | 605 | | 603 | 0,03 |
| 0,640 % fällig am 15.10.2031 | | 5.600 | | 5.470 | 0,27 |
| 0,650 % fällig am 26.06.2030 | | 5.642 | | 5.546 | 0,27 |
| 0,680 % fällig am 20.10.2031 | | 4.300 | | 4.197 | 0,20 |
| 0,760 % fällig am 15.07.2031 | | 5.400 | | 5.200 | 0,25 |
| 0,850 % fällig am 15.01.2032 | | 8.300 | | 8.079 | 0,39 |
| **Invesco Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 15.07.2031 | | 1.550 | | 1.505 | 0,07 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | | |
| 1,894 % fällig am 25.07.2036 | $ | 84 | € | 68 | 0,00 |
| **Jubilee CLO DAC** | | | | | |
| 0,391 % fällig am 12.07.2028 | € | 588 | | 589 | 0,03 |
| 0,519 % fällig am 15.12.2029 | | 5.688 | | 5.627 | 0,27 |
| **Laurelin DAC** | | | | | |
| 0,720 % fällig am 20.10.2031 | | 6.000 | | 5.880 | 0,29 |
| **Lehman XS Trust** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 25.06.2046 | $ | 2.503 | | 2.084 | 0,10 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.05.2036 | | 2.161 | | 1.262 | 0,06 |
| 1,924 % fällig am 25.06.2036 | | 4.924 | | 2.579 | 0,13 |
| **Madison Park Euro Funding DAC** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.01.2032 | € | 7.900 | | 7.650 | 0,37 |
| **Man GLG Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,680 % fällig am 15.10.2030 | | 3.088 | | 3.025 | 0,15 |
| 0,810 % fällig am 15.10.2032 | | 4.300 | | 4.217 | 0,21 |
| 0,870 % fällig am 15.01.2030 | | 7.320 | | 7.251 | 0,35 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.10.2036 | $ | 3.096 | | 1.063 | 0,05 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | | |
| 1,874 % fällig am 25.07.2036 | | 376 | | 305 | 0,02 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.12.2036 | | 2.889 | | 1.503 | 0,07 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.07.2036 | | 569 | | 501 | 0,02 |
| 2,239 % fällig am 25.02.2036 | | 8 | | 7 | 0,00 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | | |
| 1,824 % fällig am 25.09.2037 | | 566 | | 523 | 0,03 |
| 2,329 % fällig am 25.01.2036 | | 169 | | 161 | 0,01 |
| **OCP Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,820 % fällig am 15.01.2032 | € | 4.150 | | 4.094 | 0,20 |
| 0,880 % fällig am 22.09.2034 | | 5.600 | | 5.421 | 0,26 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** | | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.10.2031 | | 7.500 | | 7.347 | 0,36 |
| **PBD Germany Auto Lease Master S.A., Compartment** | | | | | |
| 0,188 % fällig am 26.11.2030 | | 3.300 | | 3.302 | 0,16 |
| **PCL Funding PLC** | | | | | |
| 1,990 % fällig am 15.09.2024 | £ | 3.700 | | 4.297 | 0,21 |
| **Pepper Iberia Unsecured DAC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 07.04.2028 | € | 110 | | 110 | 0,01 |
| **Purple Master Credit Cards** | | | | | |
| 0,172 % fällig am 25.05.2034 | | 6.300 | | 6.296 | 0,31 |
| **Sculptor European CLO DAC** | | | | | |
| 0,790 % fällig am 14.01.2032 | | 4.600 | | 4.441 | 0,22 |
| **Silver Arrow Merfina SRL** | | | | | |
| 0,206 % fällig am 20.07.2033 | | 6.161 | | 6.167 | 0,30 |
| **Silver Arrow S.A.** | | | | | |
| 0,164 % fällig am 15.02.2027 | | 1.122 | | 1.125 | 0,06 |
| 0,206 % fällig am 20.11.2030 | | 594 | | 595 | 0,03 |
| **SLC Student Loan Trust** | | | | | |
| 2,399 % fällig am 25.11.2042 | $ | 981 | | 930 | 0,05 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.10.2039 | € | 519 | | 497 | 0,02 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | | |
| 2,124 % fällig am 25.10.2036 | $ | 5.617 | | 5.162 | 0,25 |
| **Tikehau CLO BV** | | | | | |
| 0,870 % fällig am 04.08.2034 | € | 4.000 | | 3.900 | 0,19 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | | |
| 0,920 % fällig am 12.01.2032 | | 3.900 | | 3.788 | 0,18 |
| **Turbo Finance 9 PLC** | | | | | |
| 1,770 % fällig am 20.08.2028 | £ | 3.111 | | 3.615 | 0,18 |
| **Voya Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.10.2030 | € | 3.200 | | 3.148 | 0,15 |
| | | | | 306.714 | 14,92 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Agence Francaise de Developpement** | | | | | |
| 0,125 % fällig am 29.09.2031 | | 2.200 | | 1.833 | 0,09 |
| **Auckland Council** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 19.01.2027 | | 1.300 | | 1.257 | 0,06 |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | | |
| 4,220 % fällig am 26.04.2035 | | 1.600 | | 1.731 | 0,08 |
| **Belgium Government International Bond** | | | | | |
| 1,400 % fällig am 22.06.2053 | | 21.500 | | 15.821 | 0,77 |
| 1,600 % fällig am 22.06.2047 | | 18.000 | | 14.682 | 0,72 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Caisse Francaise de Financement Local** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.02.2025 | € | 9.600 | € | 9.555 | 0,47 |
| **France Government International Bond** | | | | | |
| 0,100 % fällig am 25.07.2031 | | 20.882 | | 21.816 | 1,06 |
| 0,100 % fällig am 25.07.2038 | | 9.339 | | 9.290 | 0,45 |
| 0,500 % fällig am 25.05.2072 | | 6.700 | | 2.948 | 0,14 |
| 0,750 % fällig am 25.05.2052 | | 3.900 | | 2.478 | 0,12 |
| **Israel Government International Bond** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 31.07.2022 | ILS | 5.350 | | 1.461 | 0,07 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.05.2033 | € | 2.875 | | 2.491 | 0,12 |
| 0,400 % fällig am 15.05.2030 | | 7.316 | | 6.975 | 0,34 |
| 1,300 % fällig am 15.05.2028 | | 13.497 | | 14.065 | 0,69 |
| 2,150 % fällig am 01.09.2052 | | 19.000 | | 13.788 | 0,67 |
| 2,800 % fällig am 01.03.2067 | | 21.300 | | 17.069 | 0,83 |
| 3,850 % fällig am 01.09.2049 | | 10.500 | | 10.908 | 0,53 |
| **Korea Housing Finance Corp.** | | | | | |
| 0,723 % fällig am 22.03.2025 | | 4.500 | | 4.384 | 0,21 |
| **Mexico Government International Bond** | | | | | |
| 2,659 % fällig am 24.05.2031 | $ | 9.700 | | 7.659 | 0,37 |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.08.2050 (c)(j) | € | 4.200 | | 2.693 | 0,13 |
| **Romania Government International Bond** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 28.01.2032 | | 7.700 | | 5.272 | 0,26 |
| **Slovenia Government International Bond** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 06.03.2028 | | 12.200 | | 11.794 | 0,57 |
| 1,175 % fällig am 13.02.2062 | | 8.410 | | 5.159 | 0,25 |
| 3,125 % fällig am 07.08.2045 | | 7.000 | | 7.466 | 0,36 |
| 5,250 % fällig am 18.02.2024 | $ | 21.451 | | 20.989 | 1,02 |
| **South Korea Government International Bond** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 16.09.2025 (c) | € | 4.400 | | 4.177 | 0,20 |
| **Spain Government International Bond** | | | | | |
| 0,100 % fällig am 30.04.2031 | | 3.600 | | 2.974 | 0,15 |
| 1,250 % fällig am 31.10.2030 | | 9.400 | | 8.722 | 0,43 |
| 1,400 % fällig am 30.07.2028 | | 19.200 | | 18.662 | 0,91 |
| 1,450 % fällig am 31.10.2027 | | 23.300 | | 22.890 | 1,11 |
| 1,900 % fällig am 31.10.2052 | | 19.200 | | 14.440 | 0,70 |
| 1,950 % fällig am 30.04.2026 | | 4.600 | | 4.670 | 0,23 |
| 2,150 % fällig am 31.10.2025 | | 80.100 | | 82.178 | 4,00 |
| 3,450 % fällig am 30.07.2066 | | 15.200 | | 15.831 | 0,77 |
| | | | | 388.128 | 18,88 |
| | | **AKTIEN** | | | |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | | | |
| **Nationwide Building Society** | | | | | |
| 10,250 % | | 9.139 | | 1.555 | 0,08 |
| | | **PARI (000S)** | | | |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | | |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | | | |
| **Acciona Energia Financiacion Filiales S.A.** | | | | | |
| 0,010 % fällig am 27.07.2022 | € | 6.000 | | 6.000 | 0,29 |
| **Fiserv, Inc.** | | | | | |
| (0,152) % fällig am 18.08.2022 | | 4.900 | | 4.900 | 0,24 |
| **SGS Nederland Holding BV** | | | | | |
| (0,101) % fällig am 25.07.2022 | | 10.200 | | 10.202 | 0,50 |
| | | | | 21.102 | 1,03 |
| **TREASURY BILLS DES EUROPÄISCHEN STABILITÄTSMECHANISMUS** | | | | | |
| (0,365) % fällig am 08.09.2022 (c)(d) | | 5.100 | | 5.103 | 0,25 |
| **EUROPEAN UNION TREASURY BILLS** | | | | | |
| (0,607) % fällig am 08.07.2022 (c)(d) | | 2.600 | | 2.600 | 0,13 |
| (0,542) % fällig am 05.08.2022 (c)(d) | | 5.100 | | 5.102 | 0,25 |
| (0,390) % fällig am 09.09.2022 (c)(d) | | 5.400 | | 5.403 | 0,26 |
| (0,289) % fällig am 07.10.2022 (c)(d) | | 2.500 | | 2.502 | 0,12 |
| | | | | 15.607 | 0,76 |
| **ISRAEL TREASURY BILLS** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 07.12.2022 (c)(d) | ILS | 1.800 | | 490 | 0,02 |
| 0,001 % fällig am 04.01.2023 (c)(d) | | 4.000 | | 1.087 | 0,05 |
| 0,014 % fällig am 02.11.2022 (c)(d) | | 4.600 | | 1.254 | 0,06 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| 0,022 % fällig am 04.01.2023 (c)(d) | ILS | 10.300 | € | 2.800 | 0,14 |
| 0,156 % fällig am 04.01.2023 (c)(d) | | 2.600 | | 707 | 0,04 |
| | | | | 6.338 | 0,31 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | | 48.150 | 2,35 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **€** | **1.702.997** | **82,86** |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (g) | 2.094.700 | € | 199.876 | 9,72 |
| **Summe Investmentfonds** | | **€** | **199.876** | **9,72** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | (1,900) % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | € 7.600 | Republic of Germany 2,500 % fällig am 04.07.2044 | € (7.663) | € 7.600 | € 7.600 | 0,37 |
| | (1,300) | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 58.500 | Societe Nationale SNCF S.A. 4,150 % fällig am 18.01.2042 | (60.442) | 58.500 | 58.498 | 2,85 |
| BRC | (0,500) | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 32.400 | Nordea Bank Abp 0,000 % fällig am 29.07.2022 - 03.10.2022 | (31.000) | 32.400 | 32.400 | 1,57 |
| | | | | | Toronto-Dominion Bank 0,000 % fällig am 27.12.2022 | (3.000) | | | |
| FICC | 0,400 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 387 | U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | (378) | 370 | 370 | 0,02 |
| RYL | (1,750) | 30.06.2022 | 01.07.2022 | € 31.100 | Belgium Government International Bond 1,400 % - 1,700 % fällig am 22.06.2050 - 22.06.2053 | (31.820) | 31.100 | 31.098 | 1,51 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **€ (134.303)** | **€ 129.970** | **€ 129.966** | **6,32** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month Euribor March Futures | Long | 03.2023 | 1.046 | € (4.406) | (0,21) |
| 3-Month SOFR December Futures | Long | 03.2023 | 1.103 | 218 | 0,01 |
| 3-Month SOFR March Futures | Short | 06.2023 | 1.103 | (298) | (0,01) |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 144.500 EUR auf Euro-Bund August 2022 Futures[1] | Short | 07.2022 | 161 | (394) | (0,02) |
| Euro-Bobl September Futures | Long | 09.2022 | 3.651 | 2.333 | 0,11 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Long | 09.2022 | 72 | 451 | 0,02 |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 1.373 | (581) | (0,03) |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 148 | (1.618) | (0,08) |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 1.566 | (2.753) | (0,13) |
| Euro-Schatz September Futures | Long | 09.2022 | 2.141 | (251) | (0,01) |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 140 | (116) | (0,01) |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 144.500 EUR auf August 2022 Futures[1] | Short | 07.2022 | 161 | 228 | 0,01 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 68 | 81 | 0,01 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 1.603 | 914 | 0,05 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 879 | (1.402) | (0,07) |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2022 | 662 | 1.498 | 0,07 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 52 | (76) | 0,00 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2022 | 317 | 1.718 | 0,08 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09.2022 | 591 | 2.937 | 0,14 |
| | | | | € (1.517) | (0,07) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **€ (1.517)** | **(0,07)** |

[1] Future-Style-Option.

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Barclays Bank PLC | 1,000 % | 20.12.2022 | € 2.300 | € (9) | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.12.2027 | 100 | (2) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.12.2022 | $ 200 | (24) | 0,00 |
| | | | | € (35) | 0,00 |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 % | 21.09.2027 | £ 28.600 | € (1.898) | (0,09) |
| Zahlung[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2032 | 33.800 | (2.700) | (0,13) |
| Zahlung[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2052 | 1.190 | (392) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 1,600 | 18.05.2032 | 20.700 | (1.388) | (0,07) |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 16.06.2029 | ¥ 7.571.000 | (198) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,435 | 20.06.2029 | 2.729.000 | (126) | (0,01) |
| Zahlung[3] | 3-Month EUR-EURIBOR | 0,526 | 21.11.2023 | € 124.100 | (2.469) | (0,12) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,880 | 25.01.2052 | $ 11.900 | (2.256) | (0,11) |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 17.03.2036 | € 20.400 | 4.964 | 0,24 |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2027 | 4.200 | (210) | (0,01) |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | 273.700 | (23.602) | (1,15) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2052 | 31.900 | (851) | (0,04) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 12.04.2027 | 12.900 | (570) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 11.05.2027 | 11.500 | (508) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,700 | 11.04.2027 | 7.500 | (317) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 13.05.2027 | 9.700 | (301) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.05.2027 | 2.200 | (69) | 0,00 |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 2,250 | 21.09.2037 | 63.000 | 1.507 | 0,07 |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 2,250 | 21.09.2042 | 21.400 | 572 | 0,03 |
| Zahlung | CPTFEMU | 1,380 | 15.03.2031 | 28.500 | (4.702) | (0,23) |
| Zahlung | CPTFEMU | 2,421 | 15.05.2052 | 990 | (17) | 0,00 |
| Zahlung | CPTFEMU | 2,488 | 15.05.2037 | 6.880 | (11) | 0,00 |
| Erhalt | CPTFEMU | 2,600 | 15.05.2032 | 4.500 | (41) | 0,00 |
| Erhalt | CPTFEMU | 2,720 | 15.06.2032 | 6.600 | (195) | (0,01) |
| Zahlung | UKRPI | 3,400 | 15.12.2024 | £ 44.600 | (5.825) | (0,28) |
| Zahlung | UKRPI | 3,473 | 15.08.2025 | 24.200 | (3.521) | (0,17) |
| Zahlung | UKRPI | 3,513 | 15.12.2029 | 13.100 | (1.905) | (0,09) |
| Erhalt | UKRPI | 4,410 | 15.08.2022 | 45.000 | 3.934 | 0,19 |
| Erhalt | UKRPI | 4,535 | 15.10.2022 | 17.500 | 1.639 | 0,08 |
| Erhalt | UKRPI | 4,560 | 15.09.2023 | 9.200 | 982 | 0,05 |
| Erhalt | UKRPI | 4,900 | 15.05.2023 | 12.800 | 1.516 | 0,07 |
| Erhalt | UKRPI | 5,360 | 15.11.2023 | 21.700 | 1.776 | 0,09 |
| | | | | | € (37.182) | (1,81) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **€ (37.217)** | **(1,81)** |

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

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

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

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

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

## OPTIONSKAUF

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Kosten | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,195 % | 02.11.2022 | 11.660 | € 8 | € 4.758 | 0,23 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,000 | 15.03.2023 | 10.600 | 990 | 4.786 | 0,23 |
| BRC | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,410 | 02.02.2023 | 133.600 | 591 | 108 | 0,01 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,197 | 04.11.2022 | 6.760 | 426 | 2.756 | 0,13 |
| CBK | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,720 | 23.02.2023 | 27.600 | 134 | 45 | 0,00 |
| GLM | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,200 | 26.04.2023 | 22.500 | 228 | 218 | 0,01 |
| JPM | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,710 | 25.01.2023 | 29.400 | 158 | 37 | 0,00 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,000 | 15.03.2023 | 8.500 | 773 | 3.837 | 0,19 |
| MYC | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,428 | 31.01.2023 | 133.200 | 607 | 108 | 0,01 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,200 | 31.05.2023 | 63.600 | 724 | 682 | 0,03 |
| | | | | | | | € 4.639 | € 17.335 | 0,84 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,175 % | 15.03.2023 | 31.800 | € (967) | € (7.307) | (0,36) |
| BRC | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,558 | 02.02.2023 | 29.200 | (591) | (70) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,000 | 04.11.2022 | 20.310 | (420) | (4.244) | (0,21) |
| CBK | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,736 | 23.02.2023 | 6.100 | (133) | (25) | 0,00 |

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| DUB | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,350 % | 08.08.2022 | 5.200 | € (18) | € 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,550 | 08.08.2022 | 5.200 | (18) | (99) | 0,00 |
| GLM | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,350 | 26.04.2023 | 12.400 | (232) | (201) | (0,01) |
| JPM | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,785 | 25.01.2023 | 6.500 | (158) | (24) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,175 | 15.03.2023 | 25.500 | (760) | (5.859) | (0,29) |
| MYC | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,579 | 31.01.2023 | 29.100 | (607) | (71) | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,350 | 31.05.2023 | 35.000 | (723) | (621) | (0,03) |
| | | | | | | | € (4.627) | € (18.521) | (0,90) |

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPM | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 3,500 % fällig am 01.08.2052 | $ 96,906 | 04.08.2022 | 2.100 | € (10) | € (26) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,156 | 07.09.2022 | 5.800 | (19) | (37) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,656 | 07.09.2022 | 9.700 | (34) | (77) | (0,01) |
| | | | | | € (63) | € (140) | (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 | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Gezahlte/(erhaltene) Abschluss-prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 200 | € (8) | € 5 | € (3) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 16.800 | (655) | 340 | (315) | (0,02) |
| | | | | | € (663) | € 345 | € (318) | (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 | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | € | 8.094 | DKK | 60.205 | € 1 | € 0 | € 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.559 | £ | 1.327 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 11.006 | NOK | 111.840 | 0 | (201) | (201) | (0,01) |
| | 08.2022 | MXN | 299 | $ | 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | DKK | 37.740 | € | 5.072 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 68.728 | DKK | 511.220 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 221.998 | $ | 233.593 | 1.439 | 0 | 1.439 | 0,07 |
| | 07.2022 | $ | 6.120 | € | 5.771 | 0 | (83) | (83) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 4.660 | £ | 4.022 | 3 | (1) | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | £ | 231.536 | € | 274.284 | 5.907 | 0 | 5.907 | 0,29 |
| | 08.2022 | IDR | 881.471 | $ | 60 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 218.605 | € | 207.460 | 0 | (1.255) | (1.255) | (0,06) |
| BRC | 07.2022 | DKK | 143.225 | | 19.248 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 18.810 | DKK | 139.966 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.552 | $ | 1.644 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 08.2022 | CHF | 11.249 | € | 11.066 | 0 | (172) | (172) | (0,01) |
| | 08.2022 | DKK | 139.962 | | 18.810 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 11.383 | AUD | 17.038 | 0 | (205) | (205) | (0,01) |
| | 08.2022 | IDR | 969.814 | $ | 66 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 718.000 | € | 5.056 | 17 | (15) | 2 | 0,00 |
| | 11.2022 | ILS | 4.600 | $ | 1.441 | 110 | 0 | 110 | 0,01 |
| CBK | 08.2022 | | 4.869 | | 1.473 | 77 | 0 | 77 | 0,00 |
| | 01.2023 | | 16.894 | | 5.359 | 443 | 0 | 443 | 0,02 |
| DUB | 07.2022 | DKK | 1.418.686 | € | 190.667 | 0 | (103) | (103) | (0,01) |
| | 07.2022 | PLN | 236 | $ | 54 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 12.2022 | ILS | 1.800 | | 568 | 46 | 0 | 46 | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | DKK | 19.820 | € | 2.663 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 138.226 | DKK | 1.028.400 | 62 | 0 | 62 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 16.705 | $ | 2.484 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 796.546 | € | 107.055 | 0 | (59) | (59) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 6.960 | £ | 5.992 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 1.288.453 | $ | 88 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | ILS | 558 | | 172 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 08.2022 | KRW | 75.848 | | 60 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | € | 7.410 | DKK | 55.120 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 38.000 | $ | 5.659 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 1.354 | £ | 1.156 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 08.2022 | £ | 881 | € | 1.029 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 566.804 | $ | 39 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 05.2023 | CNH | 19.033 | | 2.836 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYI | 07.2022 | DKK | 337.462 | € | 45.363 | € 0 | € (15) | € (15) | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 11.277 | $ | 11.932 | 136 | 0 | 136 | 0,01 |
| | 08.2022 | CNY | 273 | | 41 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 1.090.992 | | 74 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | KRW | 98.170 | | 77 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| RBC | 08.2022 | € | 2.799 | £ | 2.403 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.133 | ¥ | 160.100 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | | 447 | DKK | 3.325 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 10.969 | CHF | 11.451 | 470 | 0 | 470 | 0,02 |
| | 08.2022 | £ | 513 | € | 596 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | ILS | 75 | $ | 22 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 67.407 | | 10.063 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNY | 437 | | 65 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 6.520 | £ | 5.579 | 0 | (54) | (54) | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | $ | 246.192 | € | 229.057 | 0 | (6.433) | (6.433) | (0,31) |
| | 08.2022 | € | 1.004 | £ | 875 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | | 21.296 | DKK | 158.446 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 1.652 | € | 1.111 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 158.439 | | 21.296 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 10.2022 | $ | 444 | MXN | 9.083 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | | | | | | € 8.851 | € (8.722) | € 129 | 0,01 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 07.2022 | € | 90.163 | CHF | 92.577 | € 2.334 | € 0 | € 2.334 | 0,11 |
| DUB | 07.2022 | | 24 | | 25 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | CHF | 3.215 | € | 3.150 | 0 | (63) | (63) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | € | 17 | CHF | 18 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | | 76.130 | | 78.287 | 2.089 | 0 | 2.089 | 0,10 |
| SCX | 07.2022 | CHF | 308 | € | 304 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 88.416 | CHF | 90.912 | 2.418 | 0 | 2.418 | 0,12 |
| SOG | 07.2022 | | 76.132 | | 78.287 | 2.086 | 0 | 2.086 | 0,10 |
| UAG | 07.2022 | CHF | 2.360 | € | 2.271 | 0 | (87) | (87) | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 40 | CHF | 42 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | | | | | | € 8.931 | € (154) | € 8.777 | 0,43 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **€ 7.262** | **0,35** |
| **Summe Anlagen** | **€ 2.001.371** | **97,37** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **€ 54.032** | **2,63** |
| **Nettovermögen** | **€ 2.055.403** | **100,00** |

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

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

**(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

**(b) Wertpapier per Emissionstermin.**

**(c) Nullkuponwertpapier.**

**(d) Der 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 wurde zum 30. Juni 2022 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von EUR 523 als Sicherheiten verpfändet.**

**(j) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 2.692 und Barmittel in Höhe von EUR 5.857 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von EUR 44.444 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 0 | € 1.702.997 | € 0 | € 1.702.997 |
| Investmentfonds | 199.876 | 0 | 0 | 199.876 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 129.970 | 0 | 129.970 |
| Finanzderivate[3] | (4.170) | (27.302) | 0 | (31.472) |
| **Summen** | **€ 195.706** | **€ 1.805.665** | **€ 0** | **€ 2.001.371** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 0 | € 2.354.423 | € 0 | € 2.354.423 |
| Investmentfonds | 0 | 167.438 | 0 | 167.438 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 24.716 | 0 | 24.716 |
| Finanzderivate[3] | (10.991) | (22.207) | 0 | (33.198) |
| **Summen** | **€ (10.991)** | **€ 2.524.370** | **€ 0** | **€ 2.513.379** |

(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 2022:**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| FBF | 0,300 % | 13.05.2022 | TBD[1] | $ (584) | € (558) | (0,03) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **€ (558)** | **(0,03)** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | € (221) | € 374 | € 153 |
| BPS | 10.594 | (11.670) | (1.076) |
| BRC | (1.705) | 1.721 | 16 |
| CBK | 540 | (470) | 70 |
| DUB | (153) | 123 | (30) |
| GLM | 17 | 0 | 17 |
| GST | (318) | 325 | 8 |
| JPM | (2.154) | 2.357 | 203 |
| MBC | (79) | 0 | (79) |
| MYC | 98 | (1.270) | (1.172) |
| MYI | 124 | (3) | 121 |
| RBC | (19) | 0 | (19) |
| RYL | 2.560 | (2.720) | (160) |
| SCX | 2.374 | (2.500) | (126) |
| SOG | (4.337) | 3.649 | (688) |
| UAG | (59) | 0 | (59) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 74,18 | 87,11 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 7,20 | 4,14 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 1,48 | 0,22 |
| Investmentfonds | 9,72 | 6,50 |
| Pensionsgeschäfte | 6,32 | 0,96 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,07) | (0,46) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (1,81) | (0,51) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,35 | (0,32) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (0,03) | k. A. |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 0,01 | 0,01 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 30,28 | 35,59 |
| US-Regierungsbehörden | 2,78 | 0,30 |
| US-Schatzobligationen | 0,67 | 3,32 |
| Non-Agency-MBS | 12,89 | 10,40 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 14,92 | 11,76 |
| Staatsemissionen | 18,88 | 26,92 |
| Vorzugswertpapiere | 0,08 | 0,08 |
| Kurzfristige Instrumente | 2,35 | 3,09 |
| Investmentfonds | 9,72 | 6,50 |
| Pensionsgeschäfte | 6,32 | 0,96 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,07) | (0,46) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,00 | 0,00 |
| Zinsswaps | (1,81) | (0,51) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoptionen | 0,84 | 0,35 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | k. A. | 0,00 |
| Devisenoptionen | k. A. | (0,01) |
| Zinsswapoptionen | (0,90) | (0,68) |
| Optionen auf Wertpapiere | (0,01) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,02) | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | 0,01 | (0,02) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,43 | 0,04 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 2,63 | 2,36 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Altice France S.A.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 02.02.2026 (a) | € | 4.801 | € 4.355 | 0,54 |
| 5,411 % fällig am 14.08.2026 (a) | $ | 484 | 423 | 0,05 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 3,420 % fällig am 01.02.2027 (a) | | 3.317 | 3.035 | 0,38 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | |
| 3,374 % fällig am 22.06.2026 (a) | | 3.240 | 2.976 | 0,37 |
| **INEOS Finance PLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.04.2024 (a) | € | 4.712 | 4.511 | 0,56 |
| | | | 15.300 | 1,90 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | |
| 2,375 % fällig am 01.06.2027 | | 6.200 | 5.965 | 0,74 |
| **Acef Holding S.C.A.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 14.06.2028 | | 400 | 322 | 0,04 |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 14.08.2024 | $ | 1.800 | 1.642 | 0,20 |
| **alstria office REIT-AG** | | | | |
| 1,500 % fällig am 23.06.2026 | € | 600 | 512 | 0,06 |
| **Altarea S.C.A.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 17.01.2028 | | 7.200 | 5.738 | 0,71 |
| **Altareit S.C.A.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 02.07.2025 | | 100 | 91 | 0,01 |
| **Argan S.A.** | | | | |
| 1,011 % fällig am 17.11.2026 | | 400 | 327 | 0,04 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 16.07.2026 (a) | | 1.300 | 1.057 | 0,13 |
| 0,375 % fällig am 15.04.2027 | | 900 | 703 | 0,09 |
| 1,450 % fällig am 09.07.2028 | | 100 | 78 | 0,01 |
| 1,500 % fällig am 28.05.2026 | | 4.100 | 3.561 | 0,44 |
| **Ascendas Real Estate Investment Trust** | | | | |
| 0,750 % fällig am 23.06.2028 | | 100 | 80 | 0,01 |
| **ASR Nederland NV** | | | | |
| 5,000 % fällig am 30.09.2024 (c) | | 1.700 | 1.689 | 0,21 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 11.09.2025 | | 2.900 | 2.658 | 0,33 |
| 3,625 % fällig am 17.10.2022 | | 840 | 835 | 0,10 |
| **Atrium Finance Issuer BV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.09.2027 | | 2.860 | 2.315 | 0,29 |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | |
| 2,528 % fällig am 18.11.2027 | $ | 172 | 134 | 0,02 |
| 2,875 % fällig am 15.02.2025 | | 800 | 705 | 0,09 |
| 3,950 % fällig am 01.07.2024 | | 100 | 92 | 0,01 |
| **Balder Finland Oyj** | | | | |
| 1,000 % fällig am 18.01.2027 | € | 1.200 | 874 | 0,11 |
| 1,000 % fällig am 20.01.2029 | | 2.400 | 1.515 | 0,19 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 2,625 % fällig am 28.04.2025 | | 4.800 | 4.264 | 0,53 |
| 3,625 % fällig am 24.09.2024 | | 700 | 648 | 0,08 |
| **Banco de Sabadell S.A.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 27.03.2025 | | 100 | 92 | 0,01 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,808 % fällig am 09.05.2026 | | 600 | 567 | 0,07 |
| 1,776 % fällig am 04.05.2027 | | 1.000 | 955 | 0,12 |
| **Bank of Ireland Group PLC** | | | | |
| 1,000 % fällig am 25.11.2025 | | 2.600 | 2.456 | 0,31 |
| **Banque Federative du Credit Mutuel S.A.** | | | | |
| 0,625 % fällig am 19.11.2027 | | 15.400 | 13.364 | 1,66 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 0,577 % fällig am 09.08.2029 | | 10.500 | 8.562 | 1,07 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 0,250 % fällig am 13.04.2027 | | 9.000 | 8.037 | 1,00 |
| 0,500 % fällig am 04.06.2026 | | 5.400 | 5.032 | 0,63 |
| 1,323 % fällig am 13.01.2027 | $ | 700 | 593 | 0,07 |
| 1,904 % fällig am 30.09.2028 | | 1.200 | 982 | 0,12 |
| 2,125 % fällig am 23.01.2027 | € | 1.100 | 1.058 | 0,13 |
| 4,400 % fällig am 14.08.2028 | $ | 1.000 | 916 | 0,11 |
| 4,705 % fällig am 10.01.2025 | | 9.700 | 9.281 | 1,15 |
| 5,198 % fällig am 10.01.2030 | | 500 | 478 | 0,06 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 15.09.2027 | € | 8.400 | 7.470 | 0,93 |
| 1,000 % fällig am 01.04.2025 | | 8.900 | 8.497 | 1,06 |
| **Castellum Helsinki Finance Holding Abp** | | | | |
| 0,875 % fällig am 17.09.2029 | € | 800 | € 545 | 0,07 |
| **CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund** | | | | |
| 0,500 % fällig am 27.01.2028 | | 500 | 414 | 0,05 |
| 0,900 % fällig am 12.10.2029 | | 2.300 | 1.822 | 0,23 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 17.01.2023 | $ | 200 | 169 | 0,02 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 27.01.2031 | € | 6.900 | 4.588 | 0,57 |
| 1,625 % fällig am 23.04.2027 | | 700 | 560 | 0,07 |
| 2,750 % fällig am 12.05.2026 | | 800 | 713 | 0,09 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 1,907 % fällig am 16.06.2026 | $ | 3.200 | 2.819 | 0,35 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 1,250 % fällig am 17.07.2025 | € | 8.500 | 8.087 | 1,01 |
| 2,997 % fällig am 14.12.2023 | $ | 3.150 | 2.994 | 0,37 |
| 3,869 % fällig am 12.01.2029 | | 2.100 | 1.807 | 0,23 |
| 4,194 % fällig am 01.04.2031 | | 400 | 339 | 0,04 |
| 4,282 % fällig am 09.01.2028 | | 6.000 | 5.363 | 0,67 |
| **Cromwell Ereit Lux Finco SARL** | | | | |
| 2,125 % fällig am 19.11.2025 | € | 5.600 | 4.584 | 0,57 |
| **CTP NV** | | | | |
| 0,625 % fällig am 27.09.2026 | | 600 | 479 | 0,06 |
| 0,875 % fällig am 20.01.2026 | | 3.100 | 2.596 | 0,32 |
| 1,250 % fällig am 21.06.2029 | | 1.400 | 978 | 0,12 |
| **Dell Bank International DAC** | | | | |
| 0,500 % fällig am 27.10.2026 | | 1.900 | 1.723 | 0,21 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,750 % fällig am 17.02.2027 | | 4.600 | 4.072 | 0,51 |
| 1,375 % fällig am 03.09.2026 | | 2.100 | 1.954 | 0,24 |
| 1,625 % fällig am 20.01.2027 | | 5.900 | 5.291 | 0,66 |
| 1,750 % fällig am 17.01.2028 | | 2.700 | 2.357 | 0,29 |
| 2,129 % fällig am 24.11.2026 (f) | $ | 400 | 340 | 0,04 |
| 2,222 % fällig am 18.09.2024 | | 2.700 | 2.492 | 0,31 |
| 2,552 % fällig am 07.01.2028 | | 200 | 166 | 0,02 |
| 2,625 % fällig am 12.02.2026 | € | 2.000 | 1.925 | 0,24 |
| **Digital Euro Finco LLC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.04.2024 | | 2.600 | 2.589 | 0,32 |
| **Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.11.2024 | $ | 57 | 54 | 0,01 |
| **EQT AB** | | | | |
| 2,375 % fällig am 06.04.2028 | € | 700 | 639 | 0,08 |
| **Equitable Financial Life Global Funding** | | | | |
| 0,600 % fällig am 16.06.2028 | | 3.900 | 3.380 | 0,42 |
| **Euroclear Bank S.A.** | | | | |
| 0,125 % fällig am 07.07.2025 | | 2.200 | 2.079 | 0,26 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028 | | 10.400 | 9.635 | 1,20 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 0,092 % fällig am 07.12.2022 | | 1.100 | 1.092 | 0,14 |
| 0,346 % fällig am 01.12.2024 | | 200 | 187 | 0,02 |
| 2,386 % fällig am 17.02.2026 | | 1.400 | 1.228 | 0,15 |
| 2,700 % fällig am 10.08.2026 | $ | 700 | 571 | 0,07 |
| 3,021 % fällig am 06.03.2024 | € | 300 | 288 | 0,04 |
| 4,125 % fällig am 17.08.2027 | $ | 3.000 | 2.535 | 0,32 |
| **GA Global Funding Trust** | | | | |
| 1,625 % fällig am 15.01.2026 | | 200 | 174 | 0,02 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 2,200 % fällig am 01.04.2024 | € | 600 | 594 | 0,07 |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 29.03.2025 | | 3.300 | 2.910 | 0,36 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 0,434 % fällig am 26.09.2023 | | 2.000 | 2.000 | 0,25 |
| 0,875 % fällig am 09.05.2029 | | 9.900 | 8.253 | 1,03 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 0,309 % fällig am 13.11.2026 | | 100 | 91 | 0,01 |
| 3,973 % fällig am 22.05.2030 | $ | 17.000 | 14.951 | 1,86 |
| 4,292 % fällig am 12.09.2026 | | 1.700 | 1.591 | 0,20 |
| **Huarong Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 30.09.2023 | | 6.400 | 5.834 | 0,73 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 1,250 % fällig am 16.02.2027 | € | 200 | 186 | 0,02 |
| 3,000 % fällig am 18.02.2026 | £ | 4.400 | 4.902 | 0,61 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 4,000 % fällig am 23.09.2029 | $ | 4.600 | 3.925 | 0,49 |
| 5,710 % fällig am 15.01.2026 | | 2.800 | 2.556 | 0,32 |
| **JAB Holdings BV** | | | | |
| 1,750 % fällig am 25.06.2026 | € | 1.100 | € 1.027 | 0,13 |
| 4,750 % fällig am 29.06.2032 | | 5.600 | 5.594 | 0,70 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 4,203 % fällig am 23.07.2029 | $ | 6.200 | 5.726 | 0,71 |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.10.2043 | DKK | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 32.558 | 3.444 | 0,43 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 642 | 63 | 0,01 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 273 | 34 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **KBC Group NV** | | | | |
| 0,250 % fällig am 01.03.2027 | € | 500 | 449 | 0,06 |
| **Kojamo Oyj** | | | | |
| 1,500 % fällig am 19.06.2024 | | 500 | 476 | 0,06 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 0,250 % fällig am 07.09.2026 | | 3.200 | 2.804 | 0,35 |
| 1,000 % fällig am 02.05.2023 | | 4.300 | 4.279 | 0,53 |
| **Liberty Mutual Finance Europe DAC** | | | | |
| 1,750 % fällig am 27.03.2024 | | 400 | 397 | 0,05 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 3,511 % fällig am 18.03.2026 | $ | 200 | 186 | 0,02 |
| 3,750 % fällig am 18.03.2028 | | 4.600 | 4.191 | 0,52 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 2,250 % fällig am 13.05.2025 | € | 8.100 | 7.738 | 0,96 |
| 3,250 % fällig am 13.11.2028 | | 2.500 | 2.259 | 0,28 |
| **MPT Operating Partnership LP** | | | | |
| 0,993 % fällig am 15.10.2026 | | 500 | 413 | 0,05 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 4,363 % fällig am 01.08.2024 | $ | 12.600 | 12.071 | 1,50 |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 1,750 % fällig am 02.03.2026 | € | 5.339 | 5.126 | 0,64 |
| 2,000 % fällig am 04.03.2025 | | 6.000 | 5.930 | 0,74 |
| **NE Property BV** | | | | |
| 1,875 % fällig am 09.10.2026 | | 200 | 168 | 0,02 |
| 3,375 % fällig am 14.07.2027 | | 6.000 | 5.174 | 0,64 |
| **Nissan Motor Acceptance Co. LLC** | | | | |
| 2,000 % fällig am 09.03.2026 | $ | 1.000 | 829 | 0,10 |
| **Nordea Bank Abp** | | | | |
| 1,125 % fällig am 16.02.2027 | € | 300 | 276 | 0,03 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.10.2043 | DKK | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 105.701 | 10.750 | 1,34 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 38.322 | 3.775 | 0,47 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 156 | 19 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 14 | 2 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 0,250 % fällig am 13.01.2026 | € | 6.400 | 5.788 | 0,72 |
| 0,375 % fällig am 17.01.2028 | | 1.200 | 1.007 | 0,13 |
| 0,500 % fällig am 01.10.2043 | DKK | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 76.087 | 8.041 | 1,00 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 24.395 | 2.491 | 0,31 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 300 | 37 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2053 | | 19.192 | 2.105 | 0,26 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2036 | | 38 | 5 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 3 | 0 | 0,00 |
| **P3 Group SARL** | | | | |
| 1,625 % fällig am 26.01.2029 | € | 4.000 | 2.958 | 0,37 |
| **Pacific Life Global Funding** | | | | |
| 1,200 % fällig am 24.06.2025 | $ | 200 | 176 | 0,02 |
| **Prologis International Funding S.A.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 01.06.2031 | € | 900 | 847 | 0,11 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 26.01.2026 | $ | 4.900 | 4.265 | 0,53 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.04.2036 | DKK | 3 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.04.2047 | | 9 | 1 | 0,00 |
| **Sagax AB** | | | | |
| 1,125 % fällig am 30.01.2027 | € | 2.000 | 1.684 | 0,21 |
| 2,000 % fällig am 17.01.2024 | | 500 | 490 | 0,06 |
| 2,250 % fällig am 13.03.2025 | | 2.400 | 2.283 | 0,28 |
| **Sagax Euro MTN NL BV** | | | | |
| 0,750 % fällig am 26.01.2028 | | 1.000 | 771 | 0,10 |
| 1,000 % fällig am 17.05.2029 | | 900 | 664 | 0,08 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 0,603 % fällig am 13.09.2029 | | 11.600 | 9.500 | 1,18 |
| 0,664 % fällig am 27.03.2024 | | 2.500 | 2.504 | 0,31 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **SBB Treasury Oyj** | | | | |
| 0,129 % fällig am 08.02.2024 | € | 6.000 € | 4.945 | 0,62 |
| **SELP Finance SARL** | | | | |
| 1,250 % fällig am 25.10.2023 | | 5.700 | 5.593 | 0,70 |
| **Sirius Real Estate Ltd.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 22.06.2026 | | 5.900 | 5.103 | 0,64 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 0,625 % fällig am 02.12.2027 | | 2.400 | 2.120 | 0,26 |
| 0,875 % fällig am 22.09.2028 | | 11.600 | 10.122 | 1,26 |
| 1,792 % fällig am 09.06.2027 | $ | 5.800 | 4.849 | 0,60 |
| **Sofina S.A.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 23.09.2028 | € | 6.000 | 4.724 | 0,59 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 0,800 % fällig am 17.11.2029 | | 1.000 | 824 | 0,10 |
| 1,214 % fällig am 23.03.2025 (f) | $ | 200 | 180 | 0,02 |
| 1,214 % fällig am 23.03.2025 | | 5.500 | 4.964 | 0,62 |
| 3,785 % fällig am 21.05.2025 | | 1.300 | 1.221 | 0,15 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | |
| 1,474 % fällig am 08.07.2025 | | 600 | 528 | 0,07 |
| 2,472 % fällig am 14.01.2029 | | 1.600 | 1.334 | 0,17 |
| **TP ICAP Finance PLC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 18.11.2028 | £ | 4.000 | 3.831 | 0,48 |
| **UBS AG** | | | | |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (e) | $ | 1.700 | 1.631 | 0,20 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 1,250 % fällig am 17.04.2025 | € | 15.400 | 15.044 | 1,87 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 1,875 % fällig am 31.01.2024 | | 2.900 | 2.883 | 0,36 |
| 2,500 % fällig am 31.07.2026 | | 600 | 582 | 0,07 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 12.02.2025 (a) | | 2.000 | 1.857 | 0,23 |
| 0,125 % fällig am 12.02.2027 | | 1.700 | 1.453 | 0,18 |
| 0,875 % fällig am 31.01.2028 | | 2.200 | 1.898 | 0,24 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** | | | | |
| 0,000 % fällig am 19.07.2024 (a) | | 700 | 666 | 0,08 |
| 1,375 % fällig am 20.01.2025 | | 2.400 | 2.324 | 0,29 |
| **Vonovia SE** | | | | |
| 1,375 % fällig am 28.01.2026 | | 200 | 186 | 0,02 |
| **WEA Finance LLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 17.09.2024 | $ | 2.100 | 1.940 | 0,24 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 02.02.2027 | € | 14.900 | 13.458 | 1,67 |
| **WPC Eurobond BV** | | | | |
| 1,350 % fällig am 15.04.2028 | | 2.600 | 2.180 | 0,27 |
| | | | 460.823 | 57,31 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 31.07.2043 | £ | 2.600 | 3.006 | 0,37 |
| **ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 17.06.2025 | € | 3.300 | 3.086 | 0,38 |
| **Atlantia SpA** | | | | |
| 1,625 % fällig am 03.02.2025 | | 3.100 | 2.835 | 0,35 |
| **BEL S.A.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 18.04.2024 | | 3.900 | 3.867 | 0,48 |
| **Chanel Ceres PLC** | | | | |
| 0,500 % fällig am 31.07.2026 | | 5.000 | 4.585 | 0,57 |
| **Cie Plastic Omnium S.A.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 26.06.2024 | | 3.700 | 3.555 | 0,44 |
| **DAE Funding LLC** | | | | |
| 1,550 % fällig am 01.08.2024 | $ | 1.400 | 1.255 | 0,16 |
| 1,625 % fällig am 15.02.2024 | | 3.200 | 2.901 | 0,36 |
| 2,625 % fällig am 20.03.2025 | | 2.800 | 2.494 | 0,31 |
| 3,375 % fällig am 20.03.2028 | | 900 | 758 | 0,10 |
| **easyJet FinCo BV** | | | | |
| 1,875 % fällig am 03.03.2028 | € | 6.000 | 4.851 | 0,60 |
| **Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide** | | | | |
| 1,625 % fällig am 09.07.2024 | | 3.400 | 3.294 | 0,41 |
| 1,875 % fällig am 31.03.2028 | | 800 | 702 | 0,09 |
| 2,125 % fällig am 09.07.2027 | | 7.200 | 6.575 | 0,82 |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 2,949 % fällig am 24.01.2024 | | 3.300 | 1.073 | 0,13 |
| **GN Store Nord A/S** | | | | |
| 0,875 % fällig am 25.11.2024 | | 5.600 | 5.303 | 0,66 |
| **IMCD NV** | | | | |
| 2,500 % fällig am 26.03.2025 | | 1.402 | 1.308 | 0,16 |
| **Informa PLC** | | | | |
| 2,125 % fällig am 06.10.2025 | € | 100 € | 97 | 0,01 |
| **InterContinental Hotels Group PLC** | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2027 | | 5.700 | 5.256 | 0,65 |
| **Las Vegas Sands Corp.** | | | | |
| 2,900 % fällig am 25.06.2025 | $ | 1.050 | 897 | 0,11 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | |
| 2,279 % fällig am 15.12.2030 | | 435 | 385 | 0,05 |
| 5,965 % fällig am 15.12.2025 | £ | 13 | 16 | 0,00 |
| 6,013 % fällig am 15.12.2030 | | 111 | 132 | 0,02 |
| **Motability Operations Group PLC** | | | | |
| 0,875 % fällig am 14.03.2025 | € | 800 | 774 | 0,10 |
| **Nissan Motor Co. Ltd.** | | | | |
| 2,652 % fällig am 17.03.2026 | | 4.200 | 3.928 | 0,49 |
| 3,201 % fällig am 17.09.2028 | | 1.100 | 980 | 0,12 |
| **NXP BV** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2033 | $ | 100 | 93 | 0,01 |
| **Prosus NV** | | | | |
| 1,207 % fällig am 19.01.2026 | € | 1.200 | 1.047 | 0,13 |
| **RCS & RDS S.A.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 05.02.2025 | | 600 | 530 | 0,07 |
| **Rentokil Initial Finance BV** | | | | |
| 3,875 % fällig am 27.06.2027 | | 1.100 | 1.120 | 0,14 |
| **Rockies Express Pipeline LLC** | | | | |
| 3,600 % fällig am 15.05.2025 | $ | 100 | 87 | 0,01 |
| **SEB S.A.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 31.05.2024 | € | 3.800 | 3.762 | 0,47 |
| **Silfin NV** | | | | |
| 2,875 % fällig am 11.04.2027 | | 1.100 | 803 | 0,10 |
| **Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA** | | | | |
| 3,500 % fällig am 09.10.2025 | | 2.600 | 2.605 | 0,32 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 3,375 % fällig am 16.04.2026 | | 3.800 | 3.755 | 0,47 |
| 4,441 % fällig am 24.04.2023 | $ | 500 | 482 | 0,06 |
| 4,892 % fällig am 24.04.2025 | | 4.700 | 4.511 | 0,56 |
| **TDF Infrastructure SASU** | | | | |
| 1,750 % fällig am 01.12.2029 | € | 3.900 | 3.229 | 0,40 |
| **Thames Water Utilities Finance PLC** | | | | |
| 0,875 % fällig am 31.01.2028 | | 1.800 | 1.569 | 0,20 |
| **Ubisoft Entertainment S.A.** | | | | |
| 1,289 % fällig am 30.01.2023 | | 4.500 | 4.502 | 0,56 |
| **Valeo** | | | | |
| 1,000 % fällig am 03.08.2028 | | 1.100 | 859 | 0,11 |
| **Vilmorin & Cie S.A.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 26.03.2028 | | 5.600 | 4.349 | 0,54 |
| **Volkswagen International Finance NV** | | | | |
| 3,750 % fällig am 28.09.2027 | | 900 | 913 | 0,11 |
| **Worldline S.A.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 13.09.2024 | | 10.600 | 10.368 | 1,29 |
| **Worley U.S. Finance Sub Ltd.** | | | | |
| 0,875 % fällig am 09.06.2026 | | 5.200 | 4.662 | 0,58 |
| | | | 113.159 | 14,07 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **Enel Finance International NV** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.06.2025 | $ | 800 | 758 | 0,10 |
| **Galp Energia SGPS S.A.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 | € | 2.000 | 1.900 | 0,24 |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC** | | | | |
| 2,950 % fällig am 27.01.2029 | $ | 1.800 | 516 | 0,06 |
| 3,000 % fällig am 29.06.2027 | | 400 | 115 | 0,01 |
| **Global Switch Holdings Ltd.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 31.01.2024 | € | 5.700 | 5.562 | 0,69 |
| **TDC Net A/S** | | | | |
| 5,056 % fällig am 31.05.2028 | | 2.100 | 1.968 | 0,25 |
| | | | 10.819 | 1,35 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 584.801 | 72,73 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Canada Square Funding PLC** | | | | |
| 1,550 % fällig am 17.10.2051 | £ | 1.793 | 2.081 | 0,26 |
| 1,720 % fällig am 17.06.2058 | | 1.363 | 1.563 | 0,20 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,312 % fällig am 25.08.2034 ^ | $ | 23 | 20 | 0,00 |
| **Domi BV** | | | | |
| 0,349 % fällig am 15.06.2053 | € | 1.094 | 1.081 | 0,13 |
| **Dutch Property Finance BV** | | | | |
| 0,235 % fällig am 28.07.2058 | € | 2.749 € | 2.727 | 0,34 |
| 0,320 % fällig am 28.10.2059 | | 3.700 | 3.653 | 0,45 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 2,193 % fällig am 18.06.2039 | $ | 297 | 279 | 0,04 |
| **Jubilee Place BV** | | | | |
| 0,402 % fällig am 17.01.2059 | € | 2.458 | 2.443 | 0,30 |
| 0,552 % fällig am 17.10.2057 | | 649 | 641 | 0,08 |
| **Landmark Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 1,439 % fällig am 17.04.2044 | £ | 979 | 1.051 | 0,13 |
| **Miravet SARL** | | | | |
| 0,494 % fällig am 26.05.2065 | € | 2.183 | 2.189 | 0,27 |
| **Newgate Funding PLC** | | | | |
| 0,319 % fällig am 15.12.2050 | | 203 | 199 | 0,03 |
| **Primrose Residential DAC** | | | | |
| 0,488 % fällig am 24.10.2061 | | 2.744 | 2.713 | 0,34 |
| **RMAC Securities PLC** | | | | |
| 1,021 % fällig am 12.06.2044 | £ | 97 | 109 | 0,01 |
| **Southern Pacific Financing PLC** | | | | |
| 1,698 % fällig am 10.03.2044 | | 22 | 25 | 0,00 |
| **Stratton Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2060 | | 4.388 | 5.058 | 0,63 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 2,295 % fällig am 19.12.2034 | $ | 77 | 69 | 0,01 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,605 % fällig am 20.10.2051 | £ | 1.667 | 1.931 | 0,24 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | |
| 1,602 % fällig am 12.03.2055 | | 2.573 | 2.909 | 0,36 |
| | | | 30.741 | 3,82 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Accunia European CLO DAC** | | | | |
| 0,950 % fällig am 15.07.2030 | € | 3.050 | 3.011 | 0,37 |
| **Aqueduct European CLO DAC** | | | | |
| 0,640 % fällig am 20.07.2030 | | 1.220 | 1.202 | 0,15 |
| **Ares European CLO DAC** | | | | |
| 0,610 % fällig am 15.04.2030 | | 495 | 485 | 0,06 |
| 1,120 % fällig am 21.10.2033 | | 6.600 | 6.483 | 0,81 |
| **Aurium CLO DAC** | | | | |
| 1,050 % fällig am 23.03.2032 | | 1.300 | 1.275 | 0,16 |
| **Bastille Euro CLO DAC** | | | | |
| 1,150 % fällig am 15.01.2034 | | 2.700 | 2.630 | 0,33 |
| **Black Diamond CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 03.10.2029 | | 130 | 131 | 0,02 |
| **BlueMountain Fuji EUR CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 15.07.2030 | | 431 | 424 | 0,05 |
| **Bosphorus CLO DAC** | | | | |
| 1,010 % fällig am 12.12.2032 | | 1.900 | 1.846 | 0,23 |
| **Cairn CLO DAC** | | | | |
| 0,710 % fällig am 25.04.2032 | | 600 | 588 | 0,07 |
| 0,790 % fällig am 25.07.2029 | | 1.359 | 1.345 | 0,17 |
| **Carlyle Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 15.08.2030 | | 698 | 685 | 0,09 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.07.2030 | | 4.897 | 4.807 | 0,60 |
| 0,960 % fällig am 16.01.2033 | | 1.600 | 1.556 | 0,19 |
| **Contego CLO BV** | | | | |
| 0,770 % fällig am 15.10.2030 | | 700 | 685 | 0,09 |
| **Contego CLO DAC** | | | | |
| 0,640 % fällig am 23.01.2030 | | 2.098 | 2.062 | 0,26 |
| **CVC Cordatus Loan Fund DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 21.07.2030 | | 4.205 | 4.151 | 0,52 |
| 0,720 % fällig am 27.01.2031 | | 1.699 | 1.668 | 0,21 |
| 0,780 % fällig am 15.08.2032 | | 1.000 | 979 | 0,12 |
| 0,900 % fällig am 17.06.2032 | | 900 | 872 | 0,11 |
| **Dryden Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,850 % fällig am 15.07.2031 | | 851 | 841 | 0,10 |
| 0,860 % fällig am 15.05.2034 | | 200 | 194 | 0,02 |
| **GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC** | | | | |
| 0,900 % fällig am 20.01.2032 | | 100 | 97 | 0,01 |
| **Grosvenor Place CLO BV** | | | | |
| 0,720 % fällig am 30.10.2029 | | 1.108 | 1.103 | 0,14 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | | 307 | 306 | 0,04 |
| 0,850 % fällig am 15.01.2032 | | 200 | 195 | 0,02 |
| 1,100 % fällig am 18.11.2029 | | 48 | 48 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Invesco Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 15.07.2031 | € | 500 | € | 485 | 0,06 |
| **Jubilee CLO DAC** | | | | | |
| 0,519 % fällig am 15.12.2029 | | 1.240 | | 1.227 | 0,15 |
| 0,600 % fällig am 15.04.2030 | | 1.000 | | 986 | 0,12 |
| **Madison Park Euro Funding DAC** | | | | | |
| 0,800 % fällig am 15.07.2032 | | 600 | | 582 | 0,07 |
| **Man GLG Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,810 % fällig am 15.10.2032 | | 2.800 | | 2.746 | 0,34 |
| **OCP Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,820 % fällig am 15.01.2032 | | 370 | | 365 | 0,05 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** | | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.10.2031 | | 2.750 | | 2.694 | 0,33 |
| 1,050 % fällig am 15.10.2031 | | 900 | | 886 | 0,11 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 5,340 % fällig am 25.01.2037 | $ | 1.296 | | 485 | 0,06 |
| **Segovia European CLO DAC** | | | | | |
| 0,880 % fällig am 20.07.2032 | € | 500 | | 486 | 0,06 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | | |
| 0,810 % fällig am 15.02.2034 | € | 500 | € | 483 | 0,06 |
| 0,920 % fällig am 12.01.2032 | | 200 | | 194 | 0,02 |
| **Voya Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.10.2030 | | 200 | | 197 | 0,02 |
| | | | | 51.485 | 6,40 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Kazakhstan Government International Bond** | | | | | |
| 1,550 % fällig am 09.11.2023 | | 100 | | 99 | 0,01 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | | |
| **FRANCE TREASURY BILLS** | | | | | |
| (0,690) % fällig am 20.07.2022 (a)(b) | | 5.700 | | 5.702 | 0,71 |
| (0,506) % fällig am 21.09.2022 (a)(b) | | 8.600 | | 8.610 | 1,07 |
| (0,450) % fällig am 14.09.2022 (a)(b) | | 1.600 | | 1.601 | 0,20 |
| (0,448) % fällig am 14.09.2022 (a)(b) | € | 700 | € | 701 | 0,09 |
| (0,445) % fällig am 14.09.2022 (a)(b) | | 1.000 | | 1.001 | 0,12 |
| (0,444) % fällig am 14.09.2022 (a)(b) | | 800 | | 801 | 0,10 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | | 18.416 | 2,29 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **€** | **700.842** | **87,15** |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (d)** | 511.500 | 48.807 | 6,07 |
| **Summe Investmentfonds** | | **€ 48.807** | **6,07** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| COM | (1,200) % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | € 11.100 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,375 % fällig am 15.03.2023 | € (11.448) | € 11.100 | € 11.100 | 1,38 |
| FICC | 0,400 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 979 | U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | (955) | 936 | 936 | 0,12 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **€ (12.403)** | **€ 12.036** | **€ 12.036** | **1,50** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bobl September Futures | Long | 09.2022 | 759 | € 27 | 0,00 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 104 | (1.414) | (0,17) |
| | | | | € (1.387) | (0,17) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **€ (1.387)** | **(0,17)** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 8.300 | € (104) | (0,01) |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.06.2026 | 6.300 | (113) | (0,01) |
| Auchan Holding S.A. | 1,000 | 20.12.2027 | € 400 | (36) | (0,01) |
| Auchan Holding S.A. | 1,000 | 20.06.2028 | 5.700 | (551) | (0,07) |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.12.2025 | 4.500 | (94) | (0,01) |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.12.2027 | 1.100 | (40) | (0,01) |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.06.2028 | 3.300 | (125) | (0,02) |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.12.2028 | 1.600 | (51) | (0,01) |
| Electricite de France S.A. | 1,000 | 20.12.2026 | 4.100 | (152) | (0,02) |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.06.2027 | $ 700 | (26) | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2026 | 3.600 | (84) | (0,01) |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2026 | 400 | (15) | 0,00 |
| General Motors Co. | 5,000 | 20.06.2026 | 500 | (36) | (0,01) |
| LafargeHolcim Ltd. | 1,000 | 20.06.2026 | € 7.100 | (204) | (0,03) |
| Marks & Spencer PLC | 1,000 | 20.12.2024 | 1.900 | (36) | 0,00 |
| Stellantis NV | 5,000 | 20.06.2026 | 7.300 | (583) | (0,07) |
| Syngenta Finance NV | 1,000 | 20.06.2028 | 400 | (22) | 0,00 |
| Telefonica Emisiones S.A. | 1,000 | 20.06.2028 | 100 | (1) | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 | 20.12.2027 | 5.800 | (189) | (0,02) |
| Valeo S.A. | 1,000 | 20.06.2026 | 400 | (19) | 0,00 |
| Valeo S.A. | 1,000 | 20.06.2028 | 800 | (74) | (0,01) |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 | 20.06.2026 | 300 | (13) | 0,00 |

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2026 | € 2.400 | € (120) | (0,02) |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 | 20.06.2028 | 2.600 | (170) | (0,02) |
| | | | | € (2.858) | (0,36) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-38 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2027 | $ 8.200 | € (93) | (0,01) |
| iTraxx Europe Main 36 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | € 2.700 | (18) | 0,00 |
| iTraxx Europe Main 37 10-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 73.200 | (1.131) | (0,14) |
| | | | | € (1.242) | (0,15) |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 % | 21.09.2027 | £ 9.000 | € (139) | (0,02) |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,050 | 15.12.2031 | ¥ 1.860.000 | 49 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2052 | $ 3.800 | (68) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,500 | 16.06.2026 | 27.600 | 2.062 | 0,26 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,750 | 16.12.2022 | 31.400 | 502 | 0,06 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,750 | 16.06.2031 | 26.000 | 2.806 | 0,35 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,000 | 16.12.2025 | 8.600 | 626 | 0,08 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 17.06.2025 | 4.800 | 332 | 0,04 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 16.06.2051 | 1.900 | 453 | 0,06 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 18.12.2024 | 17.680 | 1.103 | 0,14 |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2027 | € 45.700 | (2.235) | (0,28) |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | 163.700 | (13.348) | (1,66) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 13.05.2027 | 4.700 | (146) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.05.2027 | 2.200 | (69) | (0,01) |
| | | | | | € (8.072) | (1,00) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **€ (12.172)** | **(1,51)** |

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

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

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

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

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

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 % | 20.07.2022 | 1.700 | € (2) | € (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Crossover 36 5-Year Index | Verkauf | 5,250 | 20.07.2022 | 1.000 | (9) | (19) | (0,01) |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 5.100 | (24) | (10) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 4.500 | (12) | (14) | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 1.600 | (3) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Kauf | 0,700 | 17.08.2022 | 1.700 | (2) | 0 | 0,00 |
| BRC | Put - OTC CDX.IG-37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 2.600 | (6) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 700 | (6) | (7) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 5.500 | (24) | (11) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,600 | 17.08.2022 | 1.000 | (2) | (2) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 700 | (1) | (1) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 1.500 | (3) | (2) | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,300 | 17.08.2022 | 1.800 | (4) | (3) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 95,000 | 17.08.2022 | 300 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 1.700 | (14) | (18) | (0,01) |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,100 | 20.07.2022 | 3.000 | (10) | (11) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 1.500 | (4) | (5) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,250 | 20.07.2022 | 1.000 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,350 | 17.08.2022 | 1.500 | (3) | (2) | 0,00 |
| | | | | | | € (135) | € (113) | (0,02) |

ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,000 % | 01.07.2022 | 11.600 | € (47) | € 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,800 | 01.07.2022 | 11.600 | (48) | (15) | 0,00 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,840 | 05.07.2022 | 10.400 | (37) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 1,520 | 05.07.2022 | 10.400 | (37) | (149) | (0,02) |
| GLM | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,500 | 07.02.2023 | 52.200 | (151) | (645) | (0,08) |
| | | | | | | | € (320) | € (809) | (0,10) |

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Hammerson PLC | 1,000 % | 20.12.2022 | € 200 | € 2 | € (4) | € (2) | 0,00 |
| BRC | Hammerson PLC | 1,000 | 20.12.2022 | 400 | 3 | (6) | (3) | 0,00 |
| GST | Hammerson PLC | 1,000 | 20.12.2022 | 2.300 | 11 | (30) | (19) | 0,00 |
| JPM | Hochtief AG | 5,000 | 20.12.2026 | 4.300 | 868 | (489) | 379 | 0,04 |
| MYC | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | $ 200 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 400 | (1) | (12) | (13) | 0,00 |
| | | | | | € 883 | € (546) | € 337 | 0,04 |

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

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

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 08.2022 | € | 881 | £ | 750 | € 0 | € (12) | € (12) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 4.344 | NOK | 44.140 | 0 | (79) | (79) | (0,01) |
| BPS | 07.2022 | | 3.346 | DKK | 24.890 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 133.862 | $ | 140.816 | 832 | 0 | 832 | 0,10 |
| | 07.2022 | MXN | 4.694 | | 224 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.118 | € | 1.062 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 234 | MXN | 4.694 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 4.936 | £ | 4.240 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 39.309.858 | $ | 2.701 | 72 | 0 | 72 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 137.719 | € | 130.698 | 0 | (791) | (791) | (0,10) |
| | 09.2022 | MXN | 4.694 | $ | 230 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | € | 2.858 | DKK | 21.270 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 21.269 | € | 2.858 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 4.896 | AUD | 7.328 | 0 | (88) | (88) | (0,01) |
| DUB | 07.2022 | DKK | 284.975 | € | 38.300 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 10.2022 | $ | 2.873 | ZAR | 44.307 | 0 | (188) | (188) | (0,02) |
| GLM | 07.2022 | | 2.363 | BRL | 11.907 | 0 | (83) | (83) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 2.390 | MXN | 48.812 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | DKK | 3.305 | € | 444 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 26.979 | DKK | 200.734 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 3.114 | $ | 463 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 165.735 | € | 22.275 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 08.2022 | £ | 28.838 | | 33.518 | 91 | 0 | 91 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 1.848 | IDR | 27.179.229 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | € | 490 | DKK | 3.645 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 7.085 | $ | 1.055 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | £ | 117 | € | 137 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 815 | IDR | 11.956.480 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 05.2023 | CNH | 7.698 | $ | 1.147 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | BRL | 11.907 | | 2.309 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK | 4.730 | € | 636 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 1.352 | DKK | 10.059 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.480 | $ | 1.589 | 40 | 0 | 40 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 2.291 | BRL | 11.907 | 0 | (33) | (33) | (0,01) |
| | 10.2022 | ZAR | 3.231 | $ | 213 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| SCX | 08.2022 | CNH | 12.568 | | 1.876 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | $ | 144.325 | € | 134.280 | 0 | (3.771) | (3.771) | (0,47) |
| UAG | 07.2022 | € | 4.431 | DKK | 32.967 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 902 | € | 602 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 32.966 | | 4.431 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09.2022 | MXN | 47.752 | $ | 2.396 | 55 | 0 | 55 | 0,01 |
| | 10.2022 | $ | 225 | MXN | 4.602 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | € 1.196 | € (5.172) | € (3.976) | (0,49) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **€ (4.561)** | **(0,57)** |
| **Summe Anlagen** | **€ 743.565** | **92,47** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **€ 60.583** | **7,53** |
| **Nettovermögen** | **€ 804.148** | **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) Nullkuponwertpapier.

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

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

(d) Mit dem Fonds verbunden.

(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(f) Eingeschränkte Wertpapiere:

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeits-datum | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Deutsche Bank AG | 2,129 % | 24.11.2026 | 17.11.2020 | € 337 | € 340 | 0,04 |
| Standard Chartered PLC | 1,214 | 23.03.2025 | 16.03.2021 | 168 | 180 | 0,02 |
| | | | | € 505 | € 520 | 0,06 |

Barmittel in Höhe von EUR 27.453 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von EUR 4.490 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | € 700.842 | € 0 | € 700.842 |
| Investmentfonds | 48.807 | 0 | 0 | 48.807 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 12.036 | 0 | 12.036 |
| Finanzderivate[3] | (1.387) | (16.733) | 0 | (18.120) |
| **Summen** | **€ 47.420** | **€ 696.145** | **€ 0** | **€ 743.565** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 0 | € 902.376 | € 0 | € 902.376 |
| Investmentfonds | 0 | 63.657 | 0 | 63.657 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 5.883 | 0 | 5.883 |
| Finanzderivate[3] | (1.606) | 654 | (15) | (967) |
| **Summen** | **€ (1.606)** | **€ 972.570** | **€ (15)** | **€ 970.949** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | € (135) | € 0 | € (135) |
| BPS | 75 | 0 | 75 |
| BRC | (112) | 0 | (112) |
| CBK | (165) | 280 | 115 |
| DUB | (211) | 0 | (211) |
| GLM | (705) | 770 | 65 |
| GST | (22) | 10 | (12) |
| JPM | 402 | (550) | (148) |
| MBC | (19) | 0 | (19) |
| MYC | (21) | 0 | (21) |
| MYI | 57 | (10) | 47 |
| SCX | 2 | 0 | 2 |
| SOG | (3.771) | 3.430 | (341) |
| UAG | 64 | 0 | 64 |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 79,65 | 84,44 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 6,48 | 3,43 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 1,02 | 0,84 |
| Investmentfonds | 6,07 | 6,26 |
| Pensionsgeschäfte | 1,50 | 0,58 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,17) | (0,16) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (1,51) | (0,12) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (0,57) | 0,19 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 1,90 | 1,54 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 72,73 | 79,65 |
| Non-Agency-MBS | 3,82 | 2,58 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 6,40 | 3,76 |
| Staatsemissionen | 0,01 | 1,01 |
| Kurzfristige Instrumente | 2,29 | 0,17 |
| Investmentfonds | 6,07 | 6,26 |
| Pensionsgeschäfte | 1,50 | 0,58 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,17) | (0,16) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,36) | (0,03) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,15) | 0,01 |
| Zinsswaps | (1,00) | (0,10) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,02) | 0,00 |
| Zinsswapoptionen | (0,10) | k. A. |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,04 | 0,08 |
| Devisenterminkontrakte | (0,49) | 0,11 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 7,53 | 4,54 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC** | | | | |
| 3,845 % fällig am 01.12.2027 (b) | $ | 5.713 | € 5.207 | 0,32 |
| **Casino Guichard Perrachon S.A.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 31.08.2025 (b) | € | 16.000 | 14.420 | 0,89 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 3,420 % fällig am 01.02.2027 (b) | $ | 4.253 | 3.892 | 0,24 |
| **Connect Finco SARL** | | | | |
| 5,170 % fällig am 11.12.2026 (b) | | 598 | 530 | 0,03 |
| **Grifols S.A.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.11.2027 (b) | € | 6.000 | 5.595 | 0,35 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | |
| 3,374 % fällig am 22.06.2026 (b) | $ | 3.798 | 3.488 | 0,22 |
| **INEOS Finance PLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.04.2024 (b) | € | 19.084 | 18.267 | 1,13 |
| 3,250 % fällig am 08.11.2028 (b) | | 5.000 | 4.598 | 0,29 |
| **Level 3 Financing, Inc.** | | | | |
| 3,416 % fällig am 01.03.2027 (b) | $ | 2.764 | 2.457 | 0,15 |
| **Nielsen Finance LLC** | | | | |
| 3,190 % fällig am 04.10.2023 (b) | | 2.857 | 2.721 | 0,17 |
| **Setanta Aircraft Leasing DAC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 05.11.2028 (b) | | 9.000 | 8.215 | 0,51 |
| **Sigma Bidco BV** | | | | |
| 3,500 % fällig am 02.07.2025 (b) | € | 5.900 | 4.477 | 0,28 |
| **Summer (BC) Holdco B SARL** | | | | |
| 4,250 % fällig am 04.12.2026 (b) | | 5.000 | 4.612 | 0,29 |
| **Ziggo BV** | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.01.2029 (b) | | 6.300 | 5.638 | 0,35 |
| | | | 84.117 | 5,22 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC** | | | | |
| 2,700 % fällig am 11.06.2023 | | 8.200 | 574 | 0,04 |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | |
| 2,375 % fällig am 01.06.2027 | | 3.800 | 3.656 | 0,23 |
| 4,750 % fällig am 28.07.2025 | $ | 4.222 | 4.023 | 0,25 |
| **ADLER Real Estate AG** | | | | |
| 1,875 % fällig am 27.04.2023 | € | 400 | 315 | 0,02 |
| 3,000 % fällig am 27.04.2026 | | 200 | 133 | 0,01 |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 3,150 % fällig am 15.02.2024 | $ | 7.300 | 6.762 | 0,42 |
| **Aircastle Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.06.2026 | | 300 | 266 | 0,02 |
| **alstria office REIT-AG** | | | | |
| 1,500 % fällig am 23.06.2026 | € | 3.900 | 3.325 | 0,21 |
| **Altarea S.C.A.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 16.01.2030 | | 1.500 | 1.070 | 0,07 |
| 1,875 % fällig am 17.01.2028 | | 6.000 | 4.782 | 0,30 |
| **Argan S.A.** | | | | |
| 1,011 % fällig am 17.11.2026 | | 1.000 | 818 | 0,05 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 0,375 % fällig am 15.04.2027 | | 1.900 | 1.484 | 0,09 |
| 1,450 % fällig am 09.07.2028 | | 700 | 545 | 0,03 |
| 1,500 % fällig am 28.05.2026 | | 11.000 | 9.555 | 0,59 |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | $ | 3.600 | 3.192 | 0,20 |
| **Athora Netherlands NV** | | | | |
| 7,000 % fällig am 19.06.2025 (e)(g) | € | 800 | 757 | 0,05 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 11.09.2025 | | 6.400 | 5.866 | 0,36 |
| 3,625 % fällig am 17.10.2022 | | 6.196 | 6.162 | 0,38 |
| **Atrium Finance Issuer BV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.09.2027 | | 3.900 | 3.157 | 0,20 |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | |
| 2,528 % fällig am 18.11.2027 | $ | 172 | 134 | 0,01 |
| 2,875 % fällig am 15.02.2025 | | 13.700 | 12.070 | 0,75 |
| 4,250 % fällig am 15.04.2026 | | 300 | 266 | 0,02 |
| **Balder Finland Oyj** | | | | |
| 1,000 % fällig am 20.01.2029 | € | 800 | 505 | 0,03 |
| 2,000 % fällig am 18.01.2031 | | 6.500 | 3.879 | 0,24 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 3,625 % fällig am 24.09.2024 | | 8.500 | 7.865 | 0,49 |
| 4,000 % fällig am 10.07.2022 | | 2.400 | 2.394 | 0,15 |
| 5,375 % fällig am 18.01.2028 | | 100 | 59 | 0,00 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (e)(g) | € | 1.600 | € 1.541 | 0,10 |
| **Banco de Sabadell S.A.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 27.03.2025 | | 18.500 | 17.041 | 1,06 |
| **Bank of Ireland Group PLC** | | | | |
| 1,875 % fällig am 05.06.2026 | | 3.600 | 3.427 | 0,21 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (g) | $ | 548 | 529 | 0,03 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 2,885 % fällig am 31.01.2027 | € | 200 | 195 | 0,01 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 1,323 % fällig am 13.01.2027 | $ | 500 | 423 | 0,03 |
| 1,904 % fällig am 30.09.2028 | | 2.300 | 1.882 | 0,12 |
| 4,400 % fällig am 14.08.2028 | | 700 | 641 | 0,04 |
| 4,705 % fällig am 10.01.2025 | | 30.500 | 29.182 | 1,81 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 14.01.2028 | € | 1.200 | 1.053 | 0,07 |
| 2,375 % fällig am 14.01.2025 | $ | 100 | 91 | 0,01 |
| **Castellum Helsinki Finance Holding Abp** | | | | |
| 0,875 % fällig am 17.09.2029 | € | 4.700 | 3.203 | 0,20 |
| 2,000 % fällig am 24.03.2025 | | 5.500 | 4.878 | 0,30 |
| **CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund** | | | | |
| 0,500 % fällig am 27.01.2028 | | 1.200 | 993 | 0,06 |
| **CIMIC Finance Ltd.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 28.05.2029 | | 7.300 | 5.261 | 0,33 |
| **Citycon Treasury BV** | | | | |
| 1,625 % fällig am 12.03.2028 | | 10.600 | 7.814 | 0,48 |
| **Corestate Capital Holding S.A.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.04.2023 | | 11.600 | 2.614 | 0,16 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 12.07.2026 | $ | 2.600 | 1.168 | 0,07 |
| 3,125 % fällig am 22.10.2025 | | 1.500 | 707 | 0,04 |
| 4,750 % fällig am 17.01.2023 | | 600 | 507 | 0,03 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 23.04.2027 | € | 9.300 | 7.440 | 0,46 |
| 2,750 % fällig am 12.05.2026 | | 100 | 89 | 0,01 |
| 4,875 % fällig am 18.08.2026 (e) | | 10.000 | 5.816 | 0,36 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (g) | $ | 11.200 | 10.740 | 0,67 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 1,250 % fällig am 17.07.2025 | € | 7.000 | 6.660 | 0,41 |
| 3,750 % fällig am 26.03.2025 | $ | 1.550 | 1.438 | 0,09 |
| **Cromwell Ereit Lux Finco SARL** | | | | |
| 2,125 % fällig am 19.11.2025 | € | 14.200 | 11.623 | 0,72 |
| **CTP NV** | | | | |
| 0,625 % fällig am 27.09.2026 | | 1.600 | 1.279 | 0,08 |
| 1,250 % fällig am 21.06.2029 | | 7.000 | 4.891 | 0,30 |
| 1,500 % fällig am 27.09.2031 | | 1.500 | 910 | 0,06 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 1,375 % fällig am 17.02.2032 | | 700 | 535 | 0,03 |
| 1,625 % fällig am 20.01.2027 | | 14.200 | 12.734 | 0,79 |
| 1,750 % fällig am 17.01.2028 | | 4.600 | 4.015 | 0,25 |
| 1,750 % fällig am 19.11.2030 | | 6.200 | 5.120 | 0,32 |
| 2,552 % fällig am 07.01.2028 | $ | 3.600 | 2.983 | 0,18 |
| 2,625 % fällig am 12.02.2026 | € | 100 | 96 | 0,01 |
| 3,035 % fällig am 28.05.2032 (h) | $ | 200 | 152 | 0,01 |
| 3,547 % fällig am 18.09.2031 | | 1.100 | 882 | 0,05 |
| 3,875 % fällig am 12.02.2024 | £ | 2.400 | 2.752 | 0,17 |
| **Digital Euro Finco LLC** | | | | |
| 1,125 % fällig am 09.04.2028 | € | 1.300 | 1.097 | 0,07 |
| **Digital Intrepid Holding BV** | | | | |
| 0,625 % fällig am 15.07.2031 | | 800 | 566 | 0,04 |
| 1,375 % fällig am 18.07.2032 | | 7.500 | 5.374 | 0,33 |
| **DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH** | | | | |
| 2,500 % fällig am 25.01.2027 | | 6.400 | 5.313 | 0,33 |
| **EQT AB** | | | | |
| 2,375 % fällig am 06.04.2028 | | 1.300 | 1.187 | 0,07 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028 | | 21.600 | 20.012 | 1,24 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 0,346 % fällig am 01.12.2024 | | 3.100 | 2.893 | 0,18 |
| 1,514 % fällig am 17.02.2023 | | 3.100 | 3.060 | 0,19 |
| 1,744 % fällig am 19.07.2024 | | 9.700 | 8.984 | 0,56 |
| 2,330 % fällig am 25.11.2025 | | 12.000 | 10.657 | 0,66 |
| 2,386 % fällig am 17.02.2026 | | 600 | 526 | 0,03 |
| 3,021 % fällig am 06.03.2024 | | 2.000 | 1.922 | 0,12 |
| 5,584 % fällig am 18.03.2024 | $ | 600 | 572 | 0,04 |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 29.03.2025 | € | 6.600 | € 5.820 | 0,36 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 0,309 % fällig am 13.11.2026 | | 300 | 272 | 0,02 |
| 1,589 % fällig am 24.05.2027 | $ | 17.500 | 14.729 | 0,91 |
| 2,099 % fällig am 04.06.2026 | | 600 | 531 | 0,03 |
| 2,633 % fällig am 07.11.2025 | | 11.800 | 10.775 | 0,67 |
| 3,900 % fällig am 25.05.2026 | | 1.200 | 1.124 | 0,07 |
| 3,973 % fällig am 22.05.2030 | | 1.800 | 1.583 | 0,10 |
| 4,300 % fällig am 08.03.2026 | | 3.400 | 3.224 | 0,20 |
| **Indigo Group S.A.S.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 19.04.2028 | € | 500 | 443 | 0,03 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 5,017 % fällig am 26.06.2024 | $ | 4.500 | 4.111 | 0,26 |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.10.2043 | DKK | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 112.797 | 11.931 | 0,74 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 129.175 | 13.534 | 0,84 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Kaisa Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 10,875 % fällig am 23.07.2023 ^ | $ | 5.400 | 716 | 0,04 |
| 11,500 % fällig am 30.01.2023 ^ | | 3.500 | 462 | 0,03 |
| 11,650 % fällig am 01.06.2026 ^ | | 4.000 | 526 | 0,03 |
| **Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.11.2025 | € | 5.800 | 5.387 | 0,33 |
| **Lincoln Financing SARL** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.04.2024 | | 14.300 | 13.880 | 0,86 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 1,500 % fällig am 13.07.2026 | | 2.600 | 2.335 | 0,14 |
| 1,625 % fällig am 17.01.2030 | | 3.600 | 2.834 | 0,18 |
| **Merlin Properties Socimi S.A.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 01.06.2030 | | 3.200 | 2.547 | 0,16 |
| **MPT Operating Partnership LP** | | | | |
| 0,993 % fällig am 15.10.2026 | | 1.300 | 1.073 | 0,07 |
| 2,500 % fällig am 24.03.2026 | £ | 1.800 | 1.855 | 0,11 |
| 3,375 % fällig am 24.04.2030 | | 1.300 | 1.212 | 0,08 |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 1,750 % fällig am 02.03.2026 | € | 6.900 | 6.625 | 0,41 |
| 2,000 % fällig am 04.03.2025 | | 2.600 | 2.570 | 0,16 |
| 4,800 % fällig am 05.04.2026 | $ | 5.900 | 5.632 | 0,35 |
| **NE Property BV** | | | | |
| 1,750 % fällig am 23.11.2024 | € | 2.600 | 2.421 | 0,15 |
| 1,875 % fällig am 09.10.2026 | | 2.900 | 2.438 | 0,15 |
| 2,000 % fällig am 20.01.2030 | | 1.700 | 1.210 | 0,07 |
| 3,375 % fällig am 14.07.2027 | | 2.000 | 1.725 | 0,11 |
| **New Immo Holding S.A.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 26.11.2026 | | 9.100 | 7.952 | 0,49 |
| **Nexi SpA** | | | | |
| 2,125 % fällig am 30.04.2029 | | 6.000 | 4.207 | 0,26 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.10.2043 | DKK | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 169.952 | 17.580 | 1,09 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 128.473 | 13.453 | 0,84 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Nova Kreditna Banka Maribor d.d.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 27.01.2025 | € | 2.500 | 2.361 | 0,15 |
| **Nova Ljubljanska Banka d.d.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 05.02.2030 | | 1.200 | 1.056 | 0,07 |
| 3,650 % fällig am 19.11.2029 | | 2.000 | 1.780 | 0,11 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.10.2043 | DKK | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 336.997 | 34.379 | 2,13 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 241.533 | 24.912 | 1,55 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 361 | 44 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2036 | | 10 | 1 | 0,00 |
| **P3 Group SARL** | | | | |
| 1,625 % fällig am 26.01.2029 | € | 9.800 | 7.248 | 0,45 |
| **Peugeot Invest** | | | | |
| 1,875 % fällig am 30.10.2026 | | 3.200 | 2.953 | 0,18 |
| **Prologis International Funding S.A.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 01.06.2031 | | 1.600 | 1.505 | 0,09 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.04.2036 | DKK | 12 | 2 | 0,00 |
| **Sagax AB** | | | | |
| 1,125 % fällig am 30.01.2027 | € | 7.082 | 5.964 | 0,37 |
| 2,000 % fällig am 17.01.2024 | | 1.400 | 1.371 | 0,08 |
| 2,250 % fällig am 13.03.2025 | | 5.100 | 4.851 | 0,30 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Sagax Euro MTN NL BV** | | | | |
| 0,750 % fällig am 26.01.2028 | € | 1.400 | € 1.079 | 0,07 |
| 1,000 % fällig am 17.05.2029 | | 1.700 | 1.255 | 0,08 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 0,603 % fällig am 13.09.2029 | | 7.500 | 6.142 | 0,38 |
| 2,896 % fällig am 15.03.2032 | $ | 13.185 | 10.475 | 0,65 |
| **Seazen Group Ltd.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 12.08.2024 | | 600 | 344 | 0,02 |
| **Sirius Real Estate Ltd.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 22.06.2026 | € | 3.700 | 3.200 | 0,20 |
| 1,750 % fällig am 24.11.2028 | | 3.500 | 2.714 | 0,17 |
| **Sitka Holdings LLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 06.07.2026 | $ | 1.400 | 1.296 | 0,08 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 0,875 % fällig am 22.09.2028 | € | 600 | 524 | 0,03 |
| 2,226 % fällig am 21.01.2026 | $ | 11.000 | 9.816 | 0,61 |
| 2,797 % fällig am 19.01.2028 | | 10.800 | 9.233 | 0,57 |
| **Sofina S.A.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 23.09.2028 | € | 7.400 | 5.827 | 0,36 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 0,800 % fällig am 17.11.2029 | | 2.300 | 1.895 | 0,12 |
| 1,822 % fällig am 23.11.2025 | $ | 1.100 | 975 | 0,06 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 26.04.2024 ^ | | 2.200 | 321 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 26.01.2026 ^ | | 4.200 | 596 | 0,04 |
| **TP ICAP Finance PLC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 18.11.2028 | £ | 13.400 | 12.833 | 0,80 |
| 5,250 % fällig am 29.05.2026 | | 3.700 | 4.204 | 0,26 |
| **UBS AG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (g) | $ | 6.200 | 5.929 | 0,37 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (g) | | 4.250 | 4.077 | 0,25 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 1,200 % fällig am 20.01.2026 | € | 300 | 279 | 0,02 |
| 1,982 % fällig am 03.06.2027 | $ | 500 | 414 | 0,03 |
| 2,200 % fällig am 22.07.2027 | € | 1.400 | 1.279 | 0,08 |
| 3,127 % fällig am 03.06.2032 | $ | 6.000 | 4.483 | 0,28 |
| **Virgin Money UK PLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 24.06.2025 | € | 5.200 | 5.150 | 0,32 |
| 3,375 % fällig am 24.04.2026 | £ | 300 | 332 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 25.09.2026 | | 1.300 | 1.461 | 0,09 |
| **Vonovia Finance BV** | | | | |
| 5,000 % fällig am 02.10.2023 | $ | 100 | 96 | 0,01 |
| **WPC Eurobond BV** | | | | |
| 1,350 % fällig am 15.04.2028 | € | 7.000 | 5.869 | 0,36 |
| **Yango Justice International Ltd.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 04.09.2024 ^ | $ | 12.600 | 1.055 | 0,07 |
| **ZF Finance GmbH** | | | | |
| 2,250 % fällig am 03.05.2028 | € | 5.800 | 4.276 | 0,27 |
| | | | 671.655 | 41,71 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.07.2043 | £ | 2.400 | 2.733 | 0,17 |
| 4,875 % fällig am 31.07.2043 | | 2.400 | 2.774 | 0,17 |
| 5,500 % fällig am 31.07.2050 | | 4.510 | 5.122 | 0,32 |
| **Accor S.A.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 29.11.2028 | € | 9.600 | 7.650 | 0,48 |
| **Altice Financing S.A.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.01.2028 | | 2.200 | 1.649 | 0,10 |
| 4,250 % fällig am 15.08.2029 | | 300 | 227 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 15.08.2029 | $ | 6.000 | 4.622 | 0,29 |
| **Altice France Holding S.A.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 15.05.2027 | € | 3.000 | 2.475 | 0,15 |
| **Altice France S.A.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.01.2028 | | 5.000 | 3.758 | 0,23 |
| **Atlantia SpA** | | | | |
| 1,875 % fällig am 13.07.2027 | | 1.500 | 1.224 | 0,08 |
| 1,875 % fällig am 12.02.2028 | | 11.500 | 8.982 | 0,56 |
| **Chanel Ceres PLC** | | | | |
| 0,500 % fällig am 31.07.2026 | | 1.900 | 1.742 | 0,11 |
| 1,000 % fällig am 31.07.2031 | | 1.700 | 1.406 | 0,09 |
| **DAE Funding LLC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 15.02.2024 | $ | 3.500 | 3.173 | 0,20 |
| 2,625 % fällig am 20.03.2025 | | 2.300 | 2.049 | 0,13 |
| 3,375 % fällig am 20.03.2028 | | 2.600 | 2.191 | 0,14 |
| **Delta Air Lines, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 20.10.2025 | | 1.100 | 1.023 | 0,06 |
| **easyJet FinCo BV** | | | | |
| 1,875 % fällig am 03.03.2028 | € | 6.500 | € 5.256 | 0,33 |
| **Fortune Star BVI Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 02.10.2026 | | 15.100 | 9.004 | 0,56 |
| **Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide** | | | | |
| 1,625 % fällig am 09.07.2024 | | 8.000 | 7.751 | 0,48 |
| 2,125 % fällig am 09.07.2027 | | 11.500 | 10.502 | 0,65 |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 2,949 % fällig am 24.01.2024 | | 500 | 163 | 0,01 |
| **GN Store Nord A/S** | | | | |
| 0,875 % fällig am 25.11.2024 | | 4.500 | 4.261 | 0,26 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK)** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2025 (b) | | 10.200 | 8.919 | 0,55 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.09.2026 (b) | | 6.100 | 5.074 | 0,32 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,875% bar oder 4,625 % PIK)** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.05.2027 (b) | | 6.300 | 4.928 | 0,31 |
| **IMCD NV** | | | | |
| 2,500 % fällig am 26.03.2025 | | 8.530 | 7.959 | 0,49 |
| **INEOS Finance PLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 01.05.2026 | | 6.700 | 5.867 | 0,36 |
| **Informa PLC** | | | | |
| 1,250 % fällig am 22.04.2028 | | 8.000 | 7.014 | 0,44 |
| **Jaguar Land Rover Automotive PLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.03.2023 | £ | 7.000 | 7.835 | 0,49 |
| 5,875 % fällig am 15.11.2024 | € | 300 | 277 | 0,02 |
| **James Hardie International Finance DAC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.10.2026 | | 1.000 | 927 | 0,06 |
| **John Lewis PLC** | | | | |
| 6,125 % fällig am 21.01.2025 | £ | 2.470 | 2.966 | 0,18 |
| **Las Vegas Sands Corp.** | | | | |
| 2,900 % fällig am 25.06.2025 | $ | 1.600 | 1.367 | 0,09 |
| **Loxam S.A.S.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 14.01.2025 | € | 16.800 | 15.203 | 0,94 |
| **Marks & Spencer PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 10.07.2027 | £ | 3.700 | 3.677 | 0,23 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | |
| 1,738 % fällig am 15.12.2030 | | 495 | 545 | 0,03 |
| 2,279 % fällig am 15.12.2030 | $ | 855 | 756 | 0,05 |
| **Nissan Motor Co. Ltd.** | | | | |
| 2,652 % fällig am 17.03.2026 | € | 11.400 | 10.662 | 0,66 |
| 3,201 % fällig am 17.09.2028 | | 900 | 802 | 0,05 |
| 3,522 % fällig am 17.09.2025 | $ | 3.400 | 3.082 | 0,19 |
| 4,345 % fällig am 17.09.2027 | | 1.200 | 1.055 | 0,07 |
| **Organon & Co.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 30.04.2028 | € | 1.200 | 1.009 | 0,06 |
| **Pinnacle Bidco PLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.02.2025 | | 200 | 181 | 0,01 |
| 6,375 % fällig am 15.02.2025 | £ | 800 | 834 | 0,05 |
| **Q-Park Holding BV** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.03.2025 | € | 1.900 | 1.653 | 0,10 |
| 3,500 % fällig am 01.02.2025 | | 7.800 | 7.079 | 0,44 |
| **Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd.** | | | | |
| 5,838 % fällig am 30.09.2027 | $ | 217 | 217 | 0,01 |
| **RCS & RDS S.A.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 05.02.2025 | € | 1.200 | 1.061 | 0,07 |
| **Renault S.A.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 24.06.2025 | | 12.100 | 10.530 | 0,65 |
| 2,375 % fällig am 25.05.2026 | | 3.100 | 2.665 | 0,17 |
| **Roadster Finance DAC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 09.12.2029 | | 200 | 174 | 0,01 |
| 2,375 % fällig am 08.12.2032 | | 400 | 333 | 0,02 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 2,550 % fällig am 08.03.2027 | $ | 1.000 | 698 | 0,04 |
| 3,800 % fällig am 08.01.2026 | | 2.900 | 2.227 | 0,14 |
| 5,125 % fällig am 08.08.2025 | | 1.700 | 1.367 | 0,09 |
| **Schaeffler AG** | | | | |
| 3,375 % fällig am 12.10.2028 | € | 200 | 163 | 0,01 |
| **Silfin NV** | | | | |
| 2,875 % fällig am 11.04.2027 | | 2.300 | 1.679 | 0,10 |
| **Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA** | | | | |
| 3,500 % fällig am 09.10.2025 | | 17.800 | 17.832 | 1,11 |
| **Standard Industries, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 21.11.2026 | | 9.500 | 7.461 | 0,46 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 3,375 % fällig am 16.04.2026 | | 13.600 | 13.439 | 0,83 |
| 4,892 % fällig am 24.04.2025 | $ | 8.225 | 7.895 | 0,49 |
| **TDF Infrastructure SASU** | | | | |
| 1,750 % fällig am 01.12.2029 | € | 6.200 | € 5.133 | 0,32 |
| **Travis Perkins PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 07.09.2023 | £ | 790 | 880 | 0,05 |
| **Ubisoft Entertainment S.A.** | | | | |
| 0,878 % fällig am 24.11.2027 | € | 8.600 | 7.105 | 0,44 |
| 1,289 % fällig am 30.01.2023 | | 6.900 | 6.902 | 0,43 |
| **UCB S.A.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 30.03.2028 | | 1.900 | 1.636 | 0,10 |
| **Verallia S.A.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 10.11.2031 | | 4.100 | 3.068 | 0,19 |
| **Vilmorin & Cie S.A.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 26.03.2028 | | 3.300 | 2.563 | 0,16 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.08.2030 | £ | 1.000 | 928 | 0,06 |
| 4,250 % fällig am 15.01.2030 | | 900 | 845 | 0,05 |
| **Vmed O2 UK Financing PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 31.01.2029 | | 200 | 185 | 0,01 |
| **Volvo Car AB** | | | | |
| 4,250 % fällig am 31.05.2028 | € | 4.700 | 4.400 | 0,27 |
| **Worley U.S. Finance Sub Ltd.** | | | | |
| 0,875 % fällig am 09.06.2026 | | 12.900 | 11.566 | 0,72 |
| **ZF Europe Finance BV** | | | | |
| 3,000 % fällig am 23.10.2029 | | 2.100 | 1.538 | 0,10 |
| **ZF Finance GmbH** | | | | |
| 3,750 % fällig am 21.09.2028 | | 2.000 | 1.577 | 0,10 |
| | | | 305.475 | 18,97 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **Enel Finance International NV** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.06.2025 | $ | 600 | 568 | 0,03 |
| **Global Switch Holdings Ltd.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 31.01.2024 | € | 1.500 | 1.464 | 0,09 |
| 2,250 % fällig am 31.05.2027 | | 500 | 464 | 0,03 |
| **TDC Net A/S** | | | | |
| 5,056 % fällig am 31.05.2028 | | 2.100 | 1.968 | 0,12 |
| | | | 4.464 | 0,27 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 981.594 | 60,95 |
| **WANDELANLEIHEN & WECHSEL** | | | | |
| **Corestate Capital Holding S.A.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 28.11.2022 | | 7.800 | 2.029 | 0,13 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | | |
| 1,396 % fällig am 25.11.2046 | $ | 456 | 142 | 0,01 |
| **Atlas Funding PLC** | | | | |
| 1,388 % fällig am 25.07.2058 | £ | 796 | 916 | 0,06 |
| **Banc of America Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,984 % fällig am 25.06.2037 | $ | 246 | 177 | 0,01 |
| 5,016 % fällig am 25.06.2037 ^(a) | | 268 | 30 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.10.2033 | | 215 | 200 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2046 ^ | | 258 | 216 | 0,01 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 1,992 % fällig am 20.10.2036 | | 76 | 57 | 0,00 |
| 2,044 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 66 | 60 | 0,00 |
| 2,245 % fällig am 20.11.2035 ^ | | 76 | 65 | 0,00 |
| 2,745 % fällig am 20.04.2035 ^ | | 77 | 68 | 0,01 |
| 2,872 % fällig am 20.09.2046 ^ | | 29 | 27 | 0,00 |
| 3,080 % fällig am 20.09.2046 ^ | | 40 | 34 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 314 | 265 | 0,02 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 10 | 8 | 0,00 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 3,207 % fällig am 26.03.2037 | | 59 | 46 | 0,00 |
| 3,277 % fällig am 27.03.2037 | | 261 | 212 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2034 ^ | | 13 | 11 | 0,00 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,116 % fällig am 25.12.2046 ^ | | 216 | 176 | 0,01 |
| 3,023 % fällig am 25.02.2035 | | 9 | 8 | 0,00 |
| 3,433 % fällig am 25.08.2035 | | 5 | 4 | 0,00 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 3,011 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 159 | 70 | 0,01 |
| 3,232 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 69 | 40 | 0,00 |
| 3,297 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 370 | 218 | 0,01 |
| 4,307 % fällig am 25.07.2035 ^ | | 357 | 266 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 25.11.2034 ^ | $ | 191 | € | 163 | 0,01 |
| **Bear Stearns Mortgage Funding Trust** | | | | | |
| 7,500 % fällig am 25.08.2036 | | 6 | | 6 | 0,00 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | | | |
| 2,839 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 229 | | 191 | 0,01 |
| 3,137 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 25 | | 23 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 99 | | 53 | 0,00 |
| **ChaseFlex Trust** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 72 | | 45 | 0,00 |
| **ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | | |
| 4,149 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 24 | | 20 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,943 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 174 | | 143 | 0,01 |
| 3,207 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 40 | | 34 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 | | 114 | | 66 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 25.11.2037 | | 139 | | 70 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | | |
| 1,954 % fällig am 25.12.2034 | | 6 | | 5 | 0,00 |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 239 | | 207 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 408 | | 355 | 0,02 |
| **Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust** | | | | | |
| 5,665 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 58 | | 31 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 50 | | 29 | 0,00 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | | |
| 2,255 % fällig am 25.09.2034 | | 4 | | 4 | 0,00 |
| 3,316 % fällig am 25.05.2036 | | 12 | | 9 | 0,00 |
| 3,473 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 63 | | 54 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 | | 79 | | 52 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 65 | | 38 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 50 | | 33 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.04.2047 ^ | | 101 | | 67 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 215 | | 111 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 | | 159 | | 98 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 203 | | 132 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 62 | | 38 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 786 | | 399 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 316 | | 187 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 1.409 | | 772 | 0,05 |
| 6,250 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 20 | | 10 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 62 | | 33 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 354 | | 170 | 0,01 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | | |
| 2,104 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 173 | | 144 | 0,01 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | | |
| 2,224 % fällig am 25.03.2035 | | 263 | | 186 | 0,01 |
| 2,244 % fällig am 25.03.2035 | | 17 | | 15 | 0,00 |
| 2,364 % fällig am 25.02.2035 | | 195 | | 163 | 0,01 |
| 2,818 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 35 | | 31 | 0,00 |
| 2,920 % fällig am 25.09.2047 ^ | | 75 | | 65 | 0,00 |
| 2,981 % fällig am 20.09.2036 ^ | | 24 | | 21 | 0,00 |
| 3,127 % fällig am 20.12.2035 ^ | | 67 | | 62 | 0,00 |
| 3,238 % fällig am 20.02.2036 | | 149 | | 136 | 0,01 |
| 3,288 % fällig am 25.11.2037 | | 95 | | 82 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 72 | | 40 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 98 | | 52 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 15 | | 9 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 | | 162 | | 82 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 269 | | 119 | 0,01 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | | |
| 2,774 % fällig am 25.09.2034 ^ | | 37 | | 39 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 168 | | 114 | 0,01 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust** | | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 1.201 | | 333 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | | 197 | | 113 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.10.2021 ^ | | 199 | | 25 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.02.2022 ^ | | 513 | | 66 | 0,01 |
| **Deutsche ALT-A Securities, Inc.** | | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.04.2037 | | 201 | | 135 | 0,01 |
| **Dutch Property Finance BV** | | | | | |
| 0,320 % fällig am 28.10.2059 | € | 7.400 | | 7.307 | 0,45 |
| **EuroMASTR PLC** | | | | | |
| 1,789 % fällig am 15.06.2040 | £ | 135 | | 148 | 0,01 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | | | |
| 2,538 % fällig am 25.04.2036 ^ | $ | 61 | | 52 | 0,00 |
| 3,309 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 155 | | 88 | 0,01 |
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust** | | | | | |
| 3,009 % fällig am 25.11.2037 ^ | | 32 | | 28 | 0,00 |
| **GSC Capital Corp. Mortgage Trust** | | | | | |
| 1,984 % fällig am 25.05.2036 ^ | $ | 74 | € | 67 | 0,01 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.06.2035 | | 113 | | 108 | 0,01 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,591 % fällig am 19.12.2035 ^ | | 20 | | 18 | 0,00 |
| 2,888 % fällig am 19.12.2035 ^ | | 89 | | 52 | 0,00 |
| 3,533 % fällig am 19.06.2036 ^ | | 105 | | 63 | 0,00 |
| **Hops Hill No. 1 PLC** | | | | | |
| 1,922 % fällig am 27.05.2054 | £ | 979 | | 1.132 | 0,07 |
| **HSI Asset Loan Obligation Trust** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^ | $ | 81 | | 69 | 0,01 |
| **Impac Secured Assets Trust** | | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.11.2036 | | 107 | | 100 | 0,01 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,344 % fällig am 25.01.2035 | | 50 | | 39 | 0,00 |
| 2,916 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 92 | | 80 | 0,01 |
| 2,981 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 1.120 | | 789 | 0,05 |
| 3,080 % fällig am 25.06.2036 | | 43 | | 38 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.11.2037 ^ | | 42 | | 21 | 0,00 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | | | |
| 1,523 % fällig am 27.06.2037 | | 187 | | 139 | 0,01 |
| 2,104 % fällig am 25.10.2036 | | 3.152 | | 2.820 | 0,18 |
| 2,693 % fällig am 25.12.2036 | | 6 | | 5 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 190 | | 122 | 0,01 |
| 6,550 % fällig am 25.05.2036 | | 5 | | 4 | 0,00 |
| **Jubilee Place BV** | | | | | |
| 0,402 % fällig am 17.01.2059 | € | 6.193 | | 6.156 | 0,38 |
| 0,552 % fällig am 17.10.2057 | | 1.753 | | 1.731 | 0,11 |
| **Lavender Trust** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 26.10.2036 | $ | 170 | | 99 | 0,01 |
| **Lehman Mortgage Trust** | | | | | |
| 4,878 % fällig am 25.12.2035 | | 162 | | 39 | 0,00 |
| 5,101 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 53 | | 50 | 0,00 |
| **Lehman XS Trust** | | | | | |
| 1,984 % fällig am 25.12.2036 | | 804 | | 762 | 0,05 |
| **Mansard Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,529 % fällig am 15.12.2049 | £ | 55 | | 63 | 0,00 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | | | |
| 2,660 % fällig am 25.03.2035 | $ | 15 | | 14 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 133 | | 109 | 0,01 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | | |
| 2,606 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 284 | | 158 | 0,01 |
| **Miravet SARL** | | | | | |
| 0,494 % fällig am 26.05.2065 | € | 6.144 | | 6.162 | 0,38 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 3,118 % fällig am 25.03.2036 ^ | $ | 128 | | 91 | 0,01 |
| 5,962 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 4.550 | | 1.516 | 0,10 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2037 ^ | | 112 | | 71 | 0,01 |
| **Newgate Funding PLC** | | | | | |
| 0,319 % fällig am 15.12.2050 | € | 226 | | 221 | 0,01 |
| 2,589 % fällig am 15.12.2050 | £ | 179 | | 199 | 0,01 |
| **Primrose Residential DAC** | | | | | |
| 0,488 % fällig am 24.10.2061 | € | 5.324 | | 5.263 | 0,33 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | | |
| 2,044 % fällig am 25.06.2037 | $ | 54 | | 49 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 64 | | 53 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 50 | | 43 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 138 | | 111 | 0,01 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.02.2036 | | 323 | | 154 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 | | 145 | | 68 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036 | | 121 | | 51 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 98 | | 38 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 670 | | 425 | 0,03 |
| 6,250 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 83 | | 36 | 0,00 |
| **Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 41 | | 35 | 0,00 |
| **RMAC Securities PLC** | | | | | |
| 1,041 % fällig am 12.06.2044 | £ | 475 | | 520 | 0,03 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,872 % fällig am 25.10.2035 ^ | $ | 160 | | 141 | 0,01 |
| 2,945 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 63 | | 51 | 0,00 |
| **SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,113 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 82 | | 69 | 0,01 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | | |
| 1,902 % fällig am 12.06.2053 | £ | 4.051 | | 4.708 | 0,29 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | | |
| 2,404 % fällig am 25.10.2044 | $ | 65 | € | 57 | 0,00 |
| 2,867 % fällig am 25.12.2035 | | 12 | | 11 | 0,00 |
| 3,052 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 276 | | 242 | 0,02 |
| 3,201 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 45 | | 40 | 0,00 |
| 3,331 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 33 | | 29 | 0,00 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | | |
| 1,246 % fällig am 25.04.2047 | | 387 | | 308 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 103 | | 75 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 27 | | 25 | 0,00 |
| **Wells Fargo Alternative Loan Trust** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 25.11.2037 ^ | | 36 | | 31 | 0,00 |
| | | | | 52.359 | 3,25 |

## FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Accunia European CLO DAC** | | | | | |
| 0,950 % fällig am 15.07.2030 | € | 718 | | 708 | 0,04 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 1,734 % fällig am 25.12.2036 | $ | 422 | | 122 | 0,01 |
| 1,904 % fällig am 25.07.2036 | | 113 | | 91 | 0,01 |
| **ALME Loan Funding DAC** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.01.2032 | € | 292 | | 286 | 0,02 |
| **Aqueduct European CLO DAC** | | | | | |
| 0,640 % fällig am 20.07.2030 | | 3.378 | | 3.329 | 0,21 |
| **Ares European CLO DAC** | | | | | |
| 1,120 % fällig am 21.10.2033 | | 18.500 | | 18.171 | 1,13 |
| **Argent Securities Trust** | | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.09.2036 | $ | 877 | | 307 | 0,02 |
| 1,824 % fällig am 25.06.2036 | | 470 | | 142 | 0,01 |
| **Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | | |
| 2,264 % fällig am 25.01.2036 | | 508 | | 453 | 0,03 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.06.2037 | | 77 | | 62 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.03.2034 ^ | | 122 | | 112 | 0,01 |
| **Aurium CLO DAC** | | | | | |
| 0,670 % fällig am 16.04.2030 | € | 2.094 | | 2.061 | 0,13 |
| **Bain Capital Euro DAC** | | | | | |
| 1,100 % fällig am 24.01.2033 | | 400 | | 392 | 0,02 |
| **Bastille Euro CLO DAC** | | | | | |
| 1,150 % fällig am 15.01.2034 | | 16.200 | | 15.779 | 0,98 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | | |
| 2,890 % fällig am 25.10.2036 | $ | 35 | | 21 | 0,00 |
| **Black Diamond CLO DAC** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 03.10.2029 | € | 225 | | 225 | 0,01 |
| **BlueMountain Fuji EUR CLO DAC** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 15.07.2030 | | 2.240 | | 2.206 | 0,14 |
| 0,910 % fällig am 15.01.2033 | | 2.300 | | 2.213 | 0,14 |
| **BNPP AM Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 15.10.2031 | | 1.135 | | 1.117 | 0,07 |
| **BNPP IP Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,790 % fällig am 15.10.2030 | | 1.000 | | 984 | 0,06 |
| **Bosphorus CLO DAC** | | | | | |
| 0,820 % fällig am 15.12.2030 | | 1.100 | | 1.078 | 0,07 |
| **Cairn CLO DAC** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 20.10.2028 | | 282 | | 280 | 0,02 |
| 0,670 % fällig am 31.01.2030 | | 4.417 | | 4.344 | 0,27 |
| 0,790 % fällig am 25.07.2029 | | 2.756 | | 2.728 | 0,17 |
| **Carlyle Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,630 % fällig am 15.08.2030 | | 6.384 | | 6.260 | 0,39 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 1,884 % fällig am 25.02.2037 | $ | 153 | | 137 | 0,01 |
| **Centex Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 2,674 % fällig am 25.10.2035 | | 4.024 | | 3.670 | 0,23 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 6,851 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 134 | | 53 | 0,00 |
| **Contego CLO BV** | | | | | |
| 0,770 % fällig am 15.10.2030 | € | 1.300 | | 1.272 | 0,08 |
| **Contego CLO DAC** | | | | | |
| 0,640 % fällig am 23.01.2030 | | 5.544 | | 5.451 | 0,34 |
| **CVC Cordatus Loan Fund DAC** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 21.07.2030 | | 11.087 | | 10.943 | 0,68 |
| 0,780 % fällig am 15.08.2032 | | 200 | | 196 | 0,01 |
| 0,890 % fällig am 26.08.2032 | | 500 | | 485 | 0,03 |
| 0,900 % fällig am 17.06.2032 | | 1.300 | | 1.260 | 0,08 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Dryden Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.05.2032 | € | 600 | € | 582 | 0,04 |
| 0,860 % fällig am 15.05.2034 | | 300 | | 290 | 0,02 |
| **First NLC Trust** | | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.08.2037 | $ | 146 | | 79 | 0,00 |
| 1,904 % fällig am 25.08.2037 | | 49 | | 27 | 0,00 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.01.2037 | | 225 | | 103 | 0,01 |
| 1,784 % fällig am 25.08.2036 | | 191 | | 68 | 0,00 |
| 1,964 % fällig am 25.02.2037 | | 679 | | 252 | 0,02 |
| **Grosvenor Place CLO BV** | | | | | |
| 0,720 % fällig am 30.10.2029 | € | 1.158 | | 1.153 | 0,07 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | | | |
| 5,772 % fällig am 25.11.2036 ^ | $ | 130 | | 43 | 0,00 |
| **GSAMP Trust** | | | | | |
| 1,724 % fällig am 25.12.2046 | | 195 | | 99 | 0,01 |
| 1,764 % fällig am 25.12.2036 | | 883 | | 484 | 0,03 |
| 1,774 % fällig am 25.12.2046 | | 536 | | 273 | 0,02 |
| 1,824 % fällig am 25.11.2036 | | 200 | | 102 | 0,01 |
| 1,854 % fällig am 25.12.2046 | | 97 | | 50 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.09.2036 | | 370 | | 143 | 0,01 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | € | 269 | | 268 | 0,02 |
| 0,640 % fällig am 15.10.2031 | | 1.400 | | 1.368 | 0,08 |
| 0,730 % fällig am 15.01.2031 | | 1.000 | | 982 | 0,06 |
| 0,870 % fällig am 18.11.2030 | | 2.338 | | 2.310 | 0,14 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | | | |
| 1,844 % fällig am 25.12.2036 | $ | 202 | | 62 | 0,00 |
| 1,964 % fällig am 25.12.2036 | | 972 | | 299 | 0,02 |
| 2,064 % fällig am 25.12.2036 | | 562 | | 173 | 0,01 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.** | | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.06.2035 | | 4.968 | | 4.562 | 0,28 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | | |
| 6,337 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 94 | | 61 | 0,00 |
| **Jubilee CLO DAC** | | | | | |
| 0,391 % fällig am 12.07.2028 | € | 329 | | 330 | 0,02 |
| 0,519 % fällig am 15.12.2029 | | 1.944 | | 1.923 | 0,12 |
| **Lehman XS Trust** | | | | | |
| 1,794 % fällig am 25.02.2037 ^ | $ | 1.068 | | 892 | 0,06 |
| **Mackay Shields Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,930 % fällig am 20.10.2032 | € | 1.300 | | 1.260 | 0,08 |
| **Man GLG Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,870 % fällig am 15.01.2030 | | 4.495 | | 4.452 | 0,28 |
| **Marlay Park CLO DAC** | | | | | |
| 0,740 % fällig am 15.10.2030 | | 1.400 | | 1.381 | 0,09 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | | |
| 1,724 % fällig am 25.11.2036 | $ | 139 | | 50 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.08.2036 | | 247 | | 101 | 0,01 |
| 2,104 % fällig am 25.06.2036 | | 135 | | 57 | 0,00 |
| 2,104 % fällig am 25.08.2036 | | 148 | | 61 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.11.2037 | | 647 | | 255 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | | |
| 1,734 % fällig am 25.02.2037 | | 495 | | 164 | 0,01 |
| 1,754 % fällig am 25.01.2037 | | 103 | | 52 | 0,00 |
| 1,764 % fällig am 25.10.2036 | | 112 | | 54 | 0,00 |
| 1,804 % fällig am 25.03.2037 | $ | 336 | € | 154 | 0,01 |
| 1,824 % fällig am 25.09.2036 | | 57 | | 22 | 0,00 |
| 1,824 % fällig am 25.02.2037 | | 115 | | 62 | 0,00 |
| 1,874 % fällig am 25.03.2037 | | 336 | | 154 | 0,01 |
| 1,924 % fällig am 25.09.2036 | | 338 | | 131 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.06.2033 | | 8 | | 7 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 1,794 % fällig am 25.04.2037 | | 276 | | 151 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 6,465 % fällig am 25.09.2046 ^ | | 302 | | 127 | 0,01 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 6,032 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 158 | | 42 | 0,00 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.06.2036 | | 90 | | 68 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.09.2036 | | 155 | | 71 | 0,00 |
| 1,944 % fällig am 25.05.2036 | | 351 | | 328 | 0,02 |
| **Oak Hill European Credit Partners DAC** | | | | | |
| 0,730 % fällig am 20.01.2032 | € | 3.196 | | 3.143 | 0,20 |
| **Oak Hill European Credit Partners Ltd.** | | | | | |
| 0,900 % fällig am 22.07.2030 | | 2.059 | | 2.045 | 0,13 |
| **OCP Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,820 % fällig am 15.01.2032 | | 4.750 | | 4.686 | 0,29 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 1,844 % fällig am 25.01.2037 | $ | 269 | | 161 | 0,01 |
| 1,954 % fällig am 25.04.2037 | | 102 | | 51 | 0,00 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** | | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.10.2031 | € | 5.900 | | 5.780 | 0,36 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | | |
| 2,359 % fällig am 25.08.2035 | $ | 460 | | 432 | 0,03 |
| **Purple Finance CLO DAC** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 20.04.2032 | € | 1.200 | | 1.169 | 0,07 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 3,424 % fällig am 25.09.2037 | $ | 161 | | 133 | 0,01 |
| 5,879 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 3.494 | | 1.138 | 0,07 |
| 7,238 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 220 | | 104 | 0,01 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | | |
| 1,884 % fällig am 25.11.2036 | | 818 | | 712 | 0,04 |
| **Rockford Tower Europe CLO DAC** | | | | | |
| 1,030 % fällig am 20.12.2031 | € | 600 | | 587 | 0,04 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | | |
| 1,804 % fällig am 25.07.2036 | $ | 197 | | 74 | 0,00 |
| 1,944 % fällig am 25.07.2036 | | 193 | | 73 | 0,00 |
| 2,104 % fällig am 25.07.2036 | | 165 | | 63 | 0,00 |
| 2,124 % fällig am 25.05.2036 | | 699 | | 393 | 0,02 |
| **Segovia European CLO DAC** | | | | | |
| 0,770 % fällig am 18.01.2031 | € | 300 | | 294 | 0,02 |
| 0,880 % fällig am 20.07.2032 | | 1.100 | | 1.069 | 0,07 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | | |
| 1,734 % fällig am 25.02.2037 | $ | 273 | | 79 | 0,00 |
| 1,804 % fällig am 25.02.2037 | | 404 | | 118 | 0,01 |
| 1,904 % fällig am 25.06.2037 | | 147 | | 102 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.09.2037 | | 70 | | 49 | 0,00 |
| **St Paul's CLO DAC** | | | | | |
| 0,760 % fällig am 17.01.2030 | € | 1.499 | | 1.472 | 0,09 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.09.2036 | $ | 38 | € | 35 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 3,374 % fällig am 25.04.2031 | | 1.879 | | 1.763 | 0,11 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | | |
| 0,740 % fällig am 15.10.2030 | € | 1.200 | | 1.180 | 0,07 |
| 0,920 % fällig am 15.07.2030 | | 2.748 | | 2.715 | 0,17 |
| 0,920 % fällig am 12.01.2032 | | 9.200 | | 8.937 | 0,56 |
| **Voya Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.10.2030 | | 4.300 | | 4.230 | 0,26 |
| | | | | 155.907 | 9,68 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Ivory Coast Government International Bond** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 22.03.2030 | | 6.000 | | 4.716 | 0,29 |
| **Russia Government International Bond** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 04.12.2025 | | 14.200 | | 3.763 | 0,23 |
| **Ukraine Government International Bond** | | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.09.2023 | $ | 6.500 | | 2.021 | 0,13 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 22.07.2022 | £ | 7.200 | | 8.362 | 0,52 |
| | | | | 18.862 | 1,17 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | | |
| **FRANCE TREASURY BILLS** | | | | | |
| (0,448) % fällig am 14.09.2022 (c)(d) | € | 1.400 | | 1.402 | 0,09 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | | 1.402 | 0,09 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | | **€ 1.296.270** | **80,49** |
| | | **AKTIEN** | | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (f)** | | 1.694.264 | | 15.841 | 0,99 |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (f)** | | 4.046.416 | | 38.512 | 2,39 |
| | | | | 54.353 | 3,38 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (f)** | | 1.089.000 | | 103.912 | 6,45 |
| **Summe Investmentfonds** | | | | **€ 158.265** | **9,83** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| IND | (0,750) % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | € 69.400 | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 1,500 % fällig am 25.05.2032 | € (4.894) | € 69.400 | € 69.399 | 4,31 |
| | | | | | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % - 0,125 % fällig am 30.04.2027 - 09.01.2032 | (31.394) | | | |
| | | | | | SNCF Reseau 0,750 % - 2,450 % fällig am 28.02.2023 - 25.05.2036 | (29.865) | | | |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **€ (66.153)** | **€ 69.400** | **€ 69.399** | **4,31** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

### FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Schatz September Futures | Short | 09.2022 | 4.432 | € 1.681 | 0,10 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 328 | (523) | (0,03) |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09.2022 | 36 | 171 | 0,01 |
| | | | | € 1.329 | 0,08 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **€ 1.329** | **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 | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 13.000 | € (115) | (0,01) |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.06.2026 | 9.700 | (166) | (0,01) |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.12.2025 | € 8.700 | (80) | (0,01) |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.06.2028 | 3.200 | (134) | (0,01) |
| Casino Guichard Perrachon S.A. | 5,000 | 20.12.2022 | 200 | 9 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2024 | $ 4.400 | 75 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2026 | 11.700 | (281) | (0,02) |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2026 | 1.300 | (48) | 0,00 |
| General Motors Co. | 5,000 | 20.06.2026 | 4.500 | (323) | (0,02) |
| Marks & Spencer PLC | 1,000 | 20.06.2027 | € 200 | (12) | 0,00 |
| Marks & Spencer PLC | 1,000 | 20.12.2028 | 2.100 | (238) | (0,01) |
| Stellantis NV | 5,000 | 20.06.2026 | 2.000 | (156) | (0,01) |
| Stellantis NV | 5,000 | 20.12.2026 | 5.200 | (414) | (0,03) |
| Syngenta Finance NV | 1,000 | 20.06.2028 | 800 | (44) | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 | 20.06.2028 | 12.000 | (479) | (0,03) |
| Valeo S.A. | 1,000 | 20.06.2026 | 900 | (49) | 0,00 |
| Valeo S.A. | 1,000 | 20.06.2028 | 400 | (39) | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 | 20.06.2026 | 23.300 | (1.052) | (0,06) |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 | 20.12.2026 | 3.000 | (149) | (0,01) |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 | 20.06.2028 | 4.800 | (314) | (0,02) |
| | | | | € (4.009) | (0,25) |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-38 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2027 | $ 7.500 | € (86) | (0,01) |
| iTraxx Crossover 37 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2027 | € 115.200 | (9.466) | (0,59) |
| iTraxx Europe Main 36 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 5.900 | (39) | 0,00 |
| iTraxx Europe Main 37 10-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 159.600 | (2.655) | (0,16) |
| | | | | € (12.246) | (0,76) |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 % | 21.09.2027 | £ 37.000 | € 1.373 | 0,08 |
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2032 | 49.700 | 3.969 | 0,25 |
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 1,750 | 16.03.2025 | 168.100 | (4.306) | (0,27) |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 15.03.2029 | ¥ 4.520.000 | 466 | 0,03 |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,100 | 15.03.2027 | 13.060.000 | (213) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,400 | 15.06.2032 | 4.050.000 | 29 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,500 | 15.03.2042 | 3.460.000 | 751 | 0,05 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,868 | 05.05.2032 | $ 15.100 | (1.026) | (0,06) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,040 | 25.05.2032 | 7.800 | (417) | (0,03) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,068 | 11.05.2032 | 15.400 | (794) | (0,05) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,153 | 18.05.2032 | 15.400 | (671) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,250 | 16.06.2023 | 137.100 | 3.647 | 0,23 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 15.12.2051 | 14.700 | 3.892 | 0,24 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.05.2027 | € 4.900 | (153) | (0,01) |
| | | | | | € 6.547 | 0,41 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **€ (9.708)** | **(0,60)** |

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

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

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

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

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

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 % | 20.07.2022 | 3.400 | € (5) | € (2) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Crossover 36 5-Year Index | Verkauf | 5,250 | 20.07.2022 | 2.200 | (20) | (42) | (0,01) |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 11.500 | (53) | (24) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 11.300 | (31) | (35) | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 3.100 | (5) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Kauf | 0,700 | 17.08.2022 | 3.700 | (5) | 0 | 0,00 |
| BRC | Put - OTC CDX.IG-37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 5.200 | (11) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 1.600 | (14) | (17) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 12.500 | (55) | (26) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,600 | 17.08.2022 | 2.000 | (5) | (3) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 1.400 | (2) | (1) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 2.900 | (5) | (3) | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,300 | 17.08.2022 | 3.800 | (8) | (6) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 95,000 | 17.08.2022 | 600 | (7) | (9) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 3.800 | (32) | (41) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,100 | 20.07.2022 | 6.300 | (22) | (23) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 3.000 | (8) | (11) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,250 | 20.07.2022 | 2.000 | (3) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,350 | 17.08.2022 | 3.000 | (6) | (4) | 0,00 |
| | | | | | | € (297) | € (251) | (0,01) |

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,000 % | 01.07.2022 | 22.700 | € (93) | € 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,800 | 01.07.2022 | 22.700 | (93) | (29) | 0,00 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,840 | 05.07.2022 | 20.400 | (72) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 1,520 | 05.07.2022 | 20.400 | (72) | (293) | (0,02) |
| GLM | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,870 | 02.11.2022 | 220.700 | (382) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,270 | 02.11.2022 | 220.700 | (382) | (4.839) | (0,30) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,500 | 07.02.2023 | 115.000 | (333) | (1.420) | (0,09) |
| | | | | | | | € (1.427) | € (6.583) | (0,41) |

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | ADLER Real Estate AG | 5,000 % | 20.12.2026 | € 1.200 | € (6) | € (380) | € (386) | (0,02) |
| | Hammerson PLC | 1,000 | 20.12.2022 | 3.600 | 31 | (61) | (30) | 0,00 |
| | Intrum AB | 5,000 | 20.12.2024 | 7.400 | 711 | (691) | 20 | 0,00 |
| JPM | Casino Guichard Perrachon S.A. | 5,000 | 20.12.2022 | 1.600 | 56 | (144) | (88) | (0,01) |
| | Hochtief AG | 5,000 | 20.12.2026 | 10.500 | 2.120 | (1.194) | 926 | 0,06 |
| | | | | | € 2.912 | € (2.470 ) | € 442 | 0,03 |

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

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

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs -monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | € | 887 | DKK | 6.600 | € 0 | € 0 | € 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 3.170 | € | 2.990 | 0 | (43) | (43) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 17.432 | NOK | 177.130 | 0 | (318) | (318) | (0,02) |
| | 08.2022 | IDR | 332.804 | $ | 23 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | MXN | 17.658 | | 870 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10.2022 | ZAR | 126 | | 8 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | BRL | 3.522 | | 735 | 59 | 0 | 59 | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK | 6.370 | € | 856 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 17.887 | DKK | 133.050 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 353.868 | $ | 372.313 | 2.263 | (4) | 2.259 | 0,14 |
| | 07.2022 | $ | 6.736 | € | 6.323 | 0 | (120) | (120) | (0,01) |
| | 08.2022 | CAD | 289 | | 214 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 3.761 | £ | 3.190 | 0 | (64) | (64) | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 138.207.657 | $ | 9.517 | 274 | 0 | 274 | 0,02 |
| | 08.2022 | INR | 7.007 | | 90 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 83.200 | € | 587 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 334.159 | | 317.124 | 0 | (1.918) | (1.918) | (0,12) |
| | 09.2022 | TWD | 1.332 | $ | 48 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 10.2022 | ZAR | 17.423 | | 1.054 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 11.2022 | $ | 13 | ZAR | 211 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | € | 10.743 | DKK | 79.936 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 9.609 | $ | 10.095 | 54 | (7) | 47 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 79.934 | € | 10.743 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 17.712 | AUD | 26.511 | 0 | (320) | (320) | (0,02) |
| CBK | 07.2022 | $ | 9.632 | BRL | 47.925 | 0 | (451) | (451) | (0,03) |
| DUB | 07.2022 | DKK | 1.056.319 | € | 141.966 | 0 | (76) | (76) | 0,00 |
| | 07.2022 | PLN | 120 | $ | 27 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 6.621 | £ | 5.718 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 10.2022 | $ | 12.001 | ZAR | 185.072 | 0 | (785) | (785) | (0,05) |
| GLM | 07.2022 | BRL | 44.403 | $ | 8.567 | 76 | 0 | 76 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 10.598 | MXN | 216.455 | 104 | 0 | 104 | 0,01 |
| | 08.2022 | | 8.499 | BRL | 44.403 | 0 | (81) | (81) | (0,01) |
| JPM | 07.2022 | DKK | 14.180 | € | 1.906 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 98.354 | DKK | 731.794 | 50 | 0 | 50 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 4.800 | € | 4.589 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 12.315 | $ | 1.831 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 622.854 | € | 83.711 | 0 | (46) | (46) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 3.877 | £ | 3.338 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 08.2022 | £ | 75.913 | € | 88.230 | 238 | 0 | 238 | 0,01 |
| | 08.2022 | TWD | 811 | $ | 28 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 6.508 | IDR | 95.734.676 | 0 | (110) | (110) | (0,01) |
| | 09.2022 | TWD | 1.577 | $ | 57 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | € | 2.803 | DKK | 20.845 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 28.014 | $ | 4.172 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 74.000 | € | 545 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 854 | CNH | 5.718 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 2.872 | IDR | 42.114.880 | 0 | (57) | (57) | 0,00 |
| | 05.2023 | CNH | 30.884 | $ | 4.602 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | DKK | 19.330 | € | 2.598 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 1.136 | $ | 1.220 | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 6.736 | € | 6.423 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 1.136 | £ | 970 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 08.2022 | INR | 11.769 | $ | 151 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 241 | | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 644 | | 23 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 10.2022 | ZAR | 19.028 | | 1.255 | 101 | 0 | 101 | 0,01 |
| RBC | 07.2022 | $ | 6.650 | € | 6.283 | 0 | (77) | (77) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 1.098 | ¥ | 154.300 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | $ | 900 | € | 853 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 260 | | 242 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 49.694 | $ | 7.418 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | $ | 365.025 | € | 339.619 | 0 | (9.538) | (9.538) | (0,59) |
| UAG | 07.2022 | € | 16.653 | DKK | 123.896 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 123.891 | € | 16.653 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 950 | £ | 816 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 09.2022 | MXN | 195.687 | $ | 9.821 | 227 | 0 | 227 | 0,01 |
| | | | | | | € 3.551 | € (14.125) | € (10.574) | (0,66) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **€ (16.966)** | **(1,05)** |
| **Summe Anlagen** | **€ 1.498.590** | **93,06** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **€ 111.817** | **6,94** |
| **Nettovermögen** | **€ 1.610.407** | **100,00** |

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Nullkuponwertpapier.

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

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

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Eingeschränkte Wertpapiere:

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeits-datum | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Deutsche Bank AG | 3,035 % | 28.05.2032 | 29.07.2021 | € 173 | € 152 | 0,01 |

Barmittel in Höhe von EUR 52.144 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von EUR 19.658 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 0 | € 1.296.270 | € 0 | € 1.296.270 |
| Investmentfonds | 158.265 | 0 | 0 | 158.265 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 69.400 | 0 | 69.400 |
| Finanzderivate[3] | 1.852 | (27.197) | 0 | (25.345) |
| **Summen** | **€ 160.117** | **€ 1.338.473** | **€ 0** | **€ 1.498.590** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 0 | € 2.206.773 | € 0 | € 2.206.773 |
| Investmentfonds | 95.911 | 80.957 | 0 | 176.868 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 7.551 | 0 | 7.551 |
| Finanzderivate[3] | 863 | 15.756 | (32) | 16.587 |
| **Summen** | **€ 96.774** | **€ 2.311.037** | **€ (32)** | **€ 2.407.779** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | € (463) | € 469 | € 6 |
| BPS | 501 | (330) | 171 |
| BRC | (321) | 287 | (34) |
| CBK | (774) | 1.243 | 469 |
| DUB | (856) | 737 | (119) |
| FBF | 0 | (249) | (249) |
| GLM | (6.162) | 6.763 | 601 |
| GST | (402) | 249 | (153) |
| JPM | 873 | (1.416) | (543) |
| MBC | (51) | 0 | (51) |
| MYC | (5) | 48 | 43 |
| MYI | 103 | (67) | 36 |
| RBC | (89) | 0 | (89) |
| RYL | (8) | 0 | (8) |
| SCX | 2 | 0 | 2 |
| SOG | (9.538) | 9.862 | 324 |
| UAG | 224 | (325) | (101) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 69,98 | 77,13 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 8,58 | 8,49 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 1,93 | 3,28 |
| Investmentfonds | 9,83 | 7,13 |
| Pensionsgeschäfte | 4,31 | 0,30 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,08 | 0,06 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,60) | 0,37 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (1,05) | 0,24 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | k. A. | (0,13) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 5,22 | 5,73 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 60,95 | 69,07 |
| Wandelanleihen & Wechsel | 0,13 | 0,28 |
| Non-Agency-MBS | 3,25 | 4,91 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 9,68 | 5,01 |
| Staatsemissionen | 1,17 | 3,84 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,09 | 0,06 |
| Investmentfonds | 9,83 | 7,13 |
| Pensionsgeschäfte | 4,31 | 0,30 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,08 | 0,06 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,25) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,76) | 0,03 |
| Zinsswaps | 0,41 | 0,34 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,01) | 0,00 |
| Zinsswapoptionen | (0,41) | (0,03) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,03 | 0,14 |
| Devisenterminkontrakte | (0,66) | 0,13 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 6,94 | 3,00 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Finanzanlagen des Euro Long Average Duration Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (c)(e) | € | 200 | € 193 | 0,17 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 7,125 % fällig am 29.07.2022 (c)(e) | $ | 400 | 382 | 0,33 |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 243 | 24 | 0,02 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 8.915 | 878 | 0,76 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 60 | 7 | 0,01 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 16 | 2 | 0,00 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 5.735 | 588 | 0,51 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 19 | 2 | 0,00 |
| **Nova Ljubljanska Banka d.d.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 05.02.2030 | € | 100 | 88 | 0,08 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 37.088 | 3.713 | 3,22 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 10.517 | 1.069 | 0,93 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2047 | | 1 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 2.380 | 257 | 0,22 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 23 | 3 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2053 | | 2.994 | 340 | 0,29 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2053 | | 1.100 | 138 | 0,12 |
| 3,500 % fällig am 01.10.2053 | | 6.100 | 792 | 0,69 |
| **Permanent TSB Group Holdings PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 30.06.2025 | € | 100 | 100 | 0,09 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 3.781 | 399 | 0,35 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 2.792 | 294 | 0,26 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2053 | | 2.900 | 365 | 0,32 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,269 % fällig am 15.12.2033 | € | 561 | 530 | 0,46 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 1,319 % fällig am 14.10.2023 | $ | 200 | 190 | 0,16 |
| | | | 10.354 | 8,99 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **Market Bidco Finco PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 04.11.2027 | € | 300 | 239 | 0,20 |
| **SK Hynix, Inc.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 19.01.2024 | $ | 200 | 183 | 0,16 |
| | | | 422 | 0,36 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 10.776 | 9,35 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 1,001 % fällig am 25.07.2037 | | 5 | 5 | 0,00 |
| 2,560 % fällig am 01.08.2036 | | 1 | 1 | 0,00 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.07.2048 | | 528 | 492 | 0,43 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.08.2052 | | 1.100 | 979 | 0,85 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2052 | | 1.100 | 1.011 | 0,88 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2052 | | 1.000 | 942 | 0,82 |
| | | | 3.430 | 2,98 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (b)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.01.2032 | | 1.564 | 1.421 | 1,23 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2048 | | 540 | 494 | 0,43 |
| | | | 1.915 | 1,66 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Alba PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.12.2038 | € | 225 | 212 | 0,18 |
| **Avon Finance PLC** | | | | |
| 1,690 % fällig am 20.09.2048 | £ | 598 | 691 | 0,60 |
| **Barley Hill PLC** | | | | |
| 1,892 % fällig am 27.08.2058 | £ | 166 | € 191 | 0,17 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 3,048 % fällig am 25.07.2033 | $ | 4 | 4 | 0,00 |
| **Canterbury Finance PLC** | | | | |
| 1,940 % fällig am 16.05.2057 | £ | 56 | 65 | 0,06 |
| **Charter Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,540 % fällig am 16.01.2057 | | 92 | 107 | 0,09 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,593 % fällig am 25.07.2033 | $ | 5 | 5 | 0,00 |
| **Dilosk RMBS DAC** | | | | |
| 0,382 % fällig am 20.02.2060 | € | 271 | 269 | 0,23 |
| 0,528 % fällig am 20.12.2060 | | 488 | 482 | 0,42 |
| **Dutch Property Finance BV** | | | | |
| 0,235 % fällig am 28.07.2054 | | 387 | 383 | 0,33 |
| 0,235 % fällig am 28.07.2058 | | 379 | 376 | 0,33 |
| 0,320 % fällig am 28.10.2059 | | 400 | 395 | 0,34 |
| 1,250 % fällig am 28.04.2050 | | 400 | 398 | 0,35 |
| **Eurohome UK Mortgages PLC** | | | | |
| 1,739 % fällig am 15.06.2044 | £ | 184 | 208 | 0,18 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 1,698 % fällig am 10.12.2044 | | 3 | 4 | 0,00 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | |
| 2,065 % fällig am 16.06.2070 | | 168 | 195 | 0,17 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 18.03.2039 | € | 75 | 74 | 0,06 |
| 2,193 % fällig am 18.06.2039 | $ | 27 | 25 | 0,02 |
| **Harmony French Home Loans** | | | | |
| 0,301 % fällig am 27.05.2062 | € | 600 | 598 | 0,52 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | | |
| 1,703 % fällig am 25.05.2053 | £ | 845 | 980 | 0,85 |
| **Jubilee Place BV** | | | | |
| 0,552 % fällig am 17.10.2057 | € | 130 | 128 | 0,11 |
| **Landmark Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 1,439 % fällig am 17.04.2044 | £ | 796 | 854 | 0,74 |
| 1,804 % fällig am 17.06.2039 | | 201 | 219 | 0,19 |
| **Ludgate Funding PLC** | | | | |
| 1,198 % fällig am 01.01.2061 | | 93 | 102 | 0,09 |
| 1,608 % fällig am 01.12.2060 | | 230 | 253 | 0,22 |
| **Newgate Funding PLC** | | | | |
| 0,319 % fällig am 15.12.2050 | € | 790 | 775 | 0,67 |
| **Polaris PLC** | | | | |
| 1,730 % fällig am 23.12.2058 | £ | 283 | 324 | 0,28 |
| 1,740 % fällig am 23.10.2059 | | 296 | 340 | 0,30 |
| 2,065 % fällig am 27.05.2057 | | 174 | 202 | 0,18 |
| **Precise Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,952 % fällig am 12.12.2055 | | 294 | 340 | 0,30 |
| **Primrose Residential DAC** | | | | |
| 0,238 % fällig am 24.03.2061 | € | 359 | 354 | 0,31 |
| 0,488 % fällig am 24.10.2061 | | 588 | 581 | 0,50 |
| **Ripon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,351 % fällig am 28.08.2056 | £ | 385 | 443 | 0,39 |
| **RMAC Securities PLC** | | | | |
| 1,021 % fällig am 12.06.2044 | | 216 | 239 | 0,21 |
| **Shamrock Residential DAC** | | | | |
| 0,338 % fällig am 24.12.2059 | € | 170 | 169 | 0,15 |
| **Stanlington PLC** | | | | |
| 1,702 % fällig am 12.06.2056 | £ | 286 | 324 | 0,28 |
| **Stratton Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2060 | | 644 | 742 | 0,64 |
| 1,652 % fällig am 12.03.2052 | | 228 | 262 | 0,23 |
| 1,674 % fällig am 25.09.2051 | | 349 | 404 | 0,35 |
| 1,853 % fällig am 25.05.2051 | | 67 | 78 | 0,07 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 2,095 % fällig am 19.07.2035 | $ | 14 | 13 | 0,01 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,264 % fällig am 25.09.2043 | | 21 | 20 | 0,02 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,527 % fällig am 20.05.2045 | £ | 339 | 392 | 0,34 |
| 1,605 % fällig am 20.10.2051 | | 441 | 511 | 0,44 |
| **Tower Bridge Funding PLC** | | | | |
| 1,350 % fällig am 20.12.2063 | | 200 | 228 | 0,20 |
| 1,407 % fällig am 20.11.2063 | | 471 | 540 | 0,47 |
| **Trinity Square PLC** | | | | |
| 1,300 % fällig am 15.07.2059 | | 403 | 465 | 0,40 |
| **Tudor Rose Mortgages** | | | | |
| 1,390 % fällig am 20.06.2048 | £ | 330 | € 378 | 0,33 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | |
| 2,002 % fällig am 12.12.2054 | | 171 | 197 | 0,17 |
| | | | 15.539 | 13,49 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Accunia European CLO DAC** | | | | |
| 0,930 % fällig am 15.10.2030 | € | 162 | 160 | 0,14 |
| 0,950 % fällig am 15.07.2030 | | 628 | 620 | 0,54 |
| **Aqueduct European CLO DAC** | | | | |
| 0,640 % fällig am 20.07.2030 | | 469 | 462 | 0,40 |
| **Ares European CLO DAC** | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.10.2030 | | 200 | 196 | 0,17 |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | | 900 | 880 | 0,76 |
| **Aurium CLO DAC** | | | | |
| 0,730 % fällig am 16.01.2031 | | 500 | 491 | 0,43 |
| **Auto ABS French Leases FCT** | | | | |
| 0,149 % fällig am 29.06.2033 | | 600 | 601 | 0,52 |
| **Auto ABS UK Loans PLC** | | | | |
| 1,632 % fällig am 27.11.2027 | £ | 61 | 70 | 0,06 |
| **Avoca CLO DAC** | | | | |
| 0,820 % fällig am 15.10.2032 | € | 300 | 293 | 0,25 |
| **Bain Capital Euro DAC** | | | | |
| 0,740 % fällig am 20.01.2032 | | 200 | 194 | 0,17 |
| **BBVA Consumer Auto** | | | | |
| 0,270 % fällig am 20.07.2031 | | 121 | 119 | 0,10 |
| **Black Diamond CLO DAC** | | | | |
| 0,860 % fällig am 20.01.2032 | | 499 | 493 | 0,43 |
| **BlueMountain Fuji EUR CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 15.07.2030 | | 345 | 339 | 0,29 |
| 0,720 % fällig am 15.01.2031 | | 500 | 487 | 0,42 |
| 0,910 % fällig am 15.01.2033 | | 400 | 385 | 0,33 |
| 1,050 % fällig am 15.01.2031 | | 100 | 97 | 0,08 |
| **BNPP AM Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 15.10.2031 | | 247 | 243 | 0,21 |
| 0,820 % fällig am 22.07.2032 | | 400 | 388 | 0,34 |
| **Bumper UK Finance PLC** | | | | |
| 1,440 % fällig am 20.12.2030 | £ | 264 | 306 | 0,26 |
| **Cairn CLO DAC** | | | | |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | € | 600 | 585 | 0,51 |
| 0,790 % fällig am 25.07.2029 | | 427 | 423 | 0,37 |
| **Carlyle Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,700 % fällig am 15.01.2031 | | 600 | 586 | 0,51 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.11.2031 | | 300 | 295 | 0,26 |
| **Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC** | | | | |
| 0,284 % fällig am 15.12.2029 | | 296 | 297 | 0,26 |
| **Contego CLO BV** | | | | |
| 0,770 % fällig am 15.10.2030 | | 300 | 294 | 0,25 |
| **Contego CLO DAC** | | | | |
| 0,640 % fällig am 23.01.2030 | | 500 | 491 | 0,43 |
| **CVC Cordatus Loan Fund DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 21.07.2030 | | 1.338 | 1.321 | 1,15 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,640 % fällig am 15.10.2031 | | 400 | 391 | 0,34 |
| 0,650 % fällig am 26.06.2030 | | 495 | 486 | 0,42 |
| 0,760 % fällig am 15.07.2031 | | 300 | 289 | 0,25 |
| 0,850 % fällig am 15.01.2032 | | 500 | 487 | 0,42 |
| **Laurelin DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 20.10.2031 | | 400 | 392 | 0,34 |
| **Madison Park Euro Funding DAC** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.01.2032 | | 400 | 387 | 0,34 |
| **Man GLG Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,680 % fällig am 15.10.2030 | | 398 | 390 | 0,34 |
| 0,870 % fällig am 15.01.2030 | | 642 | 636 | 0,55 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,329 % fällig am 25.01.2036 | $ | 423 | 402 | 0,35 |
| **OCP Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,880 % fällig am 22.09.2034 | € | 400 | 387 | 0,34 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** | | | | |
| 1,050 % fällig am 15.10.2031 | | 500 | 492 | 0,43 |
| **PBD Germany Auto Lease Master S.A., Compartment** | | | | |
| 0,188 % fällig am 26.11.2030 | | 200 | 200 | 0,17 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Purple Master Credit Cards** | | | |
| 0,172 % fällig am 25.05.2034 | € 400 | € 400 | 0,35 |
| **Red & Black Auto Italy SRL** | | | |
| 0,147 % fällig am 28.12.2031 | 296 | 296 | 0,26 |
| **Segovia European CLO DAC** | | | |
| 0,770 % fällig am 18.01.2031 | 200 | 196 | 0,17 |
| **Silver Arrow Merfina SRL** | | | |
| 0,206 % fällig am 20.07.2033 | 371 | 372 | 0,32 |
| **Silver Arrow S.A.** | | | |
| 0,164 % fällig am 15.02.2027 | 53 | 54 | 0,05 |
| 0,206 % fällig am 20.11.2030 | 71 | 71 | 0,06 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | |
| 0,269 % fällig am 15.12.2033 | 159 | 150 | 0,13 |
| **Tikehau CLO BV** | | | |
| 0,870 % fällig am 04.08.2034 | 400 | 390 | 0,34 |
| **Toro European CLO DAC** | | | |
| 0,810 % fällig am 15.02.2034 | 400 | 387 | 0,34 |
| **Voya Euro CLO DAC** | | | |
| 0,750 % fällig am 15.10.2030 | 400 | 394 | 0,34 |
| | | 18.765 | 16,29 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Austria Government International Bond** | | | |
| 0,850 % fällig am 30.06.2120 | 110 | 50 | 0,04 |
| **Belgium Government International Bond** | | | |
| 1,400 % fällig am 22.06.2053 | € 1.400 | € 1.030 | 0,89 |
| **Croatia Government International Bond** | | | |
| 1,500 % fällig am 17.06.2031 | 400 | 343 | 0,30 |
| **France Government International Bond** | | | |
| 0,500 % fällig am 25.06.2044 | 2.900 | 1.964 | 1,71 |
| 0,500 % fällig am 25.05.2072 | 3.050 | 1.342 | 1,17 |
| 0,750 % fällig am 25.05.2052 | 20.400 | 12.964 | 11,25 |
| 1,500 % fällig am 25.05.2050 | 1.500 | 1.210 | 1,05 |
| 1,750 % fällig am 25.06.2039 | 3.450 | 3.210 | 2,79 |
| 1,750 % fällig am 25.05.2066 | 470 | 373 | 0,32 |
| 2,000 % fällig am 25.05.2048 | 6.150 | 5.626 | 4,88 |
| 3,250 % fällig am 25.05.2045 | 6.600 | 7.555 | 6,56 |
| 4,000 % fällig am 25.04.2055 | 2.100 | 2.765 | 2,40 |
| 4,000 % fällig am 25.04.2060 | 4.200 | 5.610 | 4,87 |
| 4,500 % fällig am 25.04.2041 | 3.150 | 4.141 | 3,59 |
| **Israel Government International Bond** | | | |
| 1,250 % fällig am 30.11.2022 ILS | 1.000 | 273 | 0,24 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 0,100 % fällig am 15.05.2033 (b) € | 106 | 92 | 0,08 |
| 0,400 % fällig am 15.05.2030 (b) | 443 | 423 | 0,37 |
| 1,300 % fällig am 15.05.2028 (b) | 801 | 834 | 0,72 |
| **Netherlands Government International Bond** | | | |
| 2,750 % fällig am 15.01.2047 | 3.350 | 3.913 | 3,40 |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | |
| 0,000 % fällig am 15.08.2052 (a) € | 1.900 | € 1.170 | 1,02 |
| **Romania Government International Bond** | | | |
| 2,125 % fällig am 07.03.2028 | 100 | 83 | 0,07 |
| 3,750 % fällig am 07.02.2034 | 100 | 75 | 0,07 |
| **Serbia Government International Bond** | | | |
| 2,050 % fällig am 23.09.2036 | 200 | 118 | 0,10 |
| **Slovenia Government International Bond** | | | |
| 1,500 % fällig am 25.03.2035 | 2.200 | 1.939 | 1,68 |
| **United Kingdom Gilt** | | | |
| 1,250 % fällig am 22.11.2032 (b) £ | 462 | 692 | 0,60 |
| 1,250 % fällig am 31.07.2051 | 100 | 85 | 0,07 |
| | | 57.880 | 50,24 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | **€ 108.305** | **94,01** |
| | **AKTIEN** | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (d)** | 31.600 | 3.022 | 2,62 |
| **Summe Investmentfonds** | | **€ 3.022** | **2,62** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 131 | U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | € (128) | € 125 | € 125 | 0,11 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **€ (128)** | **€ 125** | **€ 125** | **0,11** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

### FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month Euribor July Futures | Long | 07.2022 | 78 | € 19 | 0,02 |
| 3-Month SOFR December Futures | Long | 03.2023 | 62 | 11 | 0,01 |
| 3-Month SOFR March Futures | Short | 06.2023 | 62 | (16) | (0,01) |
| 3-Month Euribor June Futures | Short | 06.2023 | 57 | 71 | 0,06 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 144.500 EUR auf Euro-Bund August 2022 Futures[1] | Short | 07.2022 | 9 | (22) | (0,02) |
| Euro-Bobl September Futures | Long | 09.2022 | 97 | (2) | 0,00 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09.2022 | 51 | (107) | (0,09) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 158 | (134) | (0,12) |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 156 | (1.680) | (1,46) |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 116 | (205) | (0,18) |
| Euro-Schatz September Futures | Long | 09.2022 | 120 | 55 | 0,05 |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 8 | 4 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 144.500 EUR auf August 2022 Futures[1] | Short | 07.2022 | 9 | 13 | 0,01 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 1 | 1 | 0,00 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 49 | 10 | 0,01 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 19 | (12) | (0,01) |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2022 | 26 | (4) | 0,00 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 11 | 16 | 0,01 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2022 | 5 | 21 | 0,02 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09.2022 | 10 | 48 | 0,04 |
| | | | | € (1.913) | (1,66) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **€ (1.913)** | **(1,66)** |

[1] Future-Style-Option.

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| British Telecommunications PLC | 1,000 % | 20.12.2028 | € 100 | € (3) | 0,00 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 % | 21.09.2027 | £ 100 | € (4) | 0,00 |
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2032 | 900 | 89 | 0,08 |
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2052 | 100 | 19 | 0,02 |
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 1,600 | 18.05.2032 | 1.200 | (80) | (0,07) |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 16.06.2029 | ¥ 507.000 | (14) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,435 | 20.06.2029 | 103.000 | (5) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month EUR-ESTRON Compounded-OIS | 0,312 | 08.06.2026 | € 3.200 | (7) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month EUR-ESTRON Compounded-OIS | 0,431 | 21.09.2022 | 33.500 | (6) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,880 | 25.01.2052 | $ 800 | (152) | (0,13) |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 17.03.2036 | € 700 | 155 | 0,13 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2027 | 23.800 | 922 | 0,80 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | 39.400 | 2.157 | 1,87 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,450 | 15.12.2035 | 9.000 | (2.524) | (2,19) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2024 | 12.400 | (112) | (0,10) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2052 | 7.800 | (207) | (0,18) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,550 | 15.12.2040 | 9.900 | (3.546) | (3,08) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 12.04.2027 | 800 | (35) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 11.05.2027 | 600 | (26) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,700 | 11.04.2027 | 400 | (17) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 13.05.2027 | 600 | (18) | (0,02) |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 2,250 | 21.09.2037 | 10.200 | 244 | 0,21 |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 2,250 | 21.09.2042 | 11.700 | 313 | 0,27 |
| Erhalt | CPTFEMU | 2,600 | 15.05.2032 | 200 | (2) | 0,00 |
| Erhalt | CPTFEMU | 2,720 | 15.06.2032 | 300 | (9) | (0,01) |
| Zahlung | UKRPI | 3,330 | 15.01.2025 | £ 650 | (88) | (0,08) |
| Zahlung | UKRPI | 3,400 | 15.12.2024 | 2.650 | (345) | (0,30) |
| Erhalt | UKRPI | 4,410 | 15.08.2022 | 800 | 70 | 0,06 |
| Erhalt | UKRPI | 4,535 | 15.10.2022 | 500 | 47 | 0,04 |
| Erhalt | UKRPI | 4,560 | 15.09.2023 | 500 | 53 | 0,05 |
| Erhalt | UKRPI | 4,900 | 15.05.2023 | 450 | 53 | 0,05 |
| Erhalt | UKRPI | 5,200 | 15.06.2024 | 300 | 1 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 5,360 | 15.11.2023 | 500 | 41 | 0,04 |
| Erhalt | UKRPI | 6,600 | 15.05.2024 | 100 | 0 | 0,00 |
| | | | | | € (3.033) | (2,64) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **€ (3.036)** | **(2,64)** |

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

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

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

**OPTIONSKAUF**

**ZINSSWAPOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,195 % | 02.11.2022 | 650 | € 0 | € 265 | 0,23 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,197 | 04.11.2022 | 850 | 55 | 346 | 0,30 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,000 | 15.03.2023 | 450 | 42 | 203 | 0,18 |
| BRC | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,410 | 02.02.2023 | 4.100 | 18 | 3 | 0,00 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,197 | 04.11.2022 | 450 | 28 | 184 | 0,16 |
| CBK | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,720 | 23.02.2023 | 800 | 4 | 1 | 0,00 |
| GLM | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,200 | 26.04.2023 | 1.400 | 14 | 14 | 0,01 |
| JPM | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,710 | 25.01.2023 | 900 | 5 | 1 | 0,00 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,000 | 15.03.2023 | 250 | 23 | 113 | 0,10 |
| MYC | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,428 | 31.01.2023 | 4.100 | 19 | 3 | 0,00 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,190 | 02.11.2022 | 610 | 38 | 250 | 0,22 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,200 | 31.05.2023 | 3.900 | 44 | 42 | 0,04 |
| | | | | | | | € 290 | € 1.425 | 1,24 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

**ZINSSWAPOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,000 % | 02.11.2022 | 2.000 | € 0 | € (418) | (0,36) |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,000 | 04.11.2022 | 2.490 | (52) | (520) | (0,45) |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,175 | 15.03.2023 | 1.350 | (41) | (310) | (0,27) |

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,558 % | 02.02.2023 | 900 | € (18) | € (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,000 | 04.11.2022 | 1.310 | (27) | (274) | (0,24) |
| CBK | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,736 | 23.02.2023 | 100 | (2) | 0 | 0,00 |
| DUB | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,350 | 08.08.2022 | 300 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,550 | 08.08.2022 | 300 | (1) | (6) | (0,01) |
| GLM | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,350 | 26.04.2023 | 800 | (15) | (13) | (0,01) |
| JPM | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,785 | 25.01.2023 | 200 | (5) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,175 | 15.03.2023 | 750 | (23) | (172) | (0,15) |
| MYC | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,579 | 31.01.2023 | 900 | (19) | (2) | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,350 | 31.05.2023 | 2.100 | (43) | (37) | (0,03) |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,000 | 02.11.2022 | 1.900 | (40) | (397) | (0,35) |
| | | | | | | | € (287) | € (2.152) | (1,87) |

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPM | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 3,500 % fällig am 01.08.2052 | $ 96,906 | 04.08.2022 | 200 | € (1 ) | € (3 ) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,156 | 07.09.2022 | 500 | (2 ) | (3 ) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,656 | 07.09.2022 | 1.000 | (3 ) | (8 ) | (0,01) |
| | | | | | € (6) | € (14) | (0,01) |

[1] Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | € 225 | DKK 1.670 | € 0 | € 0 | € 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 651 | NOK 6.620 | 0 | (12) | (12) | (0,01) |
| | 08.2022 | ¥ 18.300 | € 129 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | DKK 2.270 | 305 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | € 3.339 | DKK 24.835 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | CHF 69 | € 67 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | € 433 | £ 369 | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| | 08.2022 | 1.271 | $ 1.335 | 4 | (1) | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 938 | € 894 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | DKK 2.930 | 394 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | € 1.145 | DKK 8.524 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | CHF 633 | € 623 | 0 | (10) | (10) | (0,01) |
| | 08.2022 | DKK 8.523 | 1.145 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | € 653 | AUD 978 | 0 | (12) | (12) | (0,01) |
| CBK | 11.2022 | ILS 1.012 | $ 321 | 27 | 0 | 27 | 0,02 |
| DUB | 07.2022 | DKK 99.673 | € 13.396 | 0 | (7) | (7) | (0,01) |
| | 07.2022 | € 371 | DKK 2.760 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 6.860 | € 6.460 | 0 | (83) | (83) | (0,07) |
| JPM | 07.2022 | DKK 1.245 | 167 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | € 7.323 | DKK 54.484 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH 950 | $ 141 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK 48.728 | € 6.549 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08.2022 | £ 10.808 | 12.562 | 35 | 0 | 35 | 0,03 |
| | 08.2022 | $ 558 | 530 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | € 761 | DKK 5.660 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH 2.162 | $ 322 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | € 155 | £ 132 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | 453 | $ 481 | 6 | 0 | 6 | 0,01 |
| | 08.2022 | £ 29 | € 34 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 05.2023 | CNH 1.128 | $ 168 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | DKK 1.520 | € 204 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | € 133 | $ 142 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 76 | € 72 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RBC | 08.2022 | € 461 | £ 397 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| RYL | 08.2022 | 684 | CHF 714 | 29 | 0 | 29 | 0,03 |
| SCX | 07.2022 | ILS 147 | $ 44 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD 113 | € 75 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH 3.835 | $ 573 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | € 1.303 | DKK 9.693 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK 9.692 | € 1.303 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | € 315 | $ 335 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | NOK 675 | € 64 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | € 118 | € (146) | € (28) | (0,03) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **€ (769)** | **(0,67)** |
| **Summe Anlagen** | **€ 105.734** | **91,77** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **€ 9.477** | **8,23** |
| **Nettovermögen** | **€ 115.211** | **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 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.

**Barmittel in Höhe von EUR 3.947 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von EUR 390 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | € 108.305 | € 0 | € 108.305 |
| Investmentfonds | 3.022 | 0 | 0 | 3.022 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 125 | 0 | 125 |
| Finanzderivate[3] | (1.940) | (3.778) | 0 | (5.718) |
| **Summen** | **€ 1.082** | **€ 104.652** | **€ 0** | **€ 105.734** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 0 | € 155.866 | € 0 | € 155.866 |
| Investmentfonds | 407 | 0 | 0 | 407 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 1.236 | 0 | 1.236 |
| Finanzderivate[3] | (2.521) | (1.841) | 0 | (4.362) |
| **Summen** | **€ (2.114)** | **€ 155.261** | **€ 0** | **€ 153.147** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | € (12) | € 0 | € (12) |
| BPS | (439) | 390 | (49) |
| BRC | (111) | 0 | (111) |
| CBK | 28 | 0 | 28 |
| DUB | (96) | 0 | (96) |
| GLM | 1 | 0 | 1 |
| JPM | (40) | 0 | (40) |
| MBC | 4 | 0 | 4 |
| MYC | (141) | (120) | (261) |
| MYI | 2 | 0 | 2 |
| RBC | (1) | 0 | (1) |
| RYL | 29 | 0 | 29 |
| SCX | 4 | 0 | 4 |
| 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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 90,17 | 95,50 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 3,63 | 1,55 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 0,21 | k. A. |
| Investmentfonds | 2,62 | 0,25 |
| Pensionsgeschäfte | 0,11 | 0,77 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (1,66) | (1,57) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (2,64) | (0,79) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (0,67) | (0,35) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 9,35 | 20,96 |
| US-Regierungsbehörden | 2,98 | 0,50 |
| US-Schatzobligationen | 1,66 | 2,54 |
| Non-Agency-MBS | 13,49 | 8,65 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 16,29 | 12,35 |
| Staatsemissionen | 50,24 | 51,74 |
| Kurzfristige Instrumente | k. A. | 0,31 |
| Investmentfonds | 2,62 | 0,25 |
| Pensionsgeschäfte | 0,11 | 0,77 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (1,66) | (1,57) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,00 | 0,00 |
| Zinsswaps | (2,64) | (0,79) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoptionen | 1,24 | 0,28 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Devisenoptionen | k. A. | (0,01) |
| Zinsswapoptionen | (1,87) | (0,55) |
| Optionen auf Wertpapiere | (0,01) | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | (0,03) | (0,07) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 8,23 | 4,64 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **AMCO - Asset Management Co. SpA** | | | | |
| 1,500 % fällig am 17.07.2023 | € | 4.200 | € 4.216 | 0,83 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 17.10.2022 | | 5.167 | 5.139 | 1,01 |
| **Australia & New Zealand Banking Group Ltd.** | | | | |
| 0,250 % fällig am 17.03.2025 | | 3.400 | 3.282 | 0,65 |
| **AyT Cedulas Cajas Fondo de Titulizacion de Activos** | | | | |
| 3,750 % fällig am 30.06.2025 | | 1.100 | 1.163 | 0,23 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 2,875 % fällig am 16.07.2024 | | 2.500 | 2.558 | 0,50 |
| **Banco BPM SpA** | | | | |
| 0,625 % fällig am 08.06.2023 | | 1.100 | 1.097 | 0,22 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,652 % fällig am 24.08.2025 | | 7.800 | 7.735 | 1,52 |
| **Bank of China Ltd.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 10.08.2023 | £ | 5.900 | 6.802 | 1,34 |
| **Banque Federative du Credit Mutuel S.A.** | | | | |
| 1,487 % fällig am 26.01.2025 | | 2.700 | 3.110 | 0,61 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (d) | $ | 200 | 193 | 0,04 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 06.10.2023 | £ | 1.200 | 1.391 | 0,27 |
| 3,125 % fällig am 17.01.2024 | | 4.000 | 4.584 | 0,90 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 0,422 % fällig am 07.06.2024 | € | 1.000 | 1.006 | 0,20 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 0,375 % fällig am 03.02.2025 | | 2.800 | 2.651 | 0,52 |
| 6,000 % fällig am 18.07.2022 (c)(d) | | 200 | 200 | 0,04 |
| **Castellum AB** | | | | |
| 2,125 % fällig am 20.11.2023 | | 200 | 194 | 0,04 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 2,664 % fällig am 24.05.2025 | $ | 1.700 | 1.613 | 0,32 |
| 2,750 % fällig am 24.01.2024 | £ | 3.300 | 3.783 | 0,75 |
| **Rat der Europäischen Entwicklungsbank** | | | | |
| 0,375 % fällig am 27.10.2022 | € | 500 | 501 | 0,10 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,862 % fällig am 31.05.2024 | | 3.700 | 3.713 | 0,73 |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (d) | $ | 800 | 768 | 0,15 |
| **Dell Bank International DAC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 24.06.2024 | € | 400 | 396 | 0,08 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,625 % fällig am 19.12.2023 | CHF | 800 | 789 | 0,16 |
| 1,000 % fällig am 19.11.2025 | € | 4.300 | 4.059 | 0,80 |
| **Deutsche Pfandbriefbank AG** | | | | |
| 2,190 % fällig am 29.09.2023 | £ | 1.000 | 1.170 | 0,23 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | | |
| 0,250 % fällig am 01.06.2023 | € | 2.600 | 2.590 | 0,51 |
| **Digital Euro Finco LLC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.04.2024 | | 800 | 797 | 0,16 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 0,092 % fällig am 07.12.2022 | | 2.689 | 2.670 | 0,53 |
| 1,514 % fällig am 17.02.2023 | | 1.500 | 1.481 | 0,29 |
| 1,744 % fällig am 19.07.2024 | | 700 | 648 | 0,13 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 06.09.2024 | £ | 200 | 223 | 0,04 |
| 2,439 % fällig am 17.11.2023 | $ | 600 | 566 | 0,11 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 0,555 % fällig am 30.04.2024 | € | 5.000 | 5.003 | 0,99 |
| 0,579 % fällig am 07.02.2025 | | 4.000 | 3.982 | 0,78 |
| 2,255 % fällig am 23.02.2023 | $ | 1.200 | 1.146 | 0,23 |
| 2,870 % fällig am 15.03.2024 | | 300 | 287 | 0,06 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 04.12.2024 | € | 2.600 | 2.574 | 0,51 |
| 6,500 % fällig am 20.05.2024 | £ | 1.300 | 1.580 | 0,31 |
| **ING Bank Australia Ltd.** | | | | |
| 1,865 % fällig am 26.05.2025 | AUD | 1.200 | 788 | 0,15 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 6,250 % fällig am 16.05.2024 (c)(d) | € | 200 | 191 | 0,04 |
| **Itau Unibanco Holding S.A.** | | | | |
| 2,900 % fällig am 24.01.2023 | $ | 200 | 191 | 0,04 |
| **KB Kookmin Card Co. Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 09.06.2025 | | 800 | 759 | 0,15 |
| **Land Securities Capital Markets PLC** | | | | |
| 1,974 % fällig am 08.02.2026 | £ | 1.500 | € 1.713 | 0,34 |
| **Landesbank Baden-Wuerttemberg** | | | | |
| 2,000 % fällig am 24.02.2025 | $ | 1.200 | 1.108 | 0,22 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 0,125 % fällig am 13.09.2023 | € | 3.100 | 3.029 | 0,60 |
| 1,000 % fällig am 02.05.2023 | | 1.200 | 1.194 | 0,23 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 0,611 % fällig am 21.06.2024 | | 4.200 | 4.232 | 0,83 |
| 3,500 % fällig am 01.04.2026 | | 2.600 | 2.624 | 0,52 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.07.2024 | | 1.600 | 1.518 | 0,30 |
| **Mitsubishi HC Capital UK PLC** | | | | |
| 0,250 % fällig am 03.02.2025 | | 2.000 | 1.882 | 0,37 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | |
| 2,264 % fällig am 14.06.2025 | | 1.300 | 1.296 | 0,26 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | |
| 0,523 % fällig am 10.06.2024 | | 900 | 872 | 0,17 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 0,637 % fällig am 26.07.2024 | | 2.600 | 2.562 | 0,50 |
| **MPT Operating Partnership LP** | | | | |
| 2,550 % fällig am 05.12.2023 | £ | 3.300 | 3.684 | 0,73 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 1,000 % fällig am 24.01.2023 | | 1.100 | 1.265 | 0,25 |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 2,000 % fällig am 04.03.2025 | € | 3.400 | 3.360 | 0,66 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 22.888 | 2.686 | 0,53 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 100.496 | 11.808 | 2,33 |
| **Permanent TSB Group Holdings PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 30.06.2025 | € | 900 | 901 | 0,18 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 19.778 | 2.328 | 0,46 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,305 % fällig am 31.01.2024 | € | 1.500 | 1.512 | 0,30 |
| **Sagax AB** | | | | |
| 2,000 % fällig am 17.01.2024 | | 700 | 685 | 0,13 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 1,125 % fällig am 08.09.2023 | | 2.600 | 2.581 | 0,51 |
| **SBB Treasury Oyj** | | | | |
| 0,129 % fällig am 08.02.2024 | | 1.400 | 1.154 | 0,23 |
| **Segro PLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 23.02.2024 | £ | 700 | 853 | 0,17 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 15.02.2024 | € | 3.300 | 3.250 | 0,64 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 1,319 % fällig am 14.10.2023 | $ | 500 | 475 | 0,09 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,550 % fällig am 06.11.2023 | € | 5.200 | 5.153 | 1,02 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | |
| 0,508 % fällig am 12.01.2024 | $ | 900 | 820 | 0,16 |
| **Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.** | | | | |
| 2,550 % fällig am 10.03.2025 | | 200 | 184 | 0,04 |
| **Toronto-Dominion Bank** | | | | |
| 1,395 % fällig am 22.04.2025 | £ | 1.900 | 2.201 | 0,43 |
| **TP ICAP Finance PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 26.01.2024 | | 1.125 | 1.294 | 0,25 |
| **UBS AG** | | | | |
| 1,619 % fällig am 09.08.2024 | $ | 2.600 | 2.471 | 0,49 |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (d) | | 1.500 | 1.435 | 0,28 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (d) | | 5.050 | 4.845 | 0,95 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 1,250 % fällig am 17.04.2025 | € | 400 | 391 | 0,08 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 6,950 % fällig am 31.10.2022 | | 4.100 | 4.169 | 0,82 |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | $ | 1.000 | 991 | 0,20 |
| **Virgin Money UK PLC** | | | | |
| 0,375 % fällig am 27.05.2024 | € | 5.200 | 5.103 | 1,01 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 1,875 % fällig am 31.01.2024 | | 1.400 | 1.392 | 0,27 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | | |
| 0,250 % fällig am 31.01.2025 | | 3.400 | 3.191 | 0,63 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** | | | | |
| 0,000 % fällig am 19.07.2024 (a) | | 3.000 | 2.855 | 0,56 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 1,338 % fällig am 04.05.2025 | € | 2.700 | € 2.636 | 0,52 |
| 2,125 % fällig am 20.12.2023 | £ | 2.000 | 2.267 | 0,45 |
| **Yorkshire Building Society** | | | | |
| 0,375 % fällig am 11.04.2023 | € | 2.000 | 1.996 | 0,39 |
| | | | 189.555 | 37,37 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.07.2043 | £ | 2.200 | 2.505 | 0,49 |
| **ABB Finance BV** | | | | |
| 0,489 % fällig am 31.03.2024 | € | 900 | 906 | 0,18 |
| **American Medical Systems Europe BV** | | | | |
| 0,750 % fällig am 08.03.2025 | | 300 | 288 | 0,06 |
| **ArcelorMittal S.A.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 19.05.2023 | | 2.600 | 2.573 | 0,51 |
| **Asahi Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 0,155 % fällig am 23.10.2024 | | 1.080 | 1.032 | 0,20 |
| **Bacardi Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 03.07.2023 | | 2.192 | 2.208 | 0,43 |
| **Barry Callebaut Services NV** | | | | |
| 2,375 % fällig am 24.05.2024 | | 400 | 401 | 0,08 |
| **Becton Dickinson and Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 13.08.2023 (a) | | 200 | 197 | 0,04 |
| **Bureau Veritas S.A.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 07.09.2023 | | 10.200 | 10.137 | 2,00 |
| **Coloplast Finance BV** | | | | |
| 0,370 % fällig am 19.05.2024 | | 1.800 | 1.806 | 0,36 |
| **Conti-Gummi Finance BV** | | | | |
| 1,125 % fällig am 25.09.2024 | | 1.700 | 1.664 | 0,33 |
| **Crown European Holdings S.A.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.02.2023 | | 3.000 | 2.940 | 0,58 |
| **Daimler Truck International Finance BV** | | | | |
| 0,253 % fällig am 06.10.2023 | | 900 | 903 | 0,18 |
| 1,250 % fällig am 06.04.2025 | | 1.300 | 1.256 | 0,25 |
| **easyJet PLC** | | | | |
| 1,125 % fällig am 18.10.2023 | | 1.000 | 969 | 0,19 |
| 1,750 % fällig am 09.02.2023 | | 1.800 | 1.786 | 0,35 |
| **Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide** | | | | |
| 1,625 % fällig am 09.07.2024 | | 5.700 | 5.523 | 1,09 |
| **Fresenius SE & Co. KGaA** | | | | |
| 1,875 % fällig am 24.05.2025 | | 1.000 | 973 | 0,19 |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 22.11.2024 | | 1.300 | 423 | 0,08 |
| 2,949 % fällig am 24.01.2024 | | 600 | 195 | 0,04 |
| 3,125 % fällig am 17.11.2023 | | 2.800 | 1.190 | 0,23 |
| **Harvest Operations Corp.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 26.04.2024 | $ | 800 | 729 | 0,14 |
| **Highland Holdings SARL** | | | | |
| 0,000 % fällig am 12.11.2023 (a) | € | 1.200 | 1.172 | 0,23 |
| **Huntsman International LLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.04.2025 | | 400 | 402 | 0,08 |
| **Hyundai Capital America** | | | | |
| 0,875 % fällig am 14.06.2024 | $ | 100 | 89 | 0,02 |
| **Informa PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 05.07.2023 | € | 4.400 | 4.330 | 0,85 |
| **InterContinental Hotels Group PLC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 08.10.2024 | | 4.300 | 4.116 | 0,81 |
| 3,875 % fällig am 28.11.2022 | £ | 600 | 700 | 0,14 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 24.05.2024 | € | 400 | 395 | 0,08 |
| 2,000 % fällig am 30.06.2023 | | 2.300 | 2.304 | 0,45 |
| **Magallanes, Inc.** | | | | |
| 3,259 % fällig am 15.03.2024 | $ | 400 | 382 | 0,08 |
| **Nissan Motor Co. Ltd.** | | | | |
| 1,940 % fällig am 15.09.2023 | € | 2.600 | 2.588 | 0,51 |
| **Ryanair DAC** | | | | |
| 1,125 % fällig am 15.08.2023 | | 6.500 | 6.397 | 1,26 |
| **Schaeffler AG** | | | | |
| 1,875 % fällig am 26.03.2024 | | 7.600 | 7.328 | 1,44 |
| **SIG Combibloc Purchase Co. SARL** | | | | |
| 1,875 % fällig am 18.06.2023 | | 2.500 | 2.470 | 0,49 |
| **Sixt SE** | | | | |
| 1,750 % fällig am 09.12.2024 | | 1.000 | 978 | 0,19 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Stellantis NV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 23.03.2024 | € | 2.600 | € 2.581 | 0,51 |
| **Tesco Corporate Treasury Services PLC** | | | | |
| 1,375 % fällig am 24.10.2023 | | 2.800 | 2.784 | 0,55 |
| **Ubisoft Entertainment S.A.** | | | | |
| 1,289 % fällig am 30.01.2023 | | 2.100 | 2.101 | 0,41 |
| **ZF North America Capital, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 27.04.2023 | | 800 | 789 | 0,16 |
| | | | 82.510 | 16,26 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **CK Hutchison Group Telecom Finance S.A.** | | | | |
| 0,375 % fällig am 17.10.2023 | | 800 | 785 | 0,16 |
| **Global Switch Holdings Ltd.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 31.01.2024 | | 2.600 | 2.537 | 0,50 |
| **SSE PLC** | | | | |
| 1,250 % fällig am 16.04.2025 | | 700 | 676 | 0,13 |
| **Wintershall Dea Finance BV** | | | | |
| 0,452 % fällig am 25.09.2023 | | 800 | 782 | 0,15 |
| | | | 4.780 | 0,94 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 276.845 | 54,57 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Freddie Mac** | | | | |
| 0,650 % fällig am 27.10.2025 | $ | 3.900 | 3.429 | 0,68 |
| 0,800 % fällig am 28.10.2026 | | 4.200 | 3.610 | 0,71 |
| | | | 7.039 | 1,39 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Atlas Funding PLC** | | | | |
| 1,388 % fällig am 25.07.2058 | £ | 442 | 509 | 0,10 |
| **Avon Finance PLC** | | | | |
| 1,690 % fällig am 20.09.2048 | | 3.289 | 3.801 | 0,75 |
| **Barley Hill PLC** | | | | |
| 1,892 % fällig am 27.08.2058 | | 829 | 952 | 0,19 |
| **Canada Square Funding PLC** | | | | |
| 1,550 % fällig am 17.10.2051 | | 1.304 | 1.514 | 0,30 |
| **Canterbury Finance PLC** | | | | |
| 1,940 % fällig am 16.05.2057 | | 562 | 653 | 0,13 |
| 1,953 % fällig am 16.05.2056 | | 970 | 1.129 | 0,22 |
| **Cheshire PLC** | | | | |
| 1,527 % fällig am 20.08.2045 | | 895 | 1.028 | 0,20 |
| **Domi BV** | | | | |
| 0,474 % fällig am 15.11.2052 | € | 1.146 | 1.145 | 0,23 |
| 0,569 % fällig am 15.06.2051 | | 160 | 159 | 0,03 |
| **Dutch Property Finance BV** | | | | |
| 0,320 % fällig am 28.10.2059 | | 1.400 | 1.382 | 0,27 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 2,540 % fällig am 13.06.2045 | £ | 924 | 1.065 | 0,21 |
| **Fingal Securities RMBS DAC** | | | | |
| 0,570 % fällig am 28.07.2055 | € | 1.844 | 1.837 | 0,36 |
| **Formentera Issuer PLC** | | | | |
| 1,348 % fällig am 28.07.2047 | £ | 1.515 | 1.730 | 0,34 |
| **London Wall Mortgage Capital PLC** | | | | |
| 1,570 % fällig am 15.11.2049 | | 35 | 40 | 0,01 |
| **Precise Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,870 % fällig am 16.10.2056 | | 51 | 59 | 0,01 |
| **Primrose Residential DAC** | | | | |
| 0,238 % fällig am 24.03.2061 | € | 5.929 | 5.846 | 1,15 |
| **Residential Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 2,040 % fällig am 20.06.2070 | £ | 74 | 86 | 0,02 |
| **Ripon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,351 % fällig am 28.08.2056 | | 1.830 | 2.104 | 0,41 |
| **Shamrock Residential DAC** | | | | |
| 0,338 % fällig am 24.12.2059 | € | 2.458 | 2.442 | 0,48 |
| **Stratton Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2060 | £ | 3.261 | 3.758 | 0,74 |
| 1,452 % fällig am 12.12.2043 | | 422 | 485 | 0,09 |
| 1,674 % fällig am 25.09.2051 | | 2.881 | 3.329 | 0,66 |
| 1,853 % fällig am 25.05.2051 | | 269 | 312 | 0,06 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2045 | | 375 | 435 | 0,09 |
| 1,547 % fällig am 20.02.2045 | | 277 | 322 | 0,06 |
| 1,605 % fällig am 20.10.2051 | | 1.128 | 1.306 | 0,26 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Tower Bridge Funding PLC** | | | | |
| 2,160 % fällig am 20.09.2063 | £ | 1.205 | € 1.402 | 0,28 |
| **Trinity Square PLC** | | | | |
| 1,300 % fällig am 15.07.2059 | | 5.318 | 6.138 | 1,21 |
| **Tudor Rose Mortgages** | | | | |
| 1,390 % fällig am 20.06.2048 | | 2.554 | 2.932 | 0,58 |
| | | | 47.900 | 9,44 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Accunia European CLO DAC** | | | | |
| 0,930 % fällig am 15.10.2030 | € | 324 | 321 | 0,06 |
| **Aqueduct European CLO DAC** | | | | |
| 0,640 % fällig am 20.07.2030 | | 1.783 | 1.757 | 0,35 |
| **Ares European CLO DAC** | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.10.2030 | | 5.690 | 5.587 | 1,10 |
| **Aurium CLO DAC** | | | | |
| 0,670 % fällig am 16.04.2030 | | 2.793 | 2.748 | 0,54 |
| 0,730 % fällig am 16.01.2031 | | 3.000 | 2.947 | 0,58 |
| 1,050 % fällig am 23.03.2032 | | 1.700 | 1.668 | 0,33 |
| **Bain Capital Euro DAC** | | | | |
| 0,740 % fällig am 20.01.2032 | | 3.800 | 3.687 | 0,73 |
| **Black Diamond CLO DAC** | | | | |
| 0,860 % fällig am 20.01.2032 | | 200 | 197 | 0,04 |
| **Blackrock European CLO DAC** | | | | |
| 0,620 % fällig am 15.10.2031 | | 7.800 | 7.543 | 1,49 |
| **BlueMountain Fuji EUR CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 15.07.2030 | | 861 | 848 | 0,17 |
| **BNPP AM Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,600 % fällig am 15.04.2031 | | 200 | 194 | 0,04 |
| **Cairn CLO DAC** | | | | |
| 0,670 % fällig am 31.01.2030 | | 1.893 | 1.862 | 0,37 |
| **Contego CLO DAC** | | | | |
| 0,640 % fällig am 23.01.2030 | | 999 | 982 | 0,19 |
| **Driver Australia Six Trust** | | | | |
| 1,944 % fällig am 21.12.2027 | AUD | 166 | 109 | 0,02 |
| **Dryden Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.04.2033 | € | 3.100 | 3.008 | 0,59 |
| **Euro-Galaxy CLO DAC** | | | | |
| 0,620 % fällig am 24.04.2034 | | 1.000 | 975 | 0,19 |
| 0,710 % fällig am 11.04.2031 | | 600 | 584 | 0,11 |
| **Fortuna Consumer Loan ABS DAC** | | | | |
| 0,206 % fällig am 18.10.2030 | | 691 | 692 | 0,14 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,640 % fällig am 15.10.2031 | | 3.200 | 3.126 | 0,62 |
| 0,650 % fällig am 26.06.2030 | | 1.584 | 1.557 | 0,31 |
| **Hill FL BV** | | | | |
| 0,202 % fällig am 18.05.2030 | | 1.000 | 999 | 0,20 |
| **Jubilee CLO DAC** | | | | |
| 0,391 % fällig am 12.07.2028 | | 71 | 71 | 0,01 |
| **Laurelin DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 20.10.2031 | | 8.000 | 7.839 | 1,54 |
| **Man GLG Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,680 % fällig am 15.10.2030 | | 1.046 | 1.025 | 0,20 |
| 0,870 % fällig am 15.01.2030 | | 257 | 254 | 0,05 |
| **Oak Hill European Credit Partners Ltd.** | | | | |
| 0,900 % fällig am 22.07.2030 | | 187 | 186 | 0,04 |
| **OCP Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,820 % fällig am 15.01.2032 | | 800 | 789 | 0,16 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** | | | | |
| 0,730 % fällig am 15.07.2031 | | 876 | 859 | 0,17 |
| 0,780 % fällig am 15.04.2031 | | 277 | 273 | 0,05 |
| 1,050 % fällig am 15.10.2031 | | 1.100 | 1.083 | 0,21 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | |
| 0,740 % fällig am 15.10.2030 | | 500 | 492 | 0,10 |
| | | | 54.262 | 10,70 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Agence Francaise de Developpement** | | | | |
| 0,500 % fällig am 25.10.2022 | | 900 | 901 | 0,18 |
| **Free and Hanseatic City of Hamburg** | | | | |
| 1,875 % fällig am 26.09.2022 | | 2.600 | 2.613 | 0,51 |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 2,625 % fällig am 14.06.2023 | | 5.800 | 5.860 | 1,16 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Israel Government International Bond** | | | | |
| 0,750 % fällig am 31.07.2022 | ILS | 100 | € 27 | 0,01 |
| **Korea Housing Finance Corp.** | | | | |
| 0,723 % fällig am 22.03.2025 | € | 5.700 | 5.553 | 1,09 |
| **Morocco Government International Bond** | | | | |
| 4,250 % fällig am 11.12.2022 | $ | 7.200 | 6.892 | 1,36 |
| **Poland Government International Bond** | | | | |
| 0,000 % fällig am 07.07.2023 (a) | € | 3.100 | 3.065 | 0,60 |
| **Saudi Arabia Government International Bond** | | | | |
| 0,000 % fällig am 03.03.2024 (a) | | 7.800 | 7.545 | 1,49 |
| **Tokyo Metropolitan Government** | | | | |
| 0,770 % fällig am 20.12.2022 | ¥ | 80.000 | 565 | 0,11 |
| | | | 33.021 | 6,51 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | | |
| **Acciona Energia Financiacion Filiales S.A.** | | | | |
| (0,030) % fällig am 13.07.2022 | € | 2.600 | 2.600 | 0,51 |
| 0,010 % fällig am 27.07.2022 | | 2.500 | 2.500 | 0,49 |
| **Nomura Bank International PLC** | | | | |
| (0,314) % fällig am 14.07.2022 | | 2.700 | 2.701 | 0,53 |
| (0,172) % fällig am 09.09.2022 | | 1.800 | 1.801 | 0,36 |
| **Pure Finance S.A.** | | | | |
| 0,051 % fällig am 05.07.2022 | | 100 | 100 | 0,02 |
| 0,051 % fällig am 12.07.2022 | | 100 | 100 | 0,02 |
| 0,794 % fällig am 19.07.2022 | $ | 700 | 669 | 0,13 |
| 0,974 % fällig am 19.07.2022 | £ | 100 | 116 | 0,03 |
| **SGS Nederland Holding BV** | | | | |
| (0,142) % fällig am 13.07.2022 | € | 2.600 | 2.600 | 0,51 |
| (0,101) % fällig am 25.07.2022 | | 2.600 | 2.601 | 0,51 |
| | | | 15.788 | 3,11 |
| **EUROPEAN UNION TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,657) % fällig am 05.08.2022 (a)(b) | | 400 | 401 | 0,08 |
| (0,415) % fällig am 09.09.2022 (a)(b) | | 1.900 | 1.901 | 0,38 |
| | | | 2.302 | 0,46 |
| **FRANCE TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,727) % fällig am 13.07.2022 (a)(b) | | 1.580 | 1.580 | 0,31 |
| (0,634) % fällig am 03.08.2022 (a)(b) | | 1.000 | 1.000 | 0,20 |
| (0,618) % fällig am 03.08.2022 (a)(b) | | 100 | 100 | 0,02 |
| (0,552) % fällig am 24.08.2022 (a)(b) | | 1.000 | 1.001 | 0,20 |
| (0,448) % fällig am 14.09.2022 (a)(b) | | 600 | 601 | 0,12 |
| | | | 4.282 | 0,85 |
| **ISRAEL TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,030) % fällig am 03.08.2022 (a)(b) | ILS | 20.000 | 5.462 | 1,08 |
| 0,014 % fällig am 02.11.2022 (a)(b) | | 2.000 | 545 | 0,11 |
| 0,022 % fällig am 04.01.2023 (a)(b) | | 4.000 | 1.087 | 0,21 |
| 0,634 % fällig am 02.03.2023 (a)(b) | | 324 | 88 | 0,02 |
| 0,913 % fällig am 05.04.2023 (a)(b) | | 1.776 | 481 | 0,09 |
| 1,203 % fällig am 02.03.2023 (a)(b) | | 5.800 | 1.571 | 0,31 |
| | | | 9.234 | 1,82 |
| **JAPAN TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,184) % fällig am 26.09.2022 (a)(b) | ¥ | 1.830.000 | 12.889 | 2,54 |
| (0,122) % fällig am 15.08.2022 (a)(b) | | 700.000 | 4.929 | 0,97 |
| (0,121) % fällig am 22.08.2022 (a)(b) | | 1.290.000 | 9.085 | 1,79 |
| | | | 26.903 | 5,30 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **SPAIN TREASURY BILLS** | | | |
| (0,513) % fällig am 07.10.2022 (a)(b) | € 8.070 | € 8.075 | 1,59 |
| (0,219) % fällig am 07.10.2022 (a)(b) | 8.010 | 8.015 | 1,58 |
| | | 16.090 | 3,17 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 74.599 | 14,71 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | **€ 493.666** | **97,32** |

**PENSIONSGESCHÄFTE**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| COM | (1,200) % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | € 10.100 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,375 % fällig am 15.03.2023 | € (10.417) | € 10.100 | € 10.100 | 1,99 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **€ (10.417)** | **€ 10.100** | **€ 10.100** | **1,99** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month SOFR December Futures | Long | 03.2023 | 275 | € 49 | 0,01 |
| 3-Month SOFR March Futures | Short | 06.2023 | 275 | (69) | (0,01) |
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09.2022 | 430 | 797 | 0,16 |
| Euro-Schatz September Futures | Short | 09.2022 | 650 | 163 | 0,03 |
| | | | | € 940 | 0,19 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **€ 940** | **0,19** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Barclays Bank PLC | 1,000 % | 20.12.2022 | € 1.980 | € (7) | 0,00 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | **€ (7)** | **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.

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

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

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 08.2022 | ¥ 768.600 | € 5.660 | € 250 | € 0 | € 250 | 0,05 |
| | 03.2023 | ILS 5.752 | $ 1.695 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | DKK 3.895 | € 523 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | € 743 | DKK 5.530 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 966 | £ 824 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 07.2022 | 46.168 | $ 48.609 | 327 | 0 | 327 | 0,06 |
| | 07.2022 | £ 678 | € 786 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 2.429 | 2.290 | 0 | (33) | (33) | (0,01) |
| | 08.2022 | 46.537 | 44.165 | 0 | (267) | (267) | (0,05) |
| BRC | 07.2022 | DKK 4.500 | 605 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07.2022 | € | 4.530 | DKK | 33.709 | € 3 | € 0 | € 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 833 | £ | 711 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 153 | € | 102 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | CHF | 2.785 | | 2.740 | 0 | (43) | (43) | (0,01) |
| | 08.2022 | DKK | 33.708 | | 4.530 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 1.290.000 | | 9.533 | 453 | 0 | 453 | 0,09 |
| | 11.2022 | ILS | 2.000 | $ | 626 | 48 | 0 | 48 | 0,01 |
| CBK | 07.2022 | DKK | 7.100 | € | 954 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | ILS | 21.122 | $ | 6.151 | 106 | 0 | 106 | 0,02 |
| | 01.2023 | | 3.999 | | 1.269 | 105 | 0 | 105 | 0,02 |
| | 04.2023 | | 1.763 | | 540 | 25 | 0 | 25 | 0,01 |
| DUB | 07.2022 | DKK | 143.140 | € | 19.238 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | € | 13.077 | DKK | 97.303 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.038 | £ | 1.740 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 30.632 | € | 35.999 | 417 | 0 | 417 | 0,08 |
| | 08.2022 | DKK | 91.095 | | 12.243 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 4.789 | ¥ | 682.900 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 08.2022 | ILS | 3.043 | $ | 941 | 67 | 0 | 67 | 0,01 |
| MBC | 07.2022 | € | 848 | DKK | 6.305 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 56.703 | £ | 49.065 | 290 | 0 | 290 | 0,06 |
| | 08.2022 | £ | 49.132 | € | 56.703 | 0 | (291) | (291) | (0,06) |
| | 08.2022 | ¥ | 700.213 | | 5.222 | 293 | 0 | 293 | 0,06 |
| | 08.2022 | $ | 1.275 | ILS | 4.059 | 0 | (109) | (109) | (0,02) |
| | 03.2023 | ILS | 322 | $ | 98 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | € | 548 | | 588 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| RBC | 08.2022 | ¥ | 837 | € | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 08.2022 | € | 1.959 | CHF | 2.045 | 84 | 0 | 84 | 0,02 |
| | 09.2022 | ¥ | 1.830.000 | € | 12.888 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | DKK | 3.900 | | 524 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 562 | DKK | 4.185 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | ILS | 264 | $ | 78 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 1.188 | € | 786 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | € | 2.083 | DKK | 15.500 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.114 | £ | 1.802 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 47.749 | € | 44.426 | 0 | (1.249) | (1.249) | (0,25) |
| UAG | 07.2022 | € | 1.094 | £ | 943 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 38.468 | € | 45.079 | 394 | 0 | 394 | 0,08 |
| | | | | | | € 2.949 | € (2.066) | € 883 | 0,17 |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **€ 883** | **0,17** |
| **Summe Anlagen** | | | | | | | | **€ 505.582** | **99,67** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | | | | | | | **€ 1.677** | **0,33** |
| **Nettovermögen** | | | | | | | | **€ 507.259** | **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 3.228 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von EUR 1,170 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | € 493.666 | € 0 | € 493.666 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 10.100 | 0 | 10.100 |
| Finanzderivate[3] | 940 | 876 | 0 | 1.816 |
| **Summen** | **€ 940** | **€ 504.642** | **€ 0** | **€ 505.582** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 0 | € 595.961 | € 0 | € 595.961 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 26.537 | 0 | 26.537 |
| Finanzderivate[3] | 328 | (957) | 0 | (629) |
| **Summen** | **€ 328** | **€ 621.541** | **€ 0** | **€ 621.869** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | € 273 | € (320) | € (47) |
| BPS | 18 | (30) | (12) |
| BRC | 453 | (560) | (107) |
| CBK | 236 | 0 | 236 |
| DUB | (10) | 0 | (10) |
| JPM | 485 | (440) | 45 |
| MBC | 188 | (260) | (72) |
| MYI | 15 | (10) | 5 |
| RYL | 89 | 0 | 89 |
| SCX | 9 | 0 | 9 |
| SOG | (1.268) | 1.170 | (98) |
| UAG | 395 | (400) | (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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 85,43 | 85,00 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 8,62 | 9,62 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 3,27 | k. A. |
| Pensionsgeschäfte | 1,99 | 4,21 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,19 | 0,05 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,00 | 0,01 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,17 | (0,16) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 54,57 | 56,96 |
| US-Regierungsbehörden | 1,39 | 1,10 |
| Non-Agency-MBS | 9,44 | 8,63 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 10,70 | 10,12 |
| Staatsemissionen | 6,51 | 6,66 |
| Kurzfristige Instrumente | 14,71 | 11,15 |
| Pensionsgeschäfte | 1,99 | 4,21 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,19 | 0,05 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,00 | 0,00 |
| Zinsswaps | k. A. | 0,01 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | k. A. | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | 0,17 | (0,16) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 0,33 | 1,27 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Kaisa Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 9,750 % fällig am 28.09.2023 ^ | $ | 300 | € 40 | 0,03 |
| **CHINA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Huarong Universe Investment Holding Ltd.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 05.12.2022 | € | 1.500 | 1.448 | 1,01 |
| **Yango Justice International Ltd.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 25.11.2023 ^ | $ | 300 | 20 | 0,01 |
| Summe China | | | 1.468 | 1,02 |
| **TSCHECHISCHE REPUBLIK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **EP Infrastructure A/S** | | | | |
| 1,698 % fällig am 30.07.2026 | € | 400 | 281 | 0,19 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **DKT Finance ApS** | | | | |
| 7,000 % fällig am 17.06.2023 | | 1.000 | 953 | 0,66 |
| **Norican A/S** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.05.2023 | | 1.100 | 970 | 0,67 |
| **TDC Net A/S** | | | | |
| 5,056 % fällig am 31.05.2028 | | 300 | 281 | 0,20 |
| Summe Dänemark | | | 2.204 | 1,53 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Accor S.A.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 29.11.2028 | | 900 | 717 | 0,50 |
| **Air France-KLM** | | | | |
| 1,875 % fällig am 16.01.2025 | | 800 | 676 | 0,47 |
| **Altice France S.A.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.02.2025 | | 1.900 | 1.648 | 1,14 |
| 2,500 % fällig am 15.01.2025 | | 800 | 701 | 0,49 |
| **Banijay Entertainment SASU** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.03.2025 | | 900 | 806 | 0,56 |
| **CAB SELAS** | | | | |
| 3,375 % fällig am 01.02.2028 | | 1.100 | 887 | 0,62 |
| **Casino Guichard Perrachon S.A.** | | | | |
| 4,561 % fällig am 25.01.2023 | | 400 | 393 | 0,27 |
| **Chrome Bidco SASU** | | | | |
| 3,500 % fällig am 31.05.2028 | | 300 | 247 | 0,17 |
| **Electricite de France S.A.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 01.12.2027 (c) | | 1.000 | 708 | 0,49 |
| 3,375 % fällig am 15.06.2030 (c) | | 1.000 | 655 | 0,45 |
| **Elior Group S.A.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.07.2026 | | 900 | 703 | 0,49 |
| **Elis S.A.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 24.05.2027 | | 100 | 95 | 0,07 |
| **Faurecia SE** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.02.2027 | | 1.700 | 1.329 | 0,92 |
| **La Financiere Atalian SASU** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2025 | | 1.300 | 1.002 | 0,69 |
| **Loxam S.A.S.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.04.2026 | | 500 | 425 | 0,29 |
| 3,250 % fällig am 14.01.2025 | | 700 | 634 | 0,44 |
| 4,500 % fällig am 15.02.2027 | | 300 | 259 | 0,18 |
| 4,500 % fällig am 15.04.2027 | | 400 | 304 | 0,21 |
| **Renault S.A.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 04.10.2027 | | 2.000 | 1.467 | 1,02 |
| 2,375 % fällig am 25.05.2026 | | 1.000 | 860 | 0,60 |
| 2,500 % fällig am 02.06.2027 | | 600 | 484 | 0,34 |
| **Verallia S.A.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 10.11.2031 | | 800 | 599 | 0,42 |
| Summe Frankreich | | | 15.599 | 10,83 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Cheplapharm Arzneimittel GmbH** | | | | |
| 3,500 % fällig am 11.02.2027 | | 900 | 770 | 0,53 |
| 4,375 % fällig am 15.01.2028 | | 100 | 85 | 0,06 |
| **Clearstream Banking AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.12.2025 (b) | € | 100 | € 94 | 0,07 |
| **CT Investment GmbH** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.04.2026 | | 600 | 492 | 0,34 |
| **Ctec GmbH** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.02.2030 | | 200 | 146 | 0,10 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 4,000 % fällig am 24.06.2032 | | 300 | 275 | 0,19 |
| 5,625 % fällig am 19.05.2031 | | 2.600 | 2.601 | 1,81 |
| 6,750 % fällig am 30.10.2028 (c)(e) | | 200 | 179 | 0,12 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK)** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.05.2027 (a) | | 1.200 | 939 | 0,65 |
| **Nidda Healthcare Holding GmbH** | | | | |
| 3,500 % fällig am 30.09.2024 | | 1.800 | 1.592 | 1,11 |
| **Techem Verwaltungsgesellschaft mbH** | | | | |
| 2,000 % fällig am 15.07.2025 | | 800 | 704 | 0,49 |
| **ZF Finance GmbH** | | | | |
| 2,250 % fällig am 03.05.2028 | | 500 | 369 | 0,26 |
| 2,750 % fällig am 25.05.2027 | | 2.800 | 2.217 | 1,54 |
| Summe Deutschland | | | 10.463 | 7,27 |
| **IRLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bank of Ireland Group PLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 19.05.2025 (c)(e) | | 1.000 | 994 | 0,69 |
| **Permanent TSB Group Holdings PLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 19.08.2031 | | 1.000 | 835 | 0,58 |
| Summe Irland | | | 1.829 | 1,27 |
| **INSEL MAN** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **GVC Holdings PLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 29.03.2024 | | 1.800 | 1.705 | 1,18 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Atlantia SpA** | | | | |
| 1,875 % fällig am 12.02.2028 | | 4.900 | 3.827 | 2,66 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 1,875 % fällig am 09.01.2026 | | 900 | 754 | 0,52 |
| 5,375 % fällig am 18.01.2028 | | 1.150 | 683 | 0,47 |
| 10,500 % fällig am 23.07.2029 | | 200 | 140 | 0,10 |
| **Castor SpA** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.02.2029 | | 600 | 539 | 0,37 |
| **FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.08.2027 | | 900 | 765 | 0,53 |
| **Inter Media and Communication SpA** | | | | |
| 6,750 % fällig am 09.02.2027 | | 1.300 | 1.163 | 0,81 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 6,375 % fällig am 30.03.2028 (c)(e) | | 400 | 339 | 0,24 |
| **Nexi SpA** | | | | |
| 2,125 % fällig am 30.04.2029 | | 1.800 | 1.262 | 0,88 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 6,625 % fällig am 03.06.2023 (c)(e) | | 600 | 571 | 0,40 |
| 7,500 % fällig am 03.06.2026 (c)(e) | | 700 | 648 | 0,45 |
| Summe Italien | | | 10.691 | 7,43 |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **SoftBank Group Corp.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 06.07.2029 | | 400 | 277 | 0,19 |
| 4,000 % fällig am 19.09.2029 | | 700 | 501 | 0,35 |
| 4,625 % fällig am 06.07.2028 | $ | 400 | 300 | 0,21 |
| 5,000 % fällig am 15.04.2028 | € | 700 | 558 | 0,39 |
| Summe Japan | | | 1.636 | 1,14 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Adient Global Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.08.2024 | | 1.900 | 1.723 | 1,20 |
| **HSBC Bank Capital Funding Sterling LP** | | | | |
| 5,844 % fällig am 05.11.2031 (c) | £ | 250 | 334 | 0,23 |
| **HSBC Capital Funding Dollar LP** | | | | |
| 10,176 % fällig am 30.06.2030 (c) | $ | 100 | 130 | 0,09 |
| Summe Jersey, Kanalinseln | | | 2.187 | 1,52 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **WANDELANLEIHEN & WECHSEL** | | | | |
| **Corestate Capital Holding S.A.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 28.11.2022 | € | 200 | € 52 | 0,04 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Albion Financing SARL** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.10.2026 | | 1.700 | 1.425 | 0,99 |
| **Altice Financing S.A.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.01.2028 | | 1.200 | 899 | 0,62 |
| **Altice France Holding S.A.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 15.05.2027 | | 1.600 | 1.320 | 0,92 |
| **Cidron Aida Finco SARL** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.04.2028 | | 400 | 335 | 0,23 |
| **Cirsa Finance International SARL** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2027 | | 1.200 | 975 | 0,68 |
| **Corestate Capital Holding S.A.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.04.2023 | | 300 | 68 | 0,05 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 16.07.2025 (c) | | 1.000 | 582 | 0,40 |
| 4,875 % fällig am 18.08.2026 (c) | | 400 | 233 | 0,16 |
| **InPost S.A.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.07.2027 | | 900 | 708 | 0,49 |
| **Loarre Investments SARL** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.05.2029 | | 400 | 374 | 0,26 |
| **Matterhorn Telecom S.A.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.09.2026 | | 1.150 | 982 | 0,68 |
| **PLT Finance SARL** | | | | |
| 4,625 % fällig am 05.01.2026 | | 1.000 | 880 | 0,61 |
| **Rossini SARL** | | | | |
| 6,750 % fällig am 30.10.2025 | | 1.000 | 965 | 0,67 |
| **Signa Development Finance SCS** | | | | |
| 5,500 % fällig am 23.07.2026 | | 600 | 442 | 0,31 |
| **Summer BC Holdco SARL** | | | | |
| 5,750 % fällig am 31.10.2026 | | 1.150 | 1.007 | 0,70 |
| **Trafigura Funding S.A.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 02.02.2026 | | 500 | 431 | 0,30 |
| | | | 11.626 | 8,07 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Summer (BC) Holdco B SARL** | | | | |
| 6,611 % fällig am 04.12.2026 | $ | 975 | 935 | 0,65 |
| Summe Luxemburg | | | 12.613 | 8,76 |
| **MULTINATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Clarios Global LP** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.05.2026 | € | 1.000 | 877 | 0,61 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Axalta Coating Systems Dutch Holding BV** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.01.2025 | | 900 | 816 | 0,57 |
| **Dufry One BV** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.10.2024 | | 1.600 | 1.455 | 1,01 |
| 3,625 % fällig am 15.04.2026 | CHF | 900 | 797 | 0,55 |
| **Energizer Gamma Acquisition BV** | | | | |
| 3,500 % fällig am 30.06.2029 | € | 1.000 | 716 | 0,50 |
| **Q-Park Holding BV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.03.2027 | | 1.600 | 1.280 | 0,89 |
| **Sigma Holdco BV** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.05.2026 (f) | | 800 | 423 | 0,29 |
| **Summer BidCo BV (9,000 % bar oder 9,750 % PIK)** | | | | |
| 9,000 % fällig am 15.11.2025 (a) | | 330 | 268 | 0,18 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | | |
| 1,875 % fällig am 31.03.2027 | | 3.400 | 2.660 | 1,85 |
| **United Group BV** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.02.2028 | | 1.950 | 1.455 | 1,01 |
| **WP/AP Telecom Holdings BV** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.01.2029 | | 1.100 | 905 | 0,63 |
| | | | 10.775 | 7,48 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Sigma Bidco BV** | | | | |
| 3,500 % fällig am 02.07.2025 | | 1.000 | 759 | 0,53 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Starfruit Finco BV** | | | | |
| 3,250 % fällig am 01.10.2025 | € | 944 | € 867 | 0,60 |
| | | | 1.626 | 1,13 |
| Summe Niederlande | | | 12.401 | 8,61 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Adevinta ASA** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.11.2027 | | 1.200 | 1.007 | 0,70 |
| **PANAMA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Carnival Corp.** | | | | |
| 10,125 % fällig am 01.02.2026 | | 1.300 | 1.290 | 0,90 |
| **RUMÄNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **RCS & RDS S.A.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 05.02.2025 | | 900 | 795 | 0,55 |
| 3,250 % fällig am 05.02.2028 | | 800 | 629 | 0,44 |
| Summe Rumänien | | | 1.424 | 0,99 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 14.01.2026 (c)(e) | | 600 | 506 | 0,35 |
| **Cellnex Finance Co. S.A.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 08.06.2028 | | 2.000 | 1.568 | 1,09 |
| 2,000 % fällig am 15.09.2032 | | 1.300 | 885 | 0,62 |
| **Cellnex Telecom S.A.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 23.10.2030 | | 200 | 143 | 0,10 |
| **Lorca Telecom Bondco S.A.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 18.09.2027 | | 1.600 | 1.342 | 0,93 |
| Summe Spanien | | | 4.444 | 3,09 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Dometic Group AB** | | | | |
| 2,000 % fällig am 29.09.2028 | | 1.000 | 714 | 0,50 |
| **Intrum AB** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.07.2024 | | 600 | 557 | 0,39 |
| 3,500 % fällig am 15.07.2026 | | 1.650 | 1.385 | 0,96 |
| 4,875 % fällig am 15.08.2025 | | 1.100 | 1.000 | 0,69 |
| **Verisure Holding AB** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.02.2027 | | 1.700 | 1.410 | 0,98 |
| **Verisure Midholding AB** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.02.2029 | | 700 | 535 | 0,37 |
| **Volvo Car AB** | | | | |
| 4,250 % fällig am 31.05.2028 | | 900 | 843 | 0,58 |
| Summe Schweden | | | 6.444 | 4,47 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 9,750 % fällig am 23.06.2027 (c)(e) | $ | 800 | € 783 | 0,54 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BCP Modular Services Finance PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.11.2028 | € | 600 | 479 | 0,33 |
| 6,750 % fällig am 30.11.2029 | | 500 | 368 | 0,26 |
| **Burford Capital PLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.12.2026 | £ | 700 | 754 | 0,52 |
| **Gatwick Airport Finance PLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 07.04.2026 | | 400 | 407 | 0,28 |
| **Heathrow Finance PLC** | | | | |
| 4,625 % fällig am 01.09.2029 | | 400 | 401 | 0,28 |
| **INEOS Quattro Finance PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.01.2026 | $ | 1.900 | 1.529 | 1,06 |
| **International Game Technology PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.04.2028 | € | 1.400 | 1.107 | 0,77 |
| **Jaguar Land Rover Automotive PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2026 | | 800 | 663 | 0,46 |
| 5,875 % fällig am 15.11.2024 | | 300 | 277 | 0,19 |
| **Market Bidco Finco PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 04.11.2027 | | 1.600 | 1.275 | 0,89 |
| **Rolls-Royce PLC** | | | | |
| 4,625 % fällig am 16.02.2026 | | 2.100 | 1.978 | 1,37 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.01.2030 | £ | 1.600 | 1.502 | 1,04 |
| **Virgin Money UK PLC** | | | | |
| 9,250 % fällig am 08.06.2024 (c)(e) | | 800 | 920 | 0,64 |
| **Vmed O2 UK Financing PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 31.01.2031 | € | 800 | 619 | 0,43 |
| 4,000 % fällig am 31.01.2029 | £ | 100 | 93 | 0,07 |
| 4,250 % fällig am 31.01.2031 | $ | 200 | 154 | 0,11 |
| **Zenith Finco PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 30.06.2027 | £ | 800 | 752 | 0,52 |
| Summe Großbritannien | | | 13.278 | 9,22 |
| **USA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **American Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,375 % fällig am 01.11.2028 | $ | 488 | 420 | 0,29 |
| 3,700 % fällig am 01.04.2028 | | 477 | 396 | 0,28 |
| **Avantor Funding, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.07.2028 | € | 1.100 | 958 | 0,67 |
| **Coty, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.04.2026 | | 1.700 | 1.508 | 1,05 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 2,386 % fällig am 17.02.2026 | | 1.500 | 1.316 | 0,91 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 3,625 % fällig am 17.06.2031 | $ | 1.400 | 1.042 | 0,72 |
| 4,950 % fällig am 28.05.2027 | | 200 | 178 | 0,12 |
| **Gap, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.10.2031 | $ | 1.000 | € 669 | 0,47 |
| **Graphic Packaging International LLC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 01.02.2029 | € | 300 | 245 | 0,17 |
| **IQVIA, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.03.2029 | | 1.000 | 796 | 0,55 |
| **Occidental Petroleum Corp.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.09.2030 | $ | 1.000 | 987 | 0,69 |
| **Olympus Water U.S. Holding Corp.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.10.2028 | € | 1.000 | 814 | 0,57 |
| 5,375 % fällig am 01.10.2029 | | 400 | 289 | 0,20 |
| **Organon & Co.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 30.04.2028 | | 1.100 | 924 | 0,64 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | | |
| 8,200 % fällig am 06.04.2028 | $ | 1.523 | 1.515 | 1,05 |
| ` | | | | |
| 2,250 % fällig am 21.11.2026 | € | 1.200 | 942 | 0,65 |
| **United Airlines, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.04.2026 | $ | 100 | 85 | 0,06 |
| 4,625 % fällig am 15.04.2029 | | 100 | 81 | 0,06 |
| **WMG Acquisition Corp.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.08.2031 | € | 1.100 | 838 | 0,58 |
| | | | 14.003 | 9,73 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **INEOS Finance PLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.04.2024 | | 2.573 | 2.463 | 1,71 |
| **Veritas U.S., Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.09.2025 | | 987 | 862 | 0,60 |
| **Zayo Group Holdings, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 09.03.2027 | | 982 | 869 | 0,60 |
| | | | 4.194 | 2,91 |
| Summe USA | | | 18.197 | 12,64 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **€ 120.861** | **83,94** |
| | | **AKTIEN** | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (d)** | | 82.800 | 7.901 | 5,49 |
| **Summe Investmentfonds** | | | **€7.901** | **5,49** |

**PENSIONSGESCHÄFTE**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | (1,900) % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | € 13.200 | Republic of Germany 2,500 % fällig am 04.07.2044 | € (13.310) | € 13.200 | € 13.199 | 9,17 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **€ (13.310)** | **€ 13.200** | **€ 13.199** | **9,17** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

### FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bobl September Futures | Long | 09.2022 | 11 | € 33 | 0,02 |
| Euro-Schatz September Futures | Long | 09.2022 | 246 | (89) | (0,06) |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 6 | (5) | 0,00 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 10 | 7 | 0,01 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Long | 09.2022 | 8 | (38) | (0,03) |
| | | | | € (92) | (0,06) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **€ (92)** | **(0,06)** |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Casino Guichard Perrachon S.A. | 5,000 % | 20.06.2023 | € 1.236 | € (52) | (0,03) |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Crossover 37 5-Year Index | 5,000 % | 20.06.2027 | € 8.700 | € (701) | (0,49) |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 % | 21.09.2024 | £ 2.900 | € (42) | (0,03) |
| Zahlung[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 | 21.09.2027 | 3.200 | (118) | (0,08) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,000 | 16.12.2025 | $ 3.800 | 344 | 0,24 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,000 | 16.12.2030 | 3.000 | 426 | 0,29 |
| | | | | | € 610 | 0,42 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **€ (143)** | **(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.

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

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

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

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,600 % | 17.08.2022 | 1.400 | € (3) | € (2) | (0,01) |

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,018 % | 20.10.2023 | 1.300 | € (8) | € (9) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,018 | 20.10.2023 | 1.300 | (8) | (6) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,140 | 23.10.2023 | 1.300 | (9) | (10) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,140 | 23.10.2023 | 1.300 | (9) | (6) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,190 | 23.10.2023 | 1.300 | (8) | (11) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,190 | 23.10.2023 | 1.300 | (8) | (6) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,225 | 23.10.2023 | 1.300 | (8) | (11) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,225 | 23.10.2023 | 1.300 | (8) | (6) | 0,00 |

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,973 % | 25.10.2023 | 1.300 | € (8) | € (9) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,973 | 25.10.2023 | 1.300 | (8) | (7) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,841 | 27.10.2023 | 1.300 | (9) | (8) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,841 | 27.10.2023 | 1.300 | (8) | (7) | (0,01) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,088 | 03.11.2023 | 400 | (3) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,088 | 03.11.2023 | 400 | (3) | (2) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,721 | 08.04.2024 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,721 | 08.04.2024 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | | € (107) | € (103) | (0,07) |

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

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 07.2022 | CHF 896 | € 872 | € 0 | € (23) | € (23) | (0,02) |
| | 07.2022 | € 299 | £ 255 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07.2022 | 9.718 | $ 10.221 | 59 | 0 | 59 | 0,04 |
| | 07.2022 | $ 97 | € 92 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | 9.637 | 9.146 | 0 | (55) | (55) | (0,04) |
| BRC | 07.2022 | £ 275 | 320 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 787 | 749 | 0 | (4) | (4 ) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | £ 2.255 | 2.647 | 27 | 0 | 27 | 0,02 |
| MBC | 07.2022 | € 4.591 | £ 3.972 | 24 | 0 | 24 | 0,02 |
| | 08.2022 | £ 3.978 | € 4.591 | 0 | (23) | (23) | (0,02) |
| MYI | 07.2022 | 64 | 74 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | € 849 | CHF 848 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 9.542 | € 8.878 | 0 | (250) | (250) | (0,17) |
| | 08.2022 | CHF 849 | 849 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | £ 2.829 | 3.315 | 29 | 0 | 29 | 0,02 |
| | | | | € 140 | € (360) | € (220) | (0,15) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **€ (325)** | **(0,23)** |
| **Summe Anlagen** | **€ 141.402** | **98,21** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **€ 2.583** | **1,79** |
| **Nettovermögen** | **€ 143.985** | **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)** **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurde zum 30. Juni 2022 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von EUR 212 als Sicherheiten verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von EUR 2.133 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von EUR 260 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | € 119.926 | € 935 | € 120.861 |
| Investmentfonds | 7.901 | 0 | 0 | 7.901 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 13.200 | 0 | 13.200 |
| Finanzderivate[3] | (92) | (468) | 0 | (560) |
| **Summen** | **€ 7.809** | **€ 132.658** | **€ 935** | **€ 141.402** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 0 | € 154.011 | € 0 | € 154.011 |
| Investmentfonds | 0 | 9.575 | 0 | 9.575 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 4.900 | 0 | 4.900 |
| Finanzderivate[3] | (140 ) | 203 | 0 | 63 |
| **Summen** | **€ (140 )** | **€ 168.689** | **€ 0** | **€ 168.549** |

(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 2022:**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | (1,800) % | 29.03.2022 | TBD[1] | € (331) | € (329) | (0,23) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **€ (329)** | **(0,23)** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BPS | € (23) | € 0 | € (23) |
| BRC | (6) | 0 | (6) |
| CBK | 27 | 0 | 27 |
| GLM | (103) | 0 | (103) |
| MBC | 1 | 0 | 1 |
| SOG | (250) | 260 | 10 |
| UAG | 29 | 0 | 29 |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 71,07 | 74,05 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 9,00 | 11,84 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 3,87 | 4,44 |
| Investmentfonds | 5,49 | 5,62 |
| Pensionsgeschäfte | 9,17 | 2,87 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,06) | (0,08) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,10) | 0,09 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (0,23) | 0,03 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (0,23) | k. A. |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Österreich | k. A. | 0,47 |
| Cayman-Inseln | 0,03 | 0,04 |
| China | 1,02 | 0,85 |
| Tschechische Republik | 0,19 | k. A. |
| Dänemark | 1,53 | 0,60 |
| Frankreich | 10,83 | 11,44 |
| Deutschland | 7,27 | 7,90 |
| Irland | 1,27 | 1,27 |
| Insel Man | 1,18 | 1,04 |
| Italien | 7,43 | 6,64 |
| Japan | 1,14 | 1,24 |
| Jersey, Kanalinseln | 1,52 | 2,07 |
| Luxemburg | 8,76 | 11,64 |
| Mexiko | k. A. | 1,04 |
| Multinational | 0,61 | 0,35 |
| Niederlande | 8,61 | 8,64 |
| Norwegen | 0,70 | k. A. |
| Panama | 0,90 | 0,87 |
| Rumänien | 0,99 | 0,98 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Spanien | 3,09 | 0,42 |
| Schweden | 4,47 | 4,00 |
| Schweiz | 0,54 | k. A. |
| Großbritannien | 9,22 | 9,73 |
| USA | 12,64 | 18,63 |
| Kurzfristige Instrumente | k. A. | 0,47 |
| Investmentfonds | 5,49 | 5,62 |
| Pensionsgeschäfte | 9,17 | 2,87 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,06) | (0,08) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,03) | k. A. |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,49) | (0,01) |
| Zinsswaps | 0,42 | 0,10 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,01) | k. A. |
| Zinsswapoptionen | (0,07) | k. A. |
| Devisenterminkontrakte | (0,15) | 0,03 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 1,79 | 1,14 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | |
| 4,375 % fällig am 22.09.2025 (c)(e) | € | 1.700 | € 1.511 | 0,55 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (c)(e) | | 600 | 578 | 0,21 |
| **Banco BTG Pactual S.A.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 10.01.2025 | $ | 1.300 | 1.199 | 0,44 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 21.03.2029 (c)(e) | € | 600 | 417 | 0,15 |
| **Bank of Ireland Group PLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 19.05.2025 (c)(e) | | 600 | 596 | 0,22 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (e) | $ | 4.000 | 3.865 | 1,41 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 03.09.2023 | € | 500 | 499 | 0,18 |
| 2,885 % fällig am 31.01.2027 | | 900 | 876 | 0,32 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (c)(e) | £ | 300 | 344 | 0,13 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (c)(e) | $ | 200 | 188 | 0,07 |
| **Bevco Lux SARL** | | | | |
| 1,000 % fällig am 16.01.2030 | € | 1.300 | 1.028 | 0,38 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 3,250 % fällig am 29.12.2026 (c)(e) | | 400 | 328 | 0,12 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 23.04.2027 | | 400 | 320 | 0,12 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,862 % fällig am 31.05.2024 | | 900 | 903 | 0,33 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 1,250 % fällig am 17.07.2025 | | 900 | 856 | 0,31 |
| 4,207 % fällig am 12.06.2024 | $ | 1.100 | 1.043 | 0,38 |
| 7,125 % fällig am 29.07.2022 (c)(e) | | 200 | 191 | 0,07 |
| 7,250 % fällig am 12.09.2025 (c)(e) | | 700 | 582 | 0,21 |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (c)(e) | | 600 | 531 | 0,19 |
| 7,500 % fällig am 11.12.2023 (c)(e) | | 300 | 274 | 0,10 |
| **CTP NV** | | | | |
| 0,500 % fällig am 21.06.2025 | € | 800 | 682 | 0,25 |
| 0,625 % fällig am 27.09.2026 | | 500 | 400 | 0,15 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 2,222 % fällig am 18.09.2024 | $ | 200 | 185 | 0,07 |
| 2,625 % fällig am 16.12.2024 | £ | 1.200 | 1.328 | 0,49 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.01.2028 (a) | € | 400 | 361 | 0,13 |
| **DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH** | | | | |
| 2,500 % fällig am 25.01.2027 | | 1.900 | 1.577 | 0,58 |
| **Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial** | | | | |
| 0,010 % fällig am 23.06.2028 | | 1.500 | 1.347 | 0,49 |
| **Europäische Finanzstabilisierungsfazilität** | | | | |
| 0,000 % fällig am 20.01.2031 (a) | | 600 | 506 | 0,19 |
| **Europäische Union** | | | | |
| 0,200 % fällig am 04.06.2036 | | 500 | 374 | 0,14 |
| 0,250 % fällig am 22.04.2036 | | 2.100 | 1.591 | 0,58 |
| 0,400 % fällig am 04.02.2037 | | 900 | 690 | 0,25 |
| 0,450 % fällig am 04.07.2041 | | 1.200 | 837 | 0,31 |
| 0,750 % fällig am 04.01.2047 | | 550 | 385 | 0,14 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028 | | 1.000 | 927 | 0,34 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 1,744 % fällig am 19.07.2024 | | 400 | 370 | 0,14 |
| 2,748 % fällig am 14.06.2024 | £ | 900 | 967 | 0,35 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 0,955 % fällig am 07.09.2023 | € | 800 | 789 | 0,29 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 0,555 % fällig am 30.04.2024 | | 600 | 600 | 0,22 |
| 0,579 % fällig am 07.02.2025 | | 1.100 | 1.095 | 0,40 |
| 2,870 % fällig am 15.03.2024 | $ | 300 | 287 | 0,10 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 4,875 % fällig am 16.05.2029 (c)(e) | | 200 | 157 | 0,06 |
| 5,750 % fällig am 16.11.2026 (c)(e) | | 1.000 | 876 | 0,32 |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.10.2040 | DKK | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 56.827 | 5.747 | 2,10 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 21.112 | 2.080 | 0,76 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 3.992 | 434 | 0,16 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** | | | | |
| 0,375 % fällig am 20.05.2036 | € | 800 | € 617 | 0,23 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 0,125 % fällig am 13.09.2023 | | 600 | 586 | 0,21 |
| 3,500 % fällig am 09.04.2025 | | 1.200 | 1.217 | 0,44 |
| **Liberty Living Finance PLC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 28.11.2024 | £ | 1.200 | 1.351 | 0,49 |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 4,269 % fällig am 22.03.2025 | $ | 300 | 284 | 0,10 |
| **Nexi SpA** | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.04.2026 | € | 1.000 | 817 | 0,30 |
| **NN Group NV** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2026 (c) | | 600 | 580 | 0,21 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.10.2040 | DKK | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 137.551 | 13.971 | 5,10 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 20.059 | 1.976 | 0,72 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 8.731 | 948 | 0,35 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 7.600 | 800 | 0,29 |
| **Nova Kreditna Banka Maribor d.d.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 27.01.2025 | € | 800 | 756 | 0,28 |
| **Nova Ljubljanska Banka d.d.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 05.02.2030 | | 200 | 176 | 0,06 |
| 3,650 % fällig am 19.11.2029 | | 800 | 712 | 0,26 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.10.2040 | DKK | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 38.780 | 3.883 | 1,42 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 118.961 | 12.023 | 4,39 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 30.345 | 3.171 | 1,16 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2053 | | 7.285 | 828 | 0,30 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2053 | | 2.200 | 277 | 0,10 |
| 3,500 % fällig am 01.10.2053 | | 19.700 | 2.557 | 0,93 |
| 4,125 % fällig am 15.04.2026 (c)(e) | € | 400 | 367 | 0,13 |
| **Permanent TSB Group Holdings PLC** | | | | |
| 2,125 % fällig am 26.09.2024 | | 1.000 | 977 | 0,36 |
| 5,250 % fällig am 30.06.2025 | | 600 | 601 | 0,22 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 19.307 | 2.039 | 0,75 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 5.866 | 579 | 0,21 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 5.483 | 577 | 0,21 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2053 | | 54.921 | 6.026 | 2,20 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2053 | | 13.900 | 1.747 | 0,64 |
| **Sirius Real Estate Ltd.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 22.06.2026 | € | 400 | 346 | 0,13 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 18.12.2023 (c)(e) | $ | 300 | 282 | 0,10 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 1,319 % fällig am 14.10.2023 | | 500 | 475 | 0,17 |
| **TP ICAP Finance PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 26.01.2024 | £ | 358 | 412 | 0,15 |
| **UBS AG** | | | | |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (e) | $ | 850 | 815 | 0,30 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | | 2.050 | 2.031 | 0,74 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 1,875 % fällig am 31.01.2024 | € | 3.900 | 3.878 | 1,42 |
| **Volkswagen Financial Services NV** | | | | |
| 0,875 % fällig am 20.02.2025 | £ | 400 | 427 | 0,16 |
| | | | 109.830 | 40,13 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **Abertis Infraestructuras S.A.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 27.11.2026 | | 200 | 220 | 0,08 |
| **Altice France S.A.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.02.2025 | € | 300 | 260 | 0,10 |
| **Atlantia SpA** | | | | |
| 1,625 % fällig am 03.02.2025 | | 700 | 640 | 0,23 |
| 1,875 % fällig am 13.07.2027 | | 1.600 | 1.305 | 0,48 |
| 1,875 % fällig am 12.02.2028 | | 800 | 625 | 0,23 |
| **Crown European Holdings S.A.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 30.09.2024 | | 1.400 | 1.336 | 0,49 |
| **Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide** | | | | |
| 1,625 % fällig am 09.07.2024 | | 2.400 | 2.325 | 0,85 |
| **GE Capital UK Funding Unlimited Co.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 13.09.2023 | £ | 200 | € 234 | 0,09 |
| **GN Store Nord A/S** | | | | |
| 0,875 % fällig am 25.11.2024 | € | 1.300 | 1.231 | 0,45 |
| **Heathrow Funding Ltd.** | | | | |
| 5,225 % fällig am 15.02.2023 | £ | 1.100 | 1.293 | 0,47 |
| **Highland Holdings SARL** | | | | |
| 0,000 % fällig am 12.11.2023 (a) | € | 900 | 879 | 0,32 |
| **Informa PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 05.07.2023 | | 400 | 394 | 0,14 |
| **Jaguar Land Rover Automotive PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.07.2028 | | 700 | 504 | 0,18 |
| **John Lewis PLC** | | | | |
| 6,125 % fällig am 21.01.2025 | £ | 500 | 601 | 0,22 |
| **Market Bidco Finco PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 04.11.2027 | € | 600 | 478 | 0,17 |
| **Organon & Co.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 30.04.2028 | | 100 | 84 | 0,03 |
| **Prosus NV** | | | | |
| 3,257 % fällig am 19.01.2027 | $ | 1.100 | 915 | 0,33 |
| **Rolls-Royce PLC** | | | | |
| 4,625 % fällig am 16.02.2026 | € | 600 | 565 | 0,21 |
| **Silfin NV** | | | | |
| 2,875 % fällig am 11.04.2027 | | 1.200 | 876 | 0,32 |
| **Travis Perkins PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 07.09.2023 | £ | 1.100 | 1.226 | 0,45 |
| **Ubisoft Entertainment S.A.** | | | | |
| 1,289 % fällig am 30.01.2023 | € | 1.000 | 1.000 | 0,37 |
| | | | 16.991 | 6,21 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **Electricite de France S.A.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 01.12.2027 (c) | | 800 | 566 | 0,21 |
| 2,875 % fällig am 15.12.2026 (c) | | 1.000 | 780 | 0,28 |
| **Sprint Corp.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.06.2024 | $ | 300 | 295 | 0,11 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2023 | | 1.400 | 1.385 | 0,50 |
| | | | 3.026 | 1,10 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 129.847 | 47,44 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.08.2052 | | 7.800 | 6.943 | 2,54 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2052 | | 1.900 | 1.746 | 0,64 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2052 | | 2.100 | 1.978 | 0,72 |
| | | | 10.667 | 3,90 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (b)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2031 | | 1.510 | 1.374 | 0,50 |
| 0,125 % fällig am 15.02.2051 | | 2.443 | 1.804 | 0,66 |
| | | | 3.178 | 1,16 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Avon Finance PLC** | | | | |
| 1,690 % fällig am 20.09.2048 | £ | 1.046 | 1.209 | 0,44 |
| **Barley Hill PLC** | | | | |
| 1,892 % fällig am 27.08.2058 | | 415 | 476 | 0,17 |
| **Canterbury Finance PLC** | | | | |
| 1,940 % fällig am 16.05.2057 | | 112 | 131 | 0,05 |
| **Charter Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,540 % fällig am 16.01.2057 | | 229 | 266 | 0,10 |
| **Cheshire PLC** | | | | |
| 1,527 % fällig am 20.08.2045 | | 298 | 343 | 0,12 |
| **Dilosk RMBS DAC** | | | | |
| 0,382 % fällig am 20.02.2060 | € | 452 | 449 | 0,16 |
| 0,528 % fällig am 20.12.2060 | | 868 | 857 | 0,31 |
| **Domi BV** | | | | |
| 0,569 % fällig am 15.06.2051 | | 224 | 223 | 0,08 |
| **Dutch Property Finance BV** | | | | |
| 0,235 % fällig am 28.07.2058 | | 853 | 846 | 0,31 |
| 0,250 % fällig am 28.01.2048 | | 1.541 | 1.541 | 0,56 |
| 0,285 % fällig am 28.04.2059 | | 871 | 865 | 0,32 |
| 0,320 % fällig am 28.10.2059 | | 800 | 790 | 0,29 |
| 1,250 % fällig am 28.04.2050 | | 900 | 895 | 0,33 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Eurosail PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 13.03.2045 | € | 338 | € | 336 | 0,12 |
| **Fingal Securities RMBS DAC** | | | | | |
| 0,570 % fällig am 28.07.2055 | | 160 | | 160 | 0,06 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | | |
| 2,065 % fällig am 16.06.2070 | £ | 281 | | 325 | 0,12 |
| **Harmony French Home Loans** | | | | | |
| 0,301 % fällig am 27.05.2062 | € | 400 | | 399 | 0,15 |
| **Jubilee Place BV** | | | | | |
| 0,552 % fällig am 17.10.2057 | | 260 | | 256 | 0,09 |
| **Lanebrook Mortgage Transaction PLC** | | | | | |
| 1,111 % fällig am 20.07.2058 | £ | 586 | | 665 | 0,24 |
| 1,852 % fällig am 12.06.2057 | | 522 | | 604 | 0,22 |
| **Miravet SARL** | | | | | |
| 0,494 % fällig am 26.05.2065 | € | 566 | | 568 | 0,21 |
| **Polaris PLC** | | | | | |
| 1,730 % fällig am 23.12.2058 | £ | 566 | | 649 | 0,24 |
| 1,740 % fällig am 23.10.2059 | | 494 | | 566 | 0,21 |
| 2,065 % fällig am 27.05.2057 | | 405 | | 470 | 0,17 |
| **Precise Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 1,952 % fällig am 12.12.2055 | | 490 | | 566 | 0,21 |
| **Primrose Residential DAC** | | | | | |
| 0,238 % fällig am 24.03.2061 | € | 1.707 | | 1.683 | 0,61 |
| 0,488 % fällig am 24.10.2061 | | 887 | | 877 | 0,32 |
| **Residential Mortgage Securities PLC** | | | | | |
| 2,040 % fällig am 20.06.2070 | £ | 518 | | 600 | 0,22 |
| **Ripon Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,351 % fällig am 28.08.2056 | | 1.156 | | 1.329 | 0,49 |
| **Shamrock Residential DAC** | | | | | |
| 0,338 % fällig am 24.12.2059 | € | 509 | | 505 | 0,18 |
| **Stanlington PLC** | | | | | |
| 1,702 % fällig am 12.06.2056 | £ | 571 | | 649 | 0,24 |
| **Stratton Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2060 | | 2.013 | | 2.320 | 0,85 |
| 1,452 % fällig am 12.12.2043 | | 591 | | 679 | 0,25 |
| 1,652 % fällig am 12.03.2052 | | 609 | | 699 | 0,25 |
| 1,674 % fällig am 25.09.2051 | | 436 | | 504 | 0,18 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2045 | | 375 | | 435 | 0,16 |
| 1,527 % fällig am 20.05.2045 | | 762 | | 882 | 0,32 |
| **Tower Bridge Funding PLC** | | | | | |
| 1,407 % fällig am 20.11.2063 | | 659 | | 756 | 0,28 |
| **Trinity Square PLC** | | | | | |
| 1,300 % fällig am 15.07.2059 | | 967 | | 1.116 | 0,41 |
| **Tudor Rose Mortgages** | | | | | |
| 1,390 % fällig am 20.06.2048 | | 412 | | 473 | 0,17 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | | |
| 2,002 % fällig am 12.12.2054 | | 512 | | 590 | 0,22 |
| | | | | 28.552 | 10,43 |

## FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Adagio CLO DAC** | | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.10.2031 | € | 300 | | 294 | 0,11 |
| **Ares European CLO DAC** | | | | | |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | | 500 | | 489 | 0,18 |
| **Armada Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.07.2031 | | 700 | | 682 | 0,25 |
| **Aurium CLO DAC** | | | | | |
| 0,670 % fällig am 16.04.2030 | | 199 | | 196 | 0,07 |
| 0,730 % fällig am 16.01.2031 | | 1.000 | | 982 | 0,36 |
| 1,050 % fällig am 23.03.2032 | | 754 | | 740 | 0,27 |
| **Auto ABS French Leases FCT** | | | | | |
| 0,149 % fällig am 29.06.2033 | | 1.200 | | 1.202 | 0,44 |
| **Bain Capital Euro DAC** | | | | | |
| 0,740 % fällig am 20.01.2032 | € | 600 | € | 582 | 0,21 |
| **Bavarian Sky S.A.** | | | | | |
| 0,206 % fällig am 20.05.2027 | | 178 | | 178 | 0,07 |
| **BBVA Consumer Auto** | | | | | |
| 0,270 % fällig am 20.07.2031 | | 272 | | 268 | 0,10 |
| **Black Diamond CLO DAC** | | | | | |
| 0,860 % fällig am 20.01.2032 | | 599 | | 591 | 0,22 |
| 0,980 % fällig am 15.05.2032 | | 500 | | 489 | 0,18 |
| **BlueMountain Fuji EUR CLO DAC** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 15.07.2030 | | 689 | | 679 | 0,25 |
| 0,720 % fällig am 15.01.2031 | | 600 | | 585 | 0,21 |
| 0,910 % fällig am 15.01.2033 | | 800 | | 770 | 0,28 |
| 1,050 % fällig am 15.01.2031 | | 100 | | 97 | 0,04 |
| **BNPP AM Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 15.10.2031 | | 296 | | 291 | 0,11 |
| 0,820 % fällig am 22.07.2032 | | 800 | | 777 | 0,28 |
| **Bridgepoint CLO DAC** | | | | | |
| 1,210 % fällig am 15.01.2034 | | 300 | | 295 | 0,11 |
| **Bumper UK Finance PLC** | | | | | |
| 1,440 % fällig am 20.12.2030 | £ | 440 | | 510 | 0,19 |
| **Carlyle Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,630 % fällig am 15.08.2030 | € | 499 | | 489 | 0,18 |
| 0,700 % fällig am 15.01.2031 | | 400 | | 391 | 0,14 |
| 0,890 % fällig am 15.08.2032 | | 800 | | 776 | 0,28 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,730 % fällig am 25.01.2032 | | 800 | | 782 | 0,29 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.11.2031 | | 1.100 | | 1.081 | 0,39 |
| **Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC** | | | | | |
| 0,284 % fällig am 15.12.2029 | | 518 | | 519 | 0,19 |
| **Compartment VCL** | | | | | |
| 0,213 % fällig am 21.01.2028 | | 623 | | 626 | 0,23 |
| **Contego CLO DAC** | | | | | |
| 0,640 % fällig am 23.01.2030 | | 500 | | 491 | 0,18 |
| **CVC Cordatus Loan Fund DAC** | | | | | |
| 0,630 % fällig am 15.09.2031 | | 300 | | 293 | 0,11 |
| 0,650 % fällig am 15.10.2031 | | 1.800 | | 1.757 | 0,64 |
| **Dryden Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.04.2033 | | 400 | | 388 | 0,14 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | | |
| 0,640 % fällig am 15.10.2031 | | 600 | | 586 | 0,21 |
| 0,650 % fällig am 26.06.2030 | | 693 | | 681 | 0,25 |
| 0,680 % fällig am 20.10.2031 | | 1.800 | | 1.757 | 0,64 |
| 0,760 % fällig am 15.07.2031 | | 700 | | 674 | 0,25 |
| 0,850 % fällig am 15.01.2032 | | 1.200 | | 1.168 | 0,43 |
| 1,040 % fällig am 15.07.2031 | | 400 | | 379 | 0,14 |
| **Man GLG Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,680 % fällig am 15.10.2030 | | 398 | | 390 | 0,14 |
| 0,810 % fällig am 15.10.2032 | | 600 | | 588 | 0,21 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** | | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.10.2031 | | 1.100 | | 1.078 | 0,39 |
| 0,730 % fällig am 15.07.2031 | | 973 | | 954 | 0,35 |
| 1,050 % fällig am 15.10.2031 | | 1.300 | | 1.280 | 0,47 |
| **PBD Germany Auto Lease Master S.A., Compartment** | | | | | |
| 0,188 % fällig am 26.11.2030 | | 500 | | 500 | 0,18 |
| **Purple Master Credit Cards** | | | | | |
| 0,172 % fällig am 25.05.2034 | | 600 | | 600 | 0,22 |
| **Sculptor European CLO DAC** | | | | | |
| 0,790 % fällig am 14.01.2032 | | 700 | | 676 | 0,25 |
| **Segovia European CLO DAC** | | | | | |
| 0,770 % fällig am 18.01.2031 | | 200 | | 196 | 0,07 |
| 0,880 % fällig am 20.07.2032 | | 800 | | 778 | 0,28 |
| **Silver Arrow Merfina SRL** | | | | | |
| 0,206 % fällig am 20.07.2033 | | 965 | | 966 | 0,35 |
| **Silver Arrow S.A.** | | | | | |
| 0,164 % fällig am 15.02.2027 | € | 107 | € | 107 | 0,04 |
| 0,206 % fällig am 20.11.2030 | | 59 | | 59 | 0,02 |
| **Tikehau CLO BV** | | | | | |
| 0,870 % fällig am 04.08.2034 | | 600 | | 585 | 0,21 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | | |
| 0,810 % fällig am 15.02.2034 | | 1.000 | | 966 | 0,35 |
| 0,920 % fällig am 12.01.2032 | | 1.200 | | 1.166 | 0,43 |
| **Turbo Finance 9 PLC** | | | | | |
| 1,770 % fällig am 20.08.2028 | £ | 306 | | 356 | 0,13 |
| **Voya Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.10.2030 | € | 300 | | 295 | 0,11 |
| | | | | 35.075 | 12,82 |

## STAATSEMISSIONEN

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Agence Francaise de Developpement** | | | | |
| 0,125 % fällig am 29.09.2031 | | 400 | 333 | 0,12 |
| **Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.09.2031 | | 2.300 | 1.927 | 0,71 |
| **France Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 25.07.2031 (b) | | 109 | 114 | 0,04 |
| **Israel Government International Bond** | | | | |
| 0,750 % fällig am 31.07.2022 | ILS | 900 | 246 | 0,09 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 1,300 % fällig am 15.05.2028 (b) | € | 801 | 834 | 0,31 |
| 1,400 % fällig am 26.05.2025 (b) | | 10.702 | 11.155 | 4,08 |
| **Ontario Teachers' Finance Trust** | | | | |
| 0,950 % fällig am 24.11.2051 | | 400 | 260 | 0,10 |
| **Slovenia Government International Bond** | | | | |
| 1,175 % fällig am 13.02.2062 | | 1.300 | 798 | 0,29 |
| 1,750 % fällig am 03.11.2040 | | 1.100 | 941 | 0,34 |
| 3,125 % fällig am 07.08.2045 | | 800 | 853 | 0,31 |
| **South Korea Government International Bond** | | | | |
| 0,000 % fällig am 16.09.2025 (a) | | 500 | 475 | 0,17 |
| **State of Lower Saxony** | | | | |
| 0,125 % fällig am 09.01.2032 | | 700 | 583 | 0,21 |
| | | | 18.519 | 6,77 |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| **Nationwide Building Society** | | | |
| 10,250 % | 4.500 | 766 | 0,28 |

| | | PARI (000S) | | |
|---|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | | |
| **Acciona Energia Financiacion Filiales S.A.** | | | | |
| 0,010 % fällig am 27.07.2022 | € | 800 | 800 | 0,29 |
| **Fiserv, Inc.** | | | | |
| (0,152) % fällig am 18.08.2022 | | 700 | 700 | 0,26 |
| **SGS Nederland Holding BV** | | | | |
| (0,101) % fällig am 25.07.2022 | | 1.400 | 1.400 | 0,51 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 2.900 | 1,06 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | € 229.504 | 83,86 |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (d)** | 282.000 | 26.908 | 9,83 |
| **Summe Investmentfonds** | | € 26.908 | 9,83 |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | (1,300) % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | € 21.600 | KAF Kaerntner Ausgleichszahlungs-Fonds 0,000 % fällig am 14.01.2032<br>Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.12.2027 | € (21.315)<br>(984) | € 21.600 | € 21.599 | 7,89 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **€ (22.299)** | **€ 21.600** | **€ 21.599** | **7,89** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month SOFR December Futures | Long | 03.2023 | 147 | € 26 | 0,01 |
| 3-Month SOFR March Futures | Short | 06.2023 | 147 | (37) | (0,01) |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 144.500 EUR auf Euro-Bund August 2022 Futures[1] | Short | 07.2022 | 22 | (54) | (0,02) |
| Euro-Bobl September Futures | Long | 09.2022 | 206 | 95 | 0,03 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09.2022 | 130 | (316) | (0,12) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 176 | 158 | 0,06 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 142 | 854 | 0,31 |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 1 | 4 | 0,00 |
| Euro-Schatz September Futures | Long | 09.2022 | 538 | (104) | (0,04) |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 18 | (30) | (0,01) |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 144.500 EUR auf August 2022 Futures[1] | Short | 07.2022 | 22 | 31 | 0,01 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 2 | 2 | 0,00 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 224 | 135 | 0,05 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 154 | (141) | (0,05) |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2022 | 93 | 114 | 0,04 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 12 | 14 | 0,01 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2022 | 34 | 146 | 0,05 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09.2022 | 43 | 205 | 0,08 |
| | | | | € 1.102 | 0,40 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **€ 1.102** | **0,40** |

[1] Future-Style-Option.

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Barclays Bank PLC | 1,000 % | 20.12.2022 | € 400 | € (1) | 0,00 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 1,600 % | 18.05.2032 | £ 3.200 | € (215) | (0,08) |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 16.06.2029 | ¥ 1.048.000 | (29) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,435 | 20.06.2029 | 312.000 | (14) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,880 | 25.01.2052 | $ 1.800 | (341) | (0,12) |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 17.03.2036 | € 2.400 | 549 | 0,20 |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,193 | 23.06.2035 | 2.900 | (479) | (0,17) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2027 | 45.800 | 2.411 | 0,88 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | 42.300 | 4.102 | 1,50 |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,490 | 24.01.2033 | 4.600 | (851) | (0,31) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2024 | 120.500 | 2.624 | 0,96 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2052 | 900 | 215 | 0,08 |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,590 | 24.01.2034 | 4.600 | (832) | (0,30) |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,640 | 24.01.2052 | 3.000 | 1.175 | 0,43 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 12.04.2027 | 2.000 | (89) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 11.05.2027 | 1.700 | (75) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,700 | 11.04.2027 | 1.200 | (51) | (0,02) |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,819 | 19.12.2034 | 6.800 | (560) | (0,20) |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,854 | 19.12.2039 | 3.300 | (453) | (0,17) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 13.05.2027 | 1.500 | (47) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.05.2027 | 300 | (9) | 0,00 |
| Zahlung | CPTFEMU | 1,380 | 15.03.2031 | 700 | (102) | (0,04) |
| Erhalt | CPURNSA | 3,293 | 08.10.2022 | $ 7.600 | 384 | 0,14 |
| Zahlung | CPURNSA | 4,950 | 07.03.2023 | 1.600 | (27) | (0,01) |
| Zahlung | CPURNSA | 5,033 | 08.03.2023 | 4.800 | (75) | (0,03) |
| Zahlung | UKRPI | 3,330 | 15.01.2025 | £ 8.000 | (1.122) | (0,41) |
| Zahlung | UKRPI | 3,473 | 15.08.2025 | 1.600 | (223) | (0,08) |
| Zahlung | UKRPI | 3,480 | 15.01.2030 | 2.000 | (298) | (0,11) |
| Zahlung | UKRPI | 3,580 | 15.03.2036 | 300 | (40) | (0,01) |
| Erhalt | UKRPI | 4,535 | 15.10.2022 | 1.800 | 169 | 0,06 |
| Erhalt | UKRPI | 4,560 | 15.09.2023 | 5.500 | 585 | 0,21 |
| Erhalt | UKRPI | 4,900 | 15.05.2023 | 1.900 | 225 | 0,08 |
| Erhalt | UKRPI | 5,360 | 15.11.2023 | 3.300 | 270 | 0,10 |
| Erhalt | UKRPI | 6,600 | 15.05.2024 | 200 | 1 | 0,00 |
| | | | | | € 6.778 | 2,48 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **€ 6.777** | **2,48** |

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

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

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

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

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

### OPTIONSKAUF

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,195 % | 02.11.2022 | 1.150 | € 1 | € 469 | 0,17 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,000 | 15.03.2023 | 1.100 | 103 | 497 | 0,18 |
| BRC | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,410 | 02.02.2023 | 20.100 | 89 | 16 | 0,01 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,197 | 04.11.2022 | 760 | 48 | 310 | 0,11 |
| CBK | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,720 | 23.02.2023 | 4.300 | 21 | 7 | 0,00 |
| GLM | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,200 | 26.04.2023 | 3.100 | 31 | 30 | 0,01 |
| JPM | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,710 | 25.01.2023 | 4.600 | 25 | 6 | 0,00 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,000 | 15.03.2023 | 900 | 82 | 406 | 0,15 |
| MYC | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,428 | 31.01.2023 | 20.100 | 91 | 16 | 0,01 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,190 | 02.11.2022 | 1.100 | 69 | 450 | 0,17 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,200 | 31.05.2023 | 8.800 | 100 | 95 | 0,03 |
| | | | | | | | € 660 | € 2.302 | 0,84 |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,490 % | 20.01.2023 | 8.400 | € (313) | € (8) | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,590 | 22.01.2024 | 4.200 | (158) | (18) | (0,01) |
| BPS | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,175 | 15.03.2023 | 3.300 | (101) | (758) | (0,28) |
| BRC | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,558 | 02.02.2023 | 4.400 | (89) | (10) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,000 | 04.11.2022 | 2.260 | (47) | (472) | (0,17) |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,065 | 19.06.2025 | 6.600 | (249) | (25) | (0,01) |
| CBK | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,736 | 23.02.2023 | 900 | (20) | (4) | 0,00 |
| DUB | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,350 | 08.08.2022 | 800 | (3) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,550 | 08.08.2022 | 800 | (3) | (15) | (0,01) |
| GLM | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,350 | 26.04.2023 | 1.700 | (32) | (28) | (0,01) |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,590 | 22.01.2024 | 4.200 | (206) | (19) | (0,01) |
| JPM | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,785 | 25.01.2023 | 1.000 | (24) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,175 | 15.03.2023 | 2.700 | (80) | (620) | (0,23) |
| MYC | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,579 | 31.01.2023 | 4.400 | (92) | (11) | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,350 | 31.05.2023 | 4.800 | (99) | (85) | (0,03) |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,000 | 02.11.2022 | 3.300 | (69) | (689) | (0,25) |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,008 | 17.12.2029 | 5.500 | (341) | (89) | (0,03) |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,008 | 17.12.2029 | 10.900 | (352) | (86) | (0,03) |
| | | | | | | | € (2.278) | € (2.941) | (1,07) |

#### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPM | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 3,500 % fällig am 01.08.2052 | $ 96,906 | 04.08.2022 | 200 | € (1) | € (2) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,156 | 07.09.2022 | 600 | (2) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,656 | 07.09.2022 | 1.200 | (4) | (10) | (0,01) |
| | | | | | € (7) | € (16) | (0,01) |

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

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | DKK | 3.470 | € | 466 | € 0 | € 0 | € 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 3.998 | DKK | 29.735 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 502 | ¥ | 69.300 | 0 | (14) | (14) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 1.472 | NOK | 14.960 | 0 | (27) | (27) | (0,01) |
| | 08.2022 | ¥ | 21.500 | € | 158 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | DKK | 17.040 | | 2.290 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 23.993 | DKK | 178.475 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 25.295 | $ | 26.611 | 159 | 0 | 159 | 0,06 |
| | 07.2022 | $ | 923 | € | 866 | 0 | (17) | (17) | (0,01) |
| | 08.2022 | CAD | 10 | | 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 3.128 | £ | 2.666 | 0 | (37) | (37) | (0,01) |
| | 08.2022 | $ | 25.100 | € | 23.820 | 0 | (144) | (144) | (0,05) |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | 07.2022 | € | 8.580 | DKK | 63.841 | € 5 | € 0 | € 5 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 488 | € | 468 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | CHF | 1.496 | | 1.472 | 0 | (23) | (23) | (0,01) |
| | 08.2022 | DKK | 63.839 | | 8.580 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 1.489 | AUD | 2.229 | 0 | (27) | (27) | (0,01) |
| | 08.2022 | ¥ | 90.300 | € | 636 | 2 | (2) | 0 | 0,00 |
| CBK | 08.2022 | ILS | 913 | $ | 276 | 14 | 0 | 14 | 0,01 |
| DUB | 07.2022 | DKK | 713.376 | € | 95.876 | 0 | (52) | (52) | (0,02) |
| GLM | 10.2022 | $ | 61 | MXN | 1.248 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| IND | 08.2022 | € | 4.604 | £ | 3.919 | 0 | (62) | (62) | (0,02) |
| JPM | 07.2022 | DKK | 8.095 | € | 1.088 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 45.651 | DKK | 339.664 | 24 | 0 | 24 | 0,01 |
| | 08.2022 | CNH | 2.552 | $ | 380 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 300.871 | € | 40.437 | 0 | (22) | (22) | (0,01) |
| | 08.2022 | £ | 32.291 | | 37.530 | 101 | 0 | 101 | 0,04 |
| MBC | 07.2022 | € | 3.944 | DKK | 29.335 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 5.803 | $ | 864 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 05.2023 | | 2.981 | | 444 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | DKK | 16.555 | € | 2.225 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 387 | $ | 416 | 11 | 0 | 11 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 85 | CNY | 572 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RBC | 07.2022 | | 50 | € | 47 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 376 | £ | 325 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 160 | | 131 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| RYL | 08.2022 | € | 1.460 | CHF | 1.524 | 63 | 0 | 63 | 0,02 |
| SCX | 07.2022 | | 5.056 | DKK | 37.615 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | ILS | 123 | $ | 36 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 10.294 | | 1.537 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 1.018 | £ | 871 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 08.2022 | £ | 169 | € | 197 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 137 | CNY | 915 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | | 26.119 | € | 24.301 | 0 | (682) | (682) | (0,25) |
| | 08.2022 | € | 748 | £ | 646 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | | 10.725 | DKK | 79.792 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 79.789 | € | 10.725 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | | | | | | € 409 | € (1.135) | € (726) | (0,26) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **€ (1.381)** | **(0,50)** |
| **Summe Anlagen** | | | | | | | | **€ 284.510** | **103,96** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | | | | | | | **€ (10.832)** | **(3,96)** |
| **Nettovermögen** | | | | | | | | **€ 273.678** | **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) Kapital inflationsbereinigt.**

**(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 5.810 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von EUR 957 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | € 229.504 | € 0 | € 229.504 |
| Investmentfonds | 26.908 | 0 | 0 | 26.908 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 21.600 | 0 | 21.600 |
| Finanzderivate[3] | 843 | 5.655 | 0 | 6.498 |
| **Summen** | **€ 27.751** | **€ 256.759** | **€ 0** | **€ 284.510** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 0 | € 351.206 | € 0 | € 351.206 |
| Investmentfonds | 0 | 26.155 | 0 | 26.155 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 11.681 | 0 | 11.681 |
| Finanzderivate[3] | 1.838 | (4.909) | 0 | (3.071) |
| **Summen** | **€ 1.838** | **€ 384.133** | **€ 0** | **€ 385.971** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | € (59) | € (290) | € (349) |
| BPS | 175 | 0 | 175 |
| BRC | (230) | 0 | (230) |
| CBK | 17 | 0 | 17 |
| DUB | (67) | 0 | (67) |
| GLM | (17) | (172) | (189) |
| IND | (62) | 0 | (62) |
| JPM | (127) | 249 | 122 |
| MBC | (1) | 0 | (1) |
| MYC | (399) | 0 | (399) |
| MYI | 10 | (10) | 0 |
| RBC | (1) | 0 | (1) |
| RYL | 63 | 0 | 63 |
| SCX | (1) | 0 | (1) |
| SOG | (682) | 708 | 26 |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 77,65 | 86,65 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 4,98 | 2,15 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 1,23 | k. A. |
| Investmentfonds | 9,83 | 6,61 |
| Pensionsgeschäfte | 7,89 | 2,95 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,40 | 0,47 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 2,48 | (0,24) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (0,50) | (1,00) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | k. A. | (0,15) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 47,44 | 57,25 |
| US-Regierungsbehörden | 3,90 | 0,05 |
| US-Schatzobligationen | 1,16 | 3,37 |
| Non-Agency-MBS | 10,43 | 6,77 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 12,82 | 9,48 |
| Staatsemissionen | 6,77 | 9,12 |
| Vorzugswertpapiere | 0,28 | 0,26 |
| Kurzfristige Instrumente | 1,06 | 2,50 |
| Investmentfonds | 9,83 | 6,61 |
| Pensionsgeschäfte | 7,89 | 2,95 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,40 | 0,47 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,00 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | k. A. | 0,01 |
| Zinsswaps | 2,48 | (0,25) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoptionen | 0,84 | 0,23 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | k. A. | 0,00 |
| Devisenoptionen | k. A. | 0,00 |
| Zinsswapoptionen | (1,07) | (1,09) |
| Optionen auf Wertpapiere | (0,01) | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | (0,26) | (0,14) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (3,96) | 2,41 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **ARGENTINIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 09.07.2030 | $ | 254 | $ 54 | 0,01 |
| 1,000 % fällig am 09.07.2029 | | 3 | 1 | 0,00 |
| 1,125 % fällig am 09.07.2035 | | 91 | 19 | 0,01 |
| Summe Argentinien | | | 74 | 0,02 |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Pepper Residential Securities Trust** | | | | |
| 2,193 % fällig am 16.09.2059 | AUD | 456 | 313 | 0,07 |
| **RESIMAC Bastille Trust** | | | | |
| 1,733 % fällig am 05.09.2057 | $ | 160 | 161 | 0,04 |
| | | | 474 | 0,11 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Australia Government International Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 21.09.2026 | AUD | 4.100 | 2.510 | 0,57 |
| 0,750 % fällig am 21.11.2027 | | 2.336 | 1.598 | 0,37 |
| 1,000 % fällig am 21.12.2030 | | 700 | 390 | 0,09 |
| 1,250 % fällig am 21.05.2032 | | 500 | 276 | 0,06 |
| 1,750 % fällig am 21.06.2051 | | 1.000 | 438 | 0,10 |
| 2,500 % fällig am 21.05.2030 | | 500 | 318 | 0,07 |
| 4,500 % fällig am 21.04.2033 | | 1.700 | 1.254 | 0,29 |
| **New South Wales Treasury Corp.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 20.11.2025 | | 7.324 | 5.484 | 1,26 |
| **Treasury Corp. of Victoria** | | | | |
| 4,250 % fällig am 20.12.2032 | | 700 | 479 | 0,11 |
| | | | 12.747 | 2,92 |
| Summe Australien | | | 13.221 | 3,03 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Bradesco S.A.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 27.01.2023 | $ | 500 | 498 | 0,11 |
| **Banco Votorantim S.A.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 24.09.2022 | | 300 | 300 | 0,07 |
| 4,500 % fällig am 24.09.2024 | | 2.100 | 2.079 | 0,48 |
| **Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.08.2022 (c)(f) | | 254 | 1 | 0,00 |
| **Swiss Insured Brazil Power Finance SARL** | | | | |
| 9,850 % fällig am 16.07.2032 | BRL | 15.712 | 2.614 | 0,60 |
| Summe Brasilien | | | 5.492 | 1,26 |
| **KANADA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Air Canada Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,300 % fällig am 15.07.2031 | $ | 410 | 374 | 0,09 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028 | € | 500 | 484 | 0,11 |
| | | | 858 | 0,20 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Real Estate Asset Liquidity Trust** | | | | |
| 3,072 % fällig am 12.08.2053 | CAD | 384 | 295 | 0,07 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Canadian Government Real Return Bond** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.12.2044 (e) | | 2.462 | 1.939 | 0,44 |
| Summe Kanada | | | 3.092 | 0,71 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Atlas Senior Loan Fund Ltd.** | | | | |
| 2,134 % fällig am 15.01.2031 | $ | 1.080 | 1.064 | 0,24 |
| 2,194 % fällig am 16.01.2030 | | 1.297 | 1.284 | 0,29 |
| **Babson CLO Ltd.** | | | | |
| 2,053 % fällig am 20.01.2031 | | 1.200 | 1.181 | 0,27 |
| **Bain Capital Credit CLO** | | | | |
| 2,144 % fällig am 23.04.2031 | | 1.200 | 1.178 | 0,27 |
| **Barings CLO Ltd.** | | | | |
| 1,863 % fällig am 20.01.2028 | $ | 1.281 | $ 1.267 | 0,29 |
| **CBAM CLO Ltd.** | | | | |
| 2,064 % fällig am 17.04.2031 | | 1.300 | 1.277 | 0,29 |
| **CIFC Funding Ltd.** | | | | |
| 2,044 % fällig am 18.04.2031 | | 1.500 | 1.474 | 0,34 |
| **Dryden CLO Ltd.** | | | | |
| 2,064 % fällig am 15.04.2031 | | 1.400 | 1.377 | 0,32 |
| **Dryden Senior Loan Fund** | | | | |
| 2,611 % fällig am 15.08.2030 | | 1.300 | 1.286 | 0,30 |
| **Gallatin CLO Ltd.** | | | | |
| 2,148 % fällig am 21.01.2028 | | 561 | 556 | 0,13 |
| **LCM LP** | | | | |
| 2,103 % fällig am 20.07.2031 | | 1.300 | 1.271 | 0,29 |
| **Madison Park Funding Ltd.** | | | | |
| 1,794 % fällig am 15.04.2029 | | 1.264 | 1.247 | 0,29 |
| **OCP CLO Ltd.** | | | | |
| 2,183 % fällig am 20.07.2029 | | 1.187 | 1.174 | 0,27 |
| **Octagon Investment Partners Ltd.** | | | | |
| 2,004 % fällig am 16.04.2031 | | 1.100 | 1.081 | 0,25 |
| **Octagon Loan Funding Ltd.** | | | | |
| 2,635 % fällig am 18.11.2031 | | 1.300 | 1.276 | 0,29 |
| **OZLM Ltd.** | | | | |
| 2,336 % fällig am 30.04.2027 | | 92 | 92 | 0,02 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | |
| 1,924 % fällig am 15.04.2027 | | 292 | 289 | 0,07 |
| 2,113 % fällig am 20.07.2030 | | 1.300 | 1.284 | 0,29 |
| 2,163 % fällig am 20.01.2029 | | 997 | 988 | 0,23 |
| **Wind River CLO Ltd.** | | | | |
| 2,094 % fällig am 18.07.2031 | | 1.295 | 1.269 | 0,29 |
| | | | 21.915 | 5,03 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | | |
| 6,720 % fällig am 01.12.2022 ^ | | 52 | 50 | 0,01 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd. (6,720 % bar und 1,000 % PIK)** | | | | |
| 7,720 % fällig am 01.12.2026 ^(b) | | 2.132 | 533 | 0,12 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 26.01.2026 | | 600 | 546 | 0,13 |
| **S.A. Global Sukuk Ltd.** | | | | |
| 2,694 % fällig am 17.06.2031 | | 400 | 352 | 0,08 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 08.01.2026 | | 200 | 161 | 0,04 |
| 5,125 % fällig am 08.08.2025 | | 400 | 336 | 0,08 |
| | | | 1.978 | 0,46 |
| Summe Cayman Inseln | | | 23.893 | 5,49 |
| **CHILE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Santander Chile** | | | | |
| 2,700 % fällig am 10.01.2025 | | 1.100 | 1.054 | 0,24 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2026 | CLP | 1.120.000 | 1.125 | 0,26 |
| Summe Chile | | | 2.179 | 0,50 |
| **CHINA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **China Government Bond** | | | | |
| 3,530 % fällig am 18.10.2051 | CNY | 3.600 | 558 | 0,13 |
| 3,720 % fällig am 12.04.2051 | | 1.700 | 271 | 0,06 |
| 3,810 % fällig am 14.09.2050 | | 4.500 | 727 | 0,17 |
| Summe China | | | 1.556 | 0,36 |
| **KOLUMBIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Colombian TES** | | | | |
| 5,750 % fällig am 03.11.2027 | COP | 570.000 | 109 | 0,02 |
| **TSCHECHISCHE REPUBLIK** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Czech Republic Government International Bond** | | | | |
| 0,950 % fällig am 15.05.2030 | CZK | 12.100 | $ 380 | 0,09 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 19.084 | 2.069 | 0,48 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 1.188 | 137 | 0,03 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 44.521 | 4.675 | 1,07 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 796 | 88 | 0,02 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 52.934 | 5.632 | 1,29 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 6.793 | 745 | 0,17 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 10.656 | 1.180 | 0,27 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2036 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 3.738 | 413 | 0,10 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 3.379 | 381 | 0,09 |
| 2,500 % fällig am 01.04.2036 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.04.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| Summe Dänemark | | | 15.320 | 3,52 |
| **DOMINIKANISCHE REPUBLIK** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Dominican Republic Government International Bond** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.02.2048 | $ | 800 | 608 | 0,14 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 1,675 % fällig am 30.06.2027 | | 900 | 794 | 0,18 |
| 2,591 % fällig am 20.01.2028 | | 1.000 | 900 | 0,21 |
| 3,800 % fällig am 10.01.2024 | | 300 | 298 | 0,07 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 2,045 % fällig am 19.10.2027 | | 300 | 265 | 0,06 |
| **Mutuelle Assurance Des Commercants et Industriels de France et Des Cadres et Sal** | | | | |
| 2,125 % fällig am 21.06.2052 | € | 300 | 238 | 0,05 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 1,488 % fällig am 14.12.2026 | $ | 3.700 | 3.269 | 0,75 |
| | | | 5.764 | 1,32 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **France Government International Bond** | | | | |
| 0,250 % fällig am 25.07.2024 (e)(j) | € | 1.745 | 1.953 | 0,45 |
| 0,500 % fällig am 25.05.2072 (j) | | 100 | 46 | 0,01 |
| 0,750 % fällig am 25.05.2052 (j) | | 3.550 | 2.359 | 0,54 |
| 1,500 % fällig am 25.05.2050 (j) | | 600 | 506 | 0,12 |
| 3,250 % fällig am 25.05.2045 (j) | | 200 | 239 | 0,05 |
| | | | 5.103 | 1,17 |
| Summe Frankreich | | | 10.867 | 2,49 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,050 % fällig am 20.11.2024 | | 3.800 | 3.830 | 0,88 |
| 1,000 % fällig am 19.11.2025 | | 100 | 99 | 0,02 |
| 1,375 % fällig am 03.09.2026 | | 400 | 389 | 0,09 |
| 1,375 % fällig am 17.02.2032 | | 400 | 320 | 0,07 |
| 1,625 % fällig am 20.01.2027 | | 2.500 | 2.344 | 0,54 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 1,750 % fällig am 19.11.2030 | € | 400 $ | 345 | 0,08 |
| 2,625 % fällig am 12.02.2026 | | 500 | 503 | 0,11 |
| 3,035 % fällig am 28.05.2032 (i) | $ | 1.050 | 832 | 0,19 |
| 3,950 % fällig am 27.02.2023 | | 900 | 898 | 0,21 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK)** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2025 (b) | € | 700 | 640 | 0,15 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK)** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.05.2027 (b) | | 300 | 245 | 0,06 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 1,250 % fällig am 01.08.2022 | | 200 | 209 | 0,05 |
| Summe Deutschland | | | 10.654 | 2,45 |
| **GUATEMALA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Guatemala Government International Bond** | | | | |
| 5,375 % fällig am 24.04.2032 | $ | 400 | 369 | 0,08 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Huarong Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 30.09.2023 | | 400 | 381 | 0,09 |
| **Poly Real Estate Finance Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 05.02.2023 | | 500 | 499 | 0,12 |
| **Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.** | | | | |
| 3,074 % fällig am 25.05.2023 | | 500 | 497 | 0,11 |
| Summe Hongkong | | | 1.377 | 0,32 |
| **INDIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Muthoot Finance Ltd.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 31.10.2022 | | 900 | 899 | 0,21 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara** | | | | |
| 3,000 % fällig am 30.06.2030 | | 3.500 | 2.876 | 0,66 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 8,375 % fällig am 15.03.2034 | IDR | 22.982.000 | 1.646 | 0,38 |
| Summe Indonesien | | | 4.522 | 1,04 |
| **IRLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Accunia European CLO DAC** | | | | |
| 0,950 % fällig am 15.07.2030 | € | 538 | 556 | 0,13 |
| **Ares European CLO DAC** | | | | |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | | 1.100 | 1.125 | 0,26 |
| **Armada Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.07.2031 | | 400 | 407 | 0,09 |
| **Aurium CLO DAC** | | | | |
| 0,730 % fällig am 16.01.2031 | | 1.100 | 1.130 | 0,26 |
| **BNPP AM Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,820 % fällig am 22.07.2032 | | 1.000 | 1.015 | 0,23 |
| **Cairn CLO DAC** | | | | |
| 0,600 % fällig am 30.04.2031 | | 400 | 412 | 0,10 |
| **Carlyle Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,700 % fällig am 15.01.2031 | | 1.000 | 1.021 | 0,23 |
| **Dryden Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.04.2033 | | 700 | 710 | 0,16 |
| 0,860 % fällig am 15.05.2034 | | 1.000 | 1.011 | 0,23 |
| **GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC** | | | | |
| 0,900 % fällig am 20.01.2032 | | 1.000 | 1.016 | 0,23 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | | 384 | 400 | 0,09 |
| 0,650 % fällig am 26.06.2030 | | 1.089 | 1.119 | 0,26 |
| 0,680 % fällig am 20.10.2031 | | 800 | 816 | 0,19 |
| 0,760 % fällig am 15.07.2031 | | 1.100 | 1.107 | 0,25 |
| 0,850 % fällig am 15.01.2032 | | 1.100 | 1.119 | 0,26 |
| **Jubilee CLO DAC** | | | | |
| 0,600 % fällig am 15.04.2030 | € | 600 $ | 619 | 0,14 |
| 0,650 % fällig am 15.04.2031 | | 400 | 411 | 0,09 |
| **Madison Park Euro Funding DAC** | | | | |
| 0,800 % fällig am 15.07.2032 | | 1.100 | 1.115 | 0,26 |
| **Man GLG Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,690 % fällig am 15.12.2031 | | 600 | 614 | 0,14 |
| 0,810 % fällig am 15.10.2032 | | 1.100 | 1.128 | 0,26 |
| **Oak Hill European Credit Partners DAC** | | | | |
| 0,740 % fällig am 20.10.2031 | | 1.100 | 1.120 | 0,26 |
| **OCP Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,880 % fällig am 22.09.2034 | | 800 | 810 | 0,19 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** | | | | |
| 0,730 % fällig am 15.07.2031 | | 1.070 | 1.097 | 0,25 |
| **Sculptor European CLO DAC** | | | | |
| 0,790 % fällig am 14.01.2032 | | 1.100 | 1.110 | 0,26 |
| | | | 20.988 | 4,82 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 2,450 % fällig am 29.10.2026 | $ | 400 | 349 | 0,08 |
| 3,000 % fällig am 29.10.2028 | | 500 | 422 | 0,09 |
| **AIB Group PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 12.10.2023 | | 300 | 300 | 0,07 |
| | | | 1.071 | 0,24 |
| Summe Irland | | | 22.059 | 5,06 |
| **ISRAEL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Israel Electric Corp. Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 22.02.2032 | | 1.200 | 1.076 | 0,25 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Israel Government International Bond** | | | | |
| 0,750 % fällig am 31.07.2022 | ILS | 1.000 | 285 | 0,06 |
| 1,750 % fällig am 31.08.2025 | | 2.100 | 596 | 0,14 |
| 2,000 % fällig am 31.03.2027 | | 2.700 | 758 | 0,17 |
| 3,800 % fällig am 13.05.2060 | $ | 1.400 | 1.170 | 0,27 |
| | | | 2.809 | 0,64 |
| Summe Israel | | | 3.885 | 0,89 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aeroporti di Roma SpA** | | | | |
| 1,750 % fällig am 30.07.2031 | € | 500 | 401 | 0,09 |
| **AMCO - Asset Management Co. SpA** | | | | |
| 1,500 % fällig am 17.07.2023 | | 1.000 | 1.050 | 0,24 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 0,875 % fällig am 08.10.2027 | | 1.300 | 1.285 | 0,29 |
| 4,000 % fällig am 10.07.2022 (j) | | 400 | 417 | 0,10 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.09.2031 (f)(h) | | 250 | 204 | 0,05 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | $ | 1.100 | 1.140 | 0,26 |
| | | | 4.497 | 1,03 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 2,350 % fällig am 15.09.2024 (e)(j) | € | 21.985 | 25.192 | 5,79 |
| **Italy Government International Bond** | | | | |
| 6,000 % fällig am 04.08.2028 | £ | 1.000 | 1.356 | 0,31 |
| | | | 26.548 | 6,10 |
| Summe Italien | | | 31.045 | 7,13 |
| **ELFENBEINKÜSTE** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ivory Coast Government International Bond** | | | | |
| 5,250 % fällig am 22.03.2030 | € | 1.600 | 1.315 | 0,30 |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Nissan Motor Co. Ltd.** | | | | |
| 4,345 % fällig am 17.09.2027 | $ | 500 | 459 | 0,11 |
| 4,810 % fällig am 17.09.2030 | | 400 | 356 | 0,08 |
| **Nomura Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,329 % fällig am 22.01.2027 | $ | 400 $ | 354 | 0,08 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,409 % fällig am 07.11.2029 | € | 1.300 | 1.186 | 0,27 |
| **Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.** | | | | |
| 0,010 % fällig am 15.10.2027 | | 1.000 | 937 | 0,22 |
| | | | 3.292 | 0,76 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Japan Finance Organization for Municipalities** | | | | |
| 3,000 % fällig am 12.03.2024 | $ | 200 | 199 | 0,05 |
| 3,375 % fällig am 27.09.2023 | | 1.400 | 1.402 | 0,32 |
| **Japan Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 10.03.2028 (e) | ¥ | 739.814 | 5.724 | 1,31 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2029 (e) | | 510.215 | 3.955 | 0,91 |
| 0,500 % fällig am 20.03.2049 | | 268.000 | 1.678 | 0,38 |
| 0,700 % fällig am 20.06.2051 | | 254.000 | 1.642 | 0,38 |
| **Tokyo Metropolitan Government** | | | | |
| 2,625 % fällig am 29.05.2024 | $ | 400 | 394 | 0,09 |
| | | | 14.994 | 3,44 |
| Summe Japan | | | 18.286 | 4,20 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 0,375 % fällig am 15.04.2027 | € | 700 | 572 | 0,13 |
| **CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund** | | | | |
| 0,900 % fällig am 12.10.2029 | | 400 | 331 | 0,08 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 23.04.2027 | | 700 | 586 | 0,13 |
| 1,750 % fällig am 14.01.2030 | | 300 | 222 | 0,05 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 0,625 % fällig am 17.11.2025 | | 200 | 187 | 0,04 |
| 0,750 % fällig am 15.07.2024 | | 600 | 595 | 0,14 |
| **SELP Finance SARL** | | | | |
| 1,250 % fällig am 25.10.2023 | | 1.400 | 1.436 | 0,33 |
| | | | 3.929 | 0,90 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Miravet SARL** | | | | |
| 0,494 % fällig am 26.05.2065 | | 566 | 593 | 0,14 |
| Summe Luxemburg | | | 4.522 | 1,04 |
| **MALAYSIA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Petronas Capital Ltd.** | | | | |
| 2,480 % fällig am 28.01.2032 | $ | 500 | 426 | 0,10 |
| 3,500 % fällig am 21.04.2030 | | 200 | 188 | 0,04 |
| 4,550 % fällig am 21.04.2050 | | 200 | 192 | 0,04 |
| 4,800 % fällig am 21.04.2060 | | 200 | 196 | 0,05 |
| Summe Malaysia | | | 1.002 | 0,23 |
| **MEXIKO** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 6,750 % fällig am 21.09.2047 | | 1.809 | 1.123 | 0,26 |
| **MAROKKO** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Morocco Government International Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 30.09.2030 | € | 1.800 | 1.371 | 0,31 |
| **MULTINATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Preferred Term Securities Ltd.** | | | | |
| 2,430 % fällig am 23.06.2035 | $ | 1.379 | 1.305 | 0,30 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Airbus SE** | | | | |
| 2,375 % fällig am 09.06.2040 | € | 1.000 | 868 | 0,20 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 3,649 % fällig am 06.04.2028 | $ | 900 | $ 856 | 0,20 |
| 3,758 % fällig am 06.04.2033 | | 400 | 361 | 0,08 |
| **CTP NV** | | | | |
| 0,500 % fällig am 21.06.2025 | € | 1.100 | 981 | 0,23 |
| **Enel Finance International NV** | | | | |
| 2,650 % fällig am 10.09.2024 | $ | 1.200 | 1.164 | 0,27 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 1,750 % fällig am 16.02.2031 | € | 1.500 | 1.361 | 0,31 |
| 2,125 % fällig am 23.05.2026 | | 500 | 509 | 0,12 |
| 3,875 % fällig am 16.05.2027 (f)(h) | $ | 200 | 146 | 0,03 |
| 5,750 % fällig am 16.11.2026 (f)(h) | | 200 | 183 | 0,04 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 0,125 % fällig am 13.09.2023 | € | 700 | 715 | 0,16 |
| **Prosus NV** | | | | |
| 1,207 % fällig am 19.01.2026 | | 1.500 | 1.368 | 0,31 |
| 3,257 % fällig am 19.01.2027 | $ | 1.600 | 1.392 | 0,32 |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | |
| 6,500 % (f) | € | 210 | 214 | 0,05 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 5,182 % fällig am 24.04.2028 | $ | 400 | 405 | 0,09 |
| **Volkswagen International Finance NV** | | | | |
| 1,144 % fällig am 16.11.2024 | € | 800 | 855 | 0,20 |
| | | | 11.378 | 2,61 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Jubilee Place BV** | | | | |
| 0,552 % fällig am 17.10.2057 | | 649 | 670 | 0,16 |
| Summe Niederlande | | | 12.048 | 2,77 |
| **NEUSEELAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **New Zealand Government International Bond** | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.05.2031 | NZD | 600 | 308 | 0,07 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Kommunalbanken A/S** | | | | |
| 1,900 % fällig am 19.01.2027 | AUD | 400 | 249 | 0,06 |
| **Norway Government International Bond** | | | | |
| 1,750 % fällig am 13.03.2025 | NOK | 6.000 | 589 | 0,13 |
| Summe Norwegen | | | 838 | 0,19 |
| **PERU** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco de Credito del Peru S.A.** | | | | |
| 4,650 % fällig am 17.09.2024 | PEN | 1.700 | 414 | 0,10 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,400 % fällig am 12.08.2034 | | 1.600 | 340 | 0,08 |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | | 9.400 | 2.261 | 0,52 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 1.200 | 280 | 0,06 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 | | 12.100 | 3.003 | 0,69 |
| 8,200 % fällig am 12.08.2026 | | 2.100 | 578 | 0,13 |
| | | | 6.462 | 1,48 |
| Summe Peru | | | 6.876 | 1,58 |
| **PHILIPPINEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Philippines Government International Bond** | | | | |
| 6,250 % fällig am 14.01.2036 | PHP | 21.000 | 370 | 0,08 |
| **PORTUGAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Espirito Santo S.A.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 21.01.2019 ^ | € | 1.900 | 347 | 0,08 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2018 ^ | | 600 | 110 | 0,03 |
| Summe Portugal | | | 457 | 0,11 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **KATAR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Qatar Energy** | | | | |
| 2,250 % fällig am 12.07.2031 | $ | 200 | $ 171 | 0,04 |
| 3,125 % fällig am 12.07.2041 | | 500 | 393 | 0,09 |
| 3,300 % fällig am 12.07.2051 | | 400 | 310 | 0,07 |
| | | | 874 | 0,20 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 4,400 % fällig am 16.04.2050 | | 200 | 191 | 0,04 |
| 4,817 % fällig am 14.03.2049 | | 500 | 505 | 0,12 |
| 5,103 % fällig am 23.04.2048 | | 200 | 210 | 0,05 |
| | | | 906 | 0,21 |
| Summe Katar | | | 1.780 | 0,41 |
| **RUMÄNIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Romania Government International Bond** | | | | |
| 1,375 % fällig am 02.12.2029 | € | 360 | 273 | 0,06 |
| 1,750 % fällig am 13.07.2030 | | 1.300 | 971 | 0,22 |
| 2,000 % fällig am 28.01.2032 | | 100 | 72 | 0,02 |
| 2,000 % fällig am 14.04.2033 | | 800 | 544 | 0,13 |
| 2,124 % fällig am 16.07.2031 | | 300 | 223 | 0,05 |
| 2,625 % fällig am 02.12.2040 | | 100 | 61 | 0,01 |
| 2,750 % fällig am 14.04.2041 | | 200 | 122 | 0,03 |
| 2,875 % fällig am 13.04.2042 | | 500 | 307 | 0,07 |
| Summe Rumänien | | | 2.573 | 0,59 |
| **RUSSLAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Russia Government International Bond** | | | | |
| 1,125 % fällig am 20.11.2027 | | 2.000 | 575 | 0,13 |
| 4,750 % fällig am 27.05.2026 | $ | 200 | 54 | 0,01 |
| 7,650 % fällig am 10.04.2030 ^ | RUB | 137.400 | 226 | 0,05 |
| 7,700 % fällig am 23.03.2033 ^ | | 33.500 | 55 | 0,02 |
| Summe Russland | | | 910 | 0,21 |
| **SAUDI-ARABIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Saudi Arabia Government International Bond** | | | | |
| 4,375 % fällig am 16.04.2029 | $ | 1.100 | 1.118 | 0,26 |
| 4,625 % fällig am 04.10.2047 | | 400 | 371 | 0,08 |
| Summe Saudi-Arabien | | | 1.489 | 0,34 |
| **SERBIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Serbia Government International Bond** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.05.2027 | € | 3.900 | 3.577 | 0,82 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ascendas Real Estate Investment Trust** | | | | |
| 0,750 % fällig am 23.06.2028 | | 1.000 | 841 | 0,19 |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 18.09.2022 | $ | 200 | 200 | 0,05 |
| | | | 1.041 | 0,24 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Singapore Government International Bond** | | | | |
| 1,625 % fällig am 01.07.2031 | SGD | 5.500 | 3.540 | 0,81 |
| 2,875 % fällig am 01.09.2030 | | 5.000 | 3.576 | 0,82 |
| | | | 7.116 | 1,63 |
| Summe Singapur | | | 8.157 | 1,87 |
| **SLOWENIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Nova Kreditna Banka Maribor d.d.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 27.01.2025 | € | 400 | 395 | 0,09 |
| **Nova Ljubljanska Banka d.d.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 05.02.2030 | | 400 | 368 | 0,09 |
| Summe Slowenien | | | 763 | 0,18 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **SÜDAFRIKA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 4,850 % fällig am 30.09.2029 | $ | 600 | $ 514 | 0,12 |
| 5,375 % fällig am 24.07.2044 | | 500 | 344 | 0,08 |
| 5,750 % fällig am 30.09.2049 | | 200 | 137 | 0,03 |
| 5,875 % fällig am 20.04.2032 | | 700 | 599 | 0,14 |
| Summe Südafrika | | | 1.594 | 0,37 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **South Korea Government International Bond** | | | | |
| 2,125 % fällig am 10.06.2027 | KRW | 680.000 | 489 | 0,11 |
| 2,375 % fällig am 10.12.2028 | | 2.960.000 | 2.118 | 0,49 |
| 5,500 % fällig am 10.03.2028 | | 640.000 | 540 | 0,12 |
| Summe Südkorea | | | 3.147 | 0,72 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **BBVA Consumer Auto** | | | | |
| 0,270 % fällig am 20.07.2031 | € | 332 | 342 | 0,08 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco de Sabadell S.A.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 10.05.2024 | | 100 | 101 | 0,02 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 1,849 % fällig am 25.03.2026 | $ | 200 | 180 | 0,04 |
| 3,496 % fällig am 24.03.2025 | | 800 | 783 | 0,18 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 24.10.2023 | € | 600 | 624 | 0,15 |
| 6,750 % fällig am 13.06.2024 (f)(h) | | 400 | 404 | 0,09 |
| | | | 2.092 | 0,48 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 4,220 % fällig am 26.04.2035 | | 300 | 339 | 0,08 |
| **Spain Government International Bond** | | | | |
| 1,450 % fällig am 31.10.2071 | | 500 | 293 | 0,06 |
| 3,450 % fällig am 30.07.2066 | | 2.000 | 2.178 | 0,50 |
| | | | 2.810 | 0,64 |
| Summe Spanien | | | 5.244 | 1,20 |
| **SUPRANATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Asian Development Bank** | | | | |
| 6,150 % fällig am 25.02.2030 | INR | 252.300 | 3.015 | 0,69 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (h) | $ | 1.400 | 1.404 | 0,32 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 2,945 % fällig am 14.12.2023 | | 1.200 | 1.199 | 0,28 |
| 3,800 % fällig am 09.06.2023 | | 1.600 | 1.586 | 0,37 |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (f)(h) | | 300 | 278 | 0,06 |
| **UBS AG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (h) | | 400 | 400 | 0,09 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 4,125 % fällig am 24.09.2025 | | 1.200 | 1.192 | 0,27 |
| 4,875 % fällig am 12.02.2027 (f)(h) | | 800 | 671 | 0,15 |
| Summe Schweiz | | | 6.730 | 1,54 |
| **THAILAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Thailand Government International Bond** | | | | |
| 1,585 % fällig am 17.12.2035 | THB | 94.700 | 2.171 | 0,50 |
| 3,300 % fällig am 17.06.2038 | | 5.700 | 155 | 0,03 |
| Summe Thailand | | | 2.326 | 0,53 |
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Emirate of Abu Dhabi Government International Bond** | | | | |
| 3,875 % fällig am 16.04.2050 | $ | 200 | 178 | 0,04 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Bumper UK Finance PLC** | | | | |
| 1,540 % fällig am 20.12.2028 | £ | 5 | $ 6 | 0,00 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Antofagasta PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 14.10.2030 | $ | 400 | 310 | 0,07 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (h) | | 3.600 | 3.636 | 0,84 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (f)(h) | £ | 200 | 239 | 0,06 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (f)(h) | $ | 500 | 493 | 0,11 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2022 (f)(h) | £ | 200 | 242 | 0,06 |
| **GSK Consumer Healthcare Capital UK PLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 24.03.2025 | $ | 700 | 683 | 0,16 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 2,100 % fällig am 16.02.2024 | AUD | 1.700 | 1.169 | 0,27 |
| 2,251 % fällig am 22.11.2027 | $ | 400 | 357 | 0,08 |
| 2,455 % fällig am 18.05.2024 | | 800 | 794 | 0,18 |
| 3,350 % fällig am 16.02.2024 | AUD | 700 | 480 | 0,11 |
| 4,041 % fällig am 13.03.2028 | $ | 200 | 190 | 0,04 |
| 4,583 % fällig am 19.06.2029 | | 1.000 | 965 | 0,22 |
| 6,500 % fällig am 23.03.2028 (f)(h) | | 200 | 182 | 0,04 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 3,574 % fällig am 07.11.2028 | | 200 | 187 | 0,04 |
| 3,750 % fällig am 18.03.2028 | | 800 | 762 | 0,18 |
| 3,900 % fällig am 12.03.2024 | | 300 | 298 | 0,07 |
| 4,550 % fällig am 16.08.2028 | | 700 | 685 | 0,16 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 2,972 % fällig am 16.02.2028 | | 1.300 | 1.188 | 0,27 |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 12.09.2023 | | 400 | 399 | 0,09 |
| 4,600 % fällig am 28.06.2031 (f)(h) | | 500 | 369 | 0,08 |
| 5,076 % fällig am 27.01.2030 | | 1.100 | 1.078 | 0,25 |
| 5,125 % fällig am 12.05.2027 (f)(h) | £ | 400 | 412 | 0,09 |
| 6,000 % fällig am 29.12.2025 (f)(h) | $ | 500 | 464 | 0,11 |
| 8,000 % fällig am 10.08.2025 (f)(h) | | 300 | 298 | 0,07 |
| **Prudential PLC** | | | | |
| 2,950 % fällig am 03.11.2033 | | 900 | 759 | 0,17 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 2,469 % fällig am 11.01.2028 | | 500 | 442 | 0,10 |
| 4,750 % fällig am 15.09.2025 | | 1.100 | 1.088 | 0,25 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 0,991 % fällig am 12.01.2025 | | 800 | 756 | 0,17 |
| 1,319 % fällig am 14.10.2023 | | 1.300 | 1.291 | 0,30 |
| 1,456 % fällig am 14.01.2027 | | 700 | 618 | 0,14 |
| 2,608 % fällig am 12.01.2028 | | 200 | 179 | 0,04 |
| **Tesco Property Finance PLC** | | | | |
| 5,801 % fällig am 13.10.2040 | £ | 566 | 727 | 0,17 |
| **TP ICAP Finance PLC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 18.11.2028 | | 400 | 400 | 0,09 |
| | | | 22.140 | 5,08 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Alba PLC** | | | | |
| 1,059 % fällig am 17.03.2039 | | 1.012 | 1.188 | 0,27 |
| **Avon Finance PLC** | | | | |
| 1,690 % fällig am 20.09.2048 | | 673 | 813 | 0,19 |
| **Canada Square Funding PLC** | | | | |
| 1,550 % fällig am 17.10.2051 | | 489 | 593 | 0,14 |
| 1,550 % fällig am 17.06.2058 | | 762 | 907 | 0,21 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 13.03.2045 | € | 42 | 44 | 0,01 |
| 1,740 % fällig am 13.03.2045 | £ | 333 | 400 | 0,09 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | |
| 2,065 % fällig am 16.06.2070 | | 561 | 679 | 0,16 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 1,743 % fällig am 18.03.2039 | | 38 | 45 | 0,01 |
| 1,753 % fällig am 18.06.2039 | | 297 | 354 | 0,08 |
| 2,193 % fällig am 18.06.2039 | $ | 203 | 199 | 0,05 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | | |
| 1,703 % fällig am 25.05.2053 | £ | 1.170 | 1.418 | 0,33 |
| **Paragon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,651 % fällig am 15.05.2045 | | 612 | 739 | 0,17 |
| **Polaris PLC** | | | | |
| 1,730 % fällig am 23.12.2058 | | 944 | 1.130 | 0,26 |
| **Resloc UK PLC** | | | | |
| 1,749 % fällig am 15.12.2043 | £ | 549 | $ 614 | 0,14 |
| **Ripon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,351 % fällig am 28.08.2056 | | 3.756 | 4.516 | 1,04 |
| **RMAC PLC** | | | | |
| 1,571 % fällig am 12.06.2046 | | 810 | 978 | 0,22 |
| 1,841 % fällig am 12.06.2046 | | 835 | 1.015 | 0,23 |
| **RMAC Securities PLC** | | | | |
| 1,041 % fällig am 12.06.2044 | | 633 | 725 | 0,17 |
| **Stratton Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2060 | | 1.530 | 1.843 | 0,42 |
| 1,652 % fällig am 12.03.2052 | | 685 | 822 | 0,19 |
| 1,674 % fällig am 25.09.2051 | | 1.135 | 1.371 | 0,31 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2045 | | 1.199 | 1.454 | 0,33 |
| **Tower Bridge Funding PLC** | | | | |
| 2,160 % fällig am 20.09.2063 | | 402 | 489 | 0,11 |
| **Trinity Square PLC** | | | | |
| 1,300 % fällig am 15.07.2059 | | 725 | 875 | 0,20 |
| | | | 23.211 | 5,33 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | | |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 10,250 % | | 2.030 | 361 | 0,09 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 0,125 % fällig am 22.03.2024 (e) | £ | 4.963 | 6.379 | 1,46 |
| 0,625 % fällig am 22.10.2050 | | 1.300 | 963 | 0,22 |
| 1,500 % fällig am 31.07.2053 | | 300 | 283 | 0,07 |
| | | | 7.625 | 1,75 |
| Summe Großbritannien | | | 53.343 | 12,25 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,904 % fällig am 25.07.2036 | $ | 97 | 81 | 0,02 |
| 2,224 % fällig am 25.02.2036 | | 209 | 206 | 0,05 |
| 2,284 % fällig am 25.11.2035 | | 265 | 266 | 0,06 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,824 % fällig am 25.12.2036 | | 11 | 11 | 0,00 |
| 2,718 % fällig am 25.07.2036 | | 18 | 18 | 0,00 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,844 % fällig am 25.01.2037 | | 1.100 | 833 | 0,19 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,144 % fällig am 25.03.2036 | | 1.174 | 1.100 | 0,25 |
| 4,329 % fällig am 25.10.2037 | | 580 | 554 | 0,13 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 872 | 786 | 0,18 |
| 1,764 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 262 | 240 | 0,06 |
| 1,824 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 1.058 | 951 | 0,22 |
| 1,854 % fällig am 25.04.2047 | | 1.300 | 1.189 | 0,27 |
| 1,944 % fällig am 25.05.2036 | | 58 | 66 | 0,02 |
| 2,144 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 3.516 | 3.314 | 0,76 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,344 % fällig am 25.11.2035 | | 111 | 105 | 0,02 |
| **First NLC Trust** | | | | |
| 1,694 % fällig am 25.08.2037 | | 408 | 231 | 0,05 |
| **GSAMP Trust** | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.12.2046 | | 195 | 104 | 0,02 |
| 1,854 % fällig am 25.12.2046 | | 97 | 52 | 0,01 |
| 2,104 % fällig am 25.09.2036 | | 3.206 | 1.293 | 0,30 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 2,719 % fällig am 25.05.2035 | | 601 | 592 | 0,14 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | | |
| 1,964 % fällig am 25.12.2036 | | 205 | 66 | 0,02 |
| 2,239 % fällig am 25.01.2036 | | 2.300 | 2.194 | 0,50 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 2,424 % fällig am 25.10.2035 | | 63 | 63 | 0,01 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,269 % fällig am 25.11.2035 | | 79 | 78 | 0,02 |
| **Massachusetts Educational Financing Authority** | | | | |
| 2,134 % fällig am 25.04.2038 | | 47 | 47 | 0,01 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,834 % fällig am 25.05.2037 | $ | 341 | $ 324 | 0,07 |
| 1,924 % fällig am 25.08.2036 | | 296 | 127 | 0,03 |
| 2,104 % fällig am 25.06.2036 | | 3.802 | 1.686 | 0,39 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 1,754 % fällig am 25.10.2036 | | 703 | 634 | 0,15 |
| 1,754 % fällig am 25.01.2037 | | 2.004 | 1.066 | 0,24 |
| 1,874 % fällig am 25.03.2037 | | 728 | 349 | 0,08 |
| 2,104 % fällig am 25.06.2036 | | 1.415 | 821 | 0,19 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,344 % fällig am 25.03.2035 | | 377 | 369 | 0,08 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.09.2036 | | 207 | 98 | 0,02 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.03.2037 | | 349 | 319 | 0,07 |
| **RAAC Trust** | | | | |
| 3,124 % fällig am 25.09.2047 | | 429 | 417 | 0,10 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | | |
| 2,264 % fällig am 25.01.2036 | | 374 | 352 | 0,08 |
| 2,674 % fällig am 25.09.2035 | | 1.300 | 1.165 | 0,27 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 2,184 % fällig am 25.04.2036 | | 72 | 71 | 0,02 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 2,124 % fällig am 25.05.2036 | | 430 | 253 | 0,06 |
| 2,284 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 653 | 495 | 0,11 |
| 2,584 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 39 | 36 | 0,01 |
| **SMB Private Education Loan Trust** | | | | |
| 1,290 % fällig am 15.07.2053 | | 554 | 503 | 0,12 |
| 2,424 % fällig am 15.07.2053 | | 166 | 163 | 0,04 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 2,184 % fällig am 25.05.2036 | | 634 | 620 | 0,14 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.09.2036 | | 38 | 37 | 0,01 |
| 2,244 % fällig am 25.01.2036 | | 2.147 | 2.046 | 0,47 |
| 2,674 % fällig am 25.08.2033 | | 12 | 11 | 0,00 |
| | | | 26.402 | 6,06 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **7-Eleven, Inc.** | | | | |
| 0,625 % fällig am 10.02.2023 | | 1.400 | 1.373 | 0,32 |
| 0,800 % fällig am 10.02.2024 | | 100 | 95 | 0,02 |
| **AbbVie, Inc.** | | | | |
| 3,850 % fällig am 15.06.2024 | | 1.000 | 1.000 | 0,23 |
| **Aetna, Inc.** | | | | |
| 2,800 % fällig am 15.06.2023 | | 800 | 791 | 0,18 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.08.2029 | | 500 | 459 | 0,11 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,652 % fällig am 24.08.2025 | € | 600 | 622 | 0,14 |
| 1,949 % fällig am 27.10.2026 | | 700 | 709 | 0,16 |
| 2,551 % fällig am 04.02.2028 | $ | 400 | 364 | 0,08 |
| 2,972 % fällig am 04.02.2033 | | 400 | 341 | 0,08 |
| 3,384 % fällig am 02.04.2026 | | 600 | 582 | 0,13 |
| 4,376 % fällig am 27.04.2028 | | 400 | 394 | 0,09 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** | | | | |
| 2,839 % fällig am 15.12.2023 | | 900 | 895 | 0,21 |
| 4,250 % fällig am 15.12.2025 | | 400 | 395 | 0,09 |
| 4,375 % fällig am 15.12.2028 | | 400 | 390 | 0,09 |
| **Boeing Co.** | | | | |
| 1,167 % fällig am 04.02.2023 | | 100 | 99 | 0,02 |
| 1,433 % fällig am 04.02.2024 | | 700 | 669 | 0,15 |
| 2,750 % fällig am 01.02.2026 | | 1.000 | 930 | 0,21 |
| 3,250 % fällig am 01.02.2028 | | 200 | 179 | 0,04 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 15.02.2031 | | 500 | 402 | 0,09 |
| 2,600 % fällig am 15.02.2033 | | 300 | 231 | 0,05 |
| 3,469 % fällig am 15.04.2034 | | 400 | 326 | 0,08 |
| **Charles Schwab Corp.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 18.03.2024 | | 200 | 192 | 0,04 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.01.2029 | | 1.100 | 905 | 0,21 |
| 3,950 % fällig am 30.06.2062 | | 800 | 536 | 0,12 |
| 5,125 % fällig am 01.07.2049 | | 500 | 415 | 0,10 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 3,785 % fällig am 17.03.2033 (i) | | 1.300 | 1.172 | 0,27 |
| **Corebridge Financial, Inc.** | | | | |
| 3,650 % fällig am 05.04.2027 | | 300 | 282 | 0,07 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Doctors Co. An Interinsurance Exchange** | | | | |
| 4,500 % fällig am 18.01.2032 | $ | 100 | $ 88 | 0,02 |
| **Energy Transfer LP** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.04.2029 | | 400 | 397 | 0,09 |
| **Equitable Holdings, Inc.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 20.04.2023 | | 65 | 65 | 0,02 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 21.05.2023 | € | 500 | 519 | 0,12 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 0,092 % fällig am 07.12.2022 | | 300 | 311 | 0,07 |
| 1,744 % fällig am 19.07.2024 | | 100 | 97 | 0,02 |
| 2,366 % fällig am 03.08.2022 | $ | 200 | 200 | 0,05 |
| 2,748 % fällig am 14.06.2024 | £ | 100 | 112 | 0,03 |
| 3,021 % fällig am 06.03.2024 | € | 400 | 402 | 0,09 |
| 3,375 % fällig am 13.11.2025 | $ | 500 | 452 | 0,10 |
| 3,664 % fällig am 08.09.2024 | | 200 | 190 | 0,04 |
| 5,125 % fällig am 16.06.2025 | | 500 | 479 | 0,11 |
| **GA Global Funding Trust** | | | | |
| 2,250 % fällig am 06.01.2027 | | 300 | 269 | 0,06 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 3,550 % fällig am 08.07.2022 | | 400 | 400 | 0,09 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 0,010 % fällig am 30.04.2024 | € | 800 | 823 | 0,19 |
| 0,579 % fällig am 07.02.2025 | | 500 | 520 | 0,12 |
| 1,250 % fällig am 07.02.2029 | | 600 | 540 | 0,12 |
| 1,757 % fällig am 24.01.2025 | $ | 400 | 385 | 0,09 |
| 3,615 % fällig am 15.03.2028 | | 700 | 663 | 0,15 |
| 4,223 % fällig am 01.05.2029 | | 200 | 192 | 0,04 |
| **Hyatt Hotels Corp.** | | | | |
| 1,300 % fällig am 01.10.2023 | | 300 | 291 | 0,07 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 2,595 % fällig am 24.02.2026 | | 1.300 | 1.237 | 0,28 |
| 4,080 % fällig am 26.04.2026 | | 1.300 | 1.286 | 0,30 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 2,103 % fällig am 08.05.2026 | € | 1.000 | 1.026 | 0,24 |
| **MPT Operating Partnership LP** | | | | |
| 2,500 % fällig am 24.03.2026 | £ | 700 | 754 | 0,17 |
| **ONEOK, Inc.** | | | | |
| 4,550 % fällig am 15.07.2028 | $ | 300 | 290 | 0,07 |
| **Organon & Co.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 30.04.2028 | € | 100 | 88 | 0,02 |
| 5,125 % fällig am 30.04.2031 | $ | 300 | 260 | 0,06 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | | |
| 2,100 % fällig am 01.08.2027 | | 100 | 84 | 0,02 |
| 3,150 % fällig am 01.01.2026 | | 100 | 92 | 0,02 |
| 3,450 % fällig am 01.07.2025 | | 100 | 94 | 0,02 |
| 3,950 % fällig am 01.12.2047 ^ | | 100 | 69 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 01.12.2046 ^ | | 100 | 70 | 0,02 |
| 4,200 % fällig am 01.03.2029 | | 300 | 268 | 0,06 |
| 4,500 % fällig am 01.07.2040 | | 100 | 78 | 0,02 |
| 4,550 % fällig am 01.07.2030 | | 100 | 89 | 0,02 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | | |
| 3,950 % fällig am 10.03.2025 | | 1.400 | 1.380 | 0,32 |
| **Principal Life Global Funding** | | | | |
| 1,375 % fällig am 10.01.2025 | | 300 | 280 | 0,06 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | | |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | | 582 | 604 | 0,14 |
| **Santander Holdings USA, Inc.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 18.01.2023 | | 800 | 799 | 0,18 |
| **Southern California Edison Co.** | | | | |
| 1,100 % fällig am 01.04.2024 | | 300 | 286 | 0,07 |
| 2,153 % fällig am 03.04.2023 | | 400 | 399 | 0,09 |
| **Spirit AeroSystems, Inc.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.06.2023 | | 400 | 376 | 0,09 |
| **Sprint Spectrum Co. LLC** | | | | |
| 4,738 % fällig am 20.09.2029 | | 275 | 275 | 0,06 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 3,526 % fällig am 24.03.2028 | | 900 | 853 | 0,20 |
| | | | 33.180 | 7,62 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **CenturyLink, Inc.** | | | | |
| 3,916 % fällig am 15.03.2027 | | 602 | 554 | 0,13 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010** | | | | |
| 7,334 % fällig am 15.02.2028 | | 1.300 | 1.467 | 0,34 |
| **Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021** | | | | |
| 1,337 % fällig am 01.06.2023 | $ | 500 | $ 490 | 0,11 |
| | | | 1.957 | 0,45 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Ashford Hospitality Trust** | | | | |
| 2,224 % fällig am 15.04.2035 | | 1.288 | 1.253 | 0,29 |
| 2,325 % fällig am 15.06.2035 | | 1.300 | 1.261 | 0,29 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 1,992 % fällig am 20.10.2036 | | 50 | 39 | 0,01 |
| **Barclays Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,324 % fällig am 15.07.2037 | | 1.361 | 1.326 | 0,30 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | | |
| 3,718 % fällig am 25.07.2037 | | 41 | 36 | 0,01 |
| **Citigroup Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 3,251 % fällig am 10.05.2035 | | 1.000 | 979 | 0,22 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 2,883 % fällig am 25.05.2035 | | 26 | 25 | 0,01 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,032 % fällig am 20.03.2046 | | 23 | 18 | 0,00 |
| 2,032 % fällig am 20.05.2046 ^ | | 27 | 23 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 407 | 219 | 0,05 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 198 | 105 | 0,02 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,244 % fällig am 25.03.2035 | | 284 | 264 | 0,06 |
| **DBWF Mortgage Trust** | | | | |
| 2,625 % fällig am 19.12.2030 | | 1.200 | 1.166 | 0,27 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 | | 172 | 158 | 0,04 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,913 % fällig am 19.06.2036 ^ | | 184 | 95 | 0,02 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 2,144 % fällig am 25.02.2046 ^ | | 209 | 179 | 0,04 |
| **Morgan Stanley Capital Trust** | | | | |
| 2,224 % fällig am 15.07.2035 | | 1.300 | 1.262 | 0,29 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 | | 303 | 262 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 294 | 153 | 0,04 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | | |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 | | 1.014 | 853 | 0,20 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | | |
| 2,224 % fällig am 20.01.2047 ^ | | 17 | 12 | 0,00 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.10.2035 | | 167 | 157 | 0,04 |
| 2,064 % fällig am 25.05.2037 | | 29 | 26 | 0,01 |
| 3,090 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 67 | 44 | 0,01 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 1,984 % fällig am 25.07.2046 | | 508 | 438 | 0,10 |
| 2,024 % fällig am 25.05.2036 | | 213 | 182 | 0,04 |
| 2,044 % fällig am 25.04.2036 | | 19 | 17 | 0,00 |
| 2,435 % fällig am 19.10.2033 | | 2 | 2 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp.** | | | | |
| 1,904 % fällig am 25.01.2036 | | 149 | 144 | 0,03 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,914 % fällig am 25.10.2036 | | 534 | 469 | 0,11 |
| **Tharaldson Hotel Portfolio Trust** | | | | |
| 2,170 % fällig am 11.11.2034 | | 1.296 | 1.259 | 0,29 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 1,876 % fällig am 25.06.2042 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,184 % fällig am 25.11.2045 | | 139 | 126 | 0,03 |
| 3,052 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 69 | 63 | 0,01 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 422 | 405 | 0,09 |
| | | | 13.021 | 2,99 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 2,024 % fällig am 25.06.2036 | | 20 | 20 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 01.03.2060 | | 504 | 473 | 0,11 |
| 3,500 % fällig am 01.01.2059 | | 1.495 | 1.453 | 0,33 |
| **Freddie Mac** | | | | |
| 1,150 % fällig am 15.01.2038 | | 320 | 318 | 0,07 |
| 1,295 % fällig am 15.01.2038 (a) | | 320 | 18 | 0,00 |
| **Ginnie Mae** | | | | |
| 1,143 % fällig am 20.12.2062 | $ | 438 | $ 433 | 0,10 |
| 3,000 % fällig am 20.07.2046 - 20.05.2047 | | 12 | 11 | 0,00 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.02.2052 | | 2.776 | 2.421 | 0,56 |
| 2,500 % fällig am 01.02.2051 - 01.01.2052 | | 2.081 | 1.876 | 0,43 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2042 - 01.06.2051 | | 2.320 | 2.176 | 0,50 |
| 3,500 % fällig am 01.10.2034 - 01.07.2050 | | 997 | 977 | 0,22 |
| 4,000 % fällig am 01.09.2040 - 01.06.2050 | | 563 | 562 | 0,13 |
| 4,500 % fällig am 01.04.2041 | | 66 | 68 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 01.07.2037 - 01.04.2039 | | 188 | 202 | 0,05 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.08.2052 | | 3.200 | 2.978 | 0,68 |
| 3,500 % fällig am 01.07.2037 - 01.08.2052 | | 38.800 | 37.298 | 8,56 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2052 | | 21.900 | 21.565 | 4,95 |
| | | | 72.849 | 16,72 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | | |
| 1,625 % fällig am 15.11.2050 | | 1.900 | 1.337 | 0,30 |
| 1,875 % fällig am 15.02.2041 (k) | | 13.500 | 10.594 | 2,43 |
| 2,875 % fällig am 15.05.2052 | | 1.000 | 945 | 0,22 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2030 | | 1.917 | 1.829 | 0,42 |
| 0,125 % fällig am 15.01.2031 | | 1.110 | 1.057 | 0,24 |
| 0,250 % fällig am 15.02.2050 | | 1.124 | 889 | 0,21 |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028 | | 9.609 | 9.549 | 2,19 |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 | | 1.958 | 1.973 | 0,45 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 2,875 % fällig am 30.04.2025 (j) | | 9.300 | 9.262 | 2,13 |
| | | | 37.435 | 8,59 |
| Summe USA | | | 185.398 | 42,56 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | | |
| 51,049 % fällig am 30.09.2022 (c)(d) | ARS | 35.900 | 120 | 0,03 |
| **ISRAEL TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,050) % fällig am 07.10.2022 (c)(d) | ILS | 300 | 86 | 0,02 |
| (0,020) % fällig am 07.12.2022 (c)(d) | | 400 | 114 | 0,03 |
| 0,505 % fällig am 08.02.2023 (c)(d) | | 9.900 | 2.808 | 0,64 |
| 0,746 % fällig am 05.04.2023 (c)(d) | | 4.200 | 1.189 | 0,27 |
| 0,753 % fällig am 05.04.2023 (c)(d) | | 6.700 | 1.897 | 0,43 |
| 0,875 % fällig am 03.05.2023 (c)(d) | | 7.800 | 2.203 | 0,51 |
| 0,913 % fällig am 05.04.2023 (c)(d) | | 2.300 | 651 | 0,15 |
| 0,950 % fällig am 05.04.2023 (c)(d) | | 700 | 198 | 0,05 |
| | | | 9.146 | 2,10 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 9.266 | 2,13 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **$ 490.912** | **112,70** |
| | | **AKTIEN** | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)** | | 1.764.182 | 17.550 | 4,03 |
| **PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (g)** | | 446.527 | 6.073 | 1,39 |
| **Summe Investmentfonds** | | | **$ 23.623** | **5,42** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 351 | U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | $ (358) | $ 351 | $ 351 | 0,08 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (358)** | **$ 351** | **$ 351** | **0,08** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month SOFR June Futures | Long | 09.2023 | 40 | $ (62) | (0,01) |
| Australia Government 3-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 28 | (1) | 0,00 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 64 | (20) | 0,00 |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 18 | 59 | 0,01 |
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09.2022 | 324 | 677 | 0,16 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09.2022 | 110 | (640) | (0,15) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 2 | 7 | 0,00 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 5 | 37 | 0,01 |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 203 | 890 | 0,21 |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 13 | (29) | (0,01) |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 214 | 35 | 0,01 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 290 | 150 | 0,03 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 136 | (130) | (0,03) |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2022 | 191 | (111) | (0,03) |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 26 | 40 | 0,01 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09.2022 | 5 | (23) | (0,01) |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09.2022 | 159 | 755 | 0,17 |
| | | | | $ 1.634 | 0,37 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CME Kaufoptionen mit Ausübungskurs von @ USD 98,000 auf 3-Month SOFR December Futures | $ 98,000 | 15.12.2023 | 7 | $ (6) | $ (5) | 0,00 |
| Call - CME Verkaufoptionen mit Ausübungskurs von @ USD 96,500 auf 3-Month SOFR December Futures | 96,500 | 15.12.2023 | 7 | (6) | (9) | 0,00 |
| | | | | $ (12) | $ (14) | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ 1.620** | **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 INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 300 | $ (4) | 0,00 |
| Barclays Bank PLC | 1,000 | 20.12.2022 | € 600 | (3) | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.06.2028 | 700 | (24) | (0,01) |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.06.2025 | $ 400 | 0 | 0,00 |
| General Motors Co. | 5,000 | 20.12.2026 | 400 | (39) | (0,01) |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.12.2024 | € 200 | 1 | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.06.2026 | 450 | (5) | 0,00 |
| Shell International Finance BV | 1,000 | 20.12.2026 | 600 | (10) | 0,00 |
| | | | | $ (84) | (0,02) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[2]

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-37 5-Year Index | (1,000) % | 20.06.2027 | $ 3.600 | $ 68 | 0,01 |
| CDX.HY-35 5-Year Index | (5,000) | 20.12.2025 | 297 | 29 | 0,01 |
| CDX.HY-36 5-Year Index | (5,000) | 20.06.2026 | 693 | 70 | 0,01 |
| CDX.IG-35 10-Year Index | (1,000) | 20.12.2030 | 1.600 | 37 | 0,01 |
| CDX.IG-37 10-Year Index | (1,000) | 20.12.2031 | 7.200 | 116 | 0,03 |
| CDX.IG-38 10-Year Index | (1,000) | 20.06.2032 | 13.400 | 163 | 0,04 |
| | | | | $ 483 | 0,11 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Crossover 37 5-Year Index | 5,000 % | 20.06.2027 | € 1.300 | $ (70) | (0,02) |
| iTraxx Europe Main 36 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 1.400 | (9) | 0,00 |
| | | | | $ (79) | (0,02) |

## ZINSSWAPS - BASISSWAPS

| Zahlung variabler Zinssatzindex | Erhalt variabler Zinssatzindex | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month USD-LIBOR | 1-Month USD-LIBOR + 0,070 % | 07.03.2024 | $ 3.400 | $ 0 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR[4] | 1-Month USD-LIBOR + 0,088 % | 06.09.2024 | 21.300 | 5 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR | 1-Month USD-LIBOR + 0,098 % | 02.03.2023 | 4.600 | 0 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR[4] | 1-Month USD-LIBOR + 0,102 % | 04.10.2024 | 4.500 | 2 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR[4] | 1-Month USD-LIBOR + 0,105 % | 27.09.2024 | 10.300 | 4 | 0,00 |
| | | | | $ 11 | 0,00 |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,010 % | 07.02.2023 | £ 17.800 | $ (317) | (0,07) |
| Erhalt[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 | 21.09.2024 | 9.600 | 44 | 0,01 |
| Zahlung[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 | 21.09.2027 | 5.100 | (168) | (0,04) |
| Zahlung[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2032 | 15.200 | (836) | (0,19) |
| Erhalt[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2052 | 300 | 48 | 0,01 |
| Zahlung | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 5,500 | 15.12.2026 | INR 666.500 | 121 | 0,03 |
| Zahlung[4] | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 5,750 | 15.03.2024 | 3.282.200 | 74 | 0,02 |
| Erhalt | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 5,750 | 16.03.2027 | 716.800 | (124) | (0,03) |
| Erhalt | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 6,250 | 16.03.2032 | 63.900 | (21) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 15.12.2028 | ¥ 250.000 | (30) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 17.03.2031 | 230.000 | (47) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,050 | 15.12.2031 | 250.000 | (13) | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,400 | 19.06.2039 | 280.000 | 173 | 0,04 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,800 | 15.06.2052 | 300.000 | 132 | 0,03 |
| Erhalt | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 1,250 | 16.03.2024 | SGD 25.880 | 141 | 0,03 |
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 1,250 | 15.09.2031 | 180 | (3) | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 1,250 | 15.09.2031 | 200 | 19 | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 2,250 | 15.06.2032 | 250 | (5) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 2,500 | 15.06.2032 | 1.100 | (17) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 2,750 | 15.06.2027 | 3.200 | 7 | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 3,000 | 15.06.2027 | 5.400 | 52 | 0,01 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 0,500 | 15.06.2024 | $ 18.500 | (600) | (0,14) |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 | 15.06.2027 | 3.300 | 237 | 0,05 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 | 15.06.2027 | 7.100 | 320 | 0,07 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 | 15.06.2029 | 15.000 | (240) | (0,06) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,250 | 15.12.2028 | 3.200 | (283) | (0,06) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,250 | 15.06.2032 | 11.600 | (1.087) | (0,25) |
| Erhalt[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,320 | 21.12.2023 | 169.000 | 2.767 | 0,64 |
| Erhalt[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,430 | 31.03.2024 | 200 | 4 | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,500 | 15.12.2031 | 6.700 | (842) | (0,19) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,500 | 15.06.2052 | 2.300 | (466) | (0,11) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,618 | 09.02.2029 | 1.600 | (100) | (0,02) |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2027 | 45.100 | 625 | 0,14 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2032 | 1.700 | 18 | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2052 | 2.000 | (12) | 0,00 |
| Erhalt[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,850 | 21.04.2024 | 55.400 | 51 | 0,01 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,888 | 22.03.2029 | 2.500 | (120) | (0,03) |
| Erhalt[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,117 | 31.03.2024 | 9.900 | 153 | 0,04 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,175 | 21.04.2029 | 2.400 | (76) | (0,02) |
| Erhalt[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,209 | 31.03.2024 | 7.900 | 110 | 0,03 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,370 | 21.06.2027 | 3.200 | (48) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,400 | 21.06.2024 | 9.300 | (88) | (0,02) |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,703 | 22.06.2052 | 500 | (6) | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,792 | 23.06.2052 | 400 | (12) | 0,00 |
| Zahlung[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,886 | 15.05.2032 | 22.000 | 237 | 0,05 |
| Erhalt[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,965 | 30.11.2026 | 31.500 | (181) | (0,04) |
| Zahlung[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,968 | 30.06.2024 | 15.700 | (42) | (0,01) |
| Zahlung[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,004 | 30.06.2024 | 6.000 | (12) | 0,00 |
| Zahlung[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,005 | 15.05.2032 | 2.100 | 34 | 0,01 |
| Zahlung[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,026 | 30.06.2024 | 10.000 | (17) | 0,00 |
| Erhalt[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,059 | 30.11.2026 | 4.700 | (40) | (0,01) |
| Zahlung[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,486 | 30.06.2024 | 4.900 | 29 | 0,01 |
| Zahlung[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,527 | 30.06.2024 | 4.700 | 31 | 0,01 |
| Zahlung[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,531 | 30.06.2024 | 4.200 | 28 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,280 | 04.01.2027 | BRL 1.600 | 33 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,220 | 03.03.2025 | CAD 6.700 | (318) | (0,07) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,500 | 17.06.2025 | 2.600 | (139) | (0,03) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,500 | 17.06.2030 | 1.600 | (137) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,750 | 16.12.2046 | 1.400 | 175 | 0,04 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,900 % | 18.12.2029 | CAD 3.700 | $ (330) | (0,08) |
| Zahlung[4] | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,000 | 14.11.2023 | 6.000 | (76) | (0,02) |
| Zahlung[4] | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,060 | 28.10.2023 | 13.500 | (166) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,283 | 14.02.2027 | CHF 1.700 | (61) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,294 | 10.02.2027 | 4.400 | (146) | (0,03) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,295 | 17.02.2027 | 1.000 | (36) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,300 | 15.02.2027 | 1.700 | (60) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,343 | 16.05.2027 | 1.300 | (51) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,368 | 15.06.2027 | 7.700 | (288) | (0,07) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,500 | 15.09.2026 | 16.600 | (1.072) | (0,25) |
| Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,500 | 16.03.2027 | CNY 5.100 | (5) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 3,000 | 15.06.2032 | KRW 876.900 | (13) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 3,250 | 15.06.2032 | 580.900 | (3) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month NZD-BBR | 0,528 | 17.03.2024 | NZD 350 | (11) | 0,00 |
| Zahlung[4] | 3-Month NZD-BBR | 3,000 | 01.11.2023 | 12.400 | (98) | (0,02) |
| Zahlung[4] | 3-Month NZD-BBR | 3,000 | 15.12.2023 | 11.700 | (89) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month NZD-BBR | 3,250 | 21.03.2028 | 2.600 | (259) | (0,06) |
| Zahlung | 3-Month NZD-BBR | 3,750 | 15.06.2027 | 4.100 | 31 | 0,01 |
| Zahlung[4] | 3-Month NZD-BBR | 4,000 | 14.06.2024 | 24.900 | 3 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month SEK-STIBOR | 0,500 | 19.06.2024 | SEK 12.700 | (64) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month SEK-STIBOR | 1,000 | 19.06.2029 | 16.100 | (213) | (0,05) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,250 | 30.03.2023 | $ 1.200 | (25) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,500 | 16.06.2028 | 2.800 | (245) | (0,06) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,750 | 16.12.2022 | 6.700 | (121) | (0,03) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,750 | 16.12.2022 | 2.200 | (40) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,249 | 31.08.2024 | 9.500 | 561 | 0,13 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 15.12.2026 | 3.950 | 346 | 0,08 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 15.12.2026 | 10.200 | 888 | 0,20 |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 1,270 | 04.11.2023 | 49.200 | 588 | 0,14 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,298 | 25.08.2024 | 8.100 | 481 | 0,11 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,305 | 21.08.2023 | 9.550 | 393 | 0,09 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 18.12.2024 | 200 | 14 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 15.12.2028 | 9.900 | (1.034) | (0,24) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,518 | 20.01.2029 | 800 | (67) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,630 | 20.01.2029 | 2.300 | (177) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,630 | 26.01.2029 | 500 | (39) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,655 | 24.01.2032 | 1.300 | (143) | (0,03) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 15.12.2051 | 3.100 | (833) | (0,19) |
| Erhalt | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 1,250 | 17.06.2030 | AUD 5.700 | 632 | 0,14 |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 1,750 | 16.03.2027 | 1.900 | (110) | (0,03) |
| Erhalt | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 1,750 | 16.06.2031 | 1.750 | 218 | 0,05 |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,054 | 27.05.2050 | € 200 | 41 | 0,01 |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,064 | 17.11.2052 | 500 | 132 | 0,03 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2027 | 23.600 | (1.258) | (0,29) |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | 52.150 | (3.403) | (0,78) |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,450 | 15.12.2035 | 300 | 71 | 0,02 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2024 | 1.600 | (34) | (0,01) |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2052 | 5.900 | 1.328 | 0,30 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 12.04.2027 | 1.400 | (64) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 11.05.2027 | 900 | (41) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,700 | 11.04.2027 | 700 | (31) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 13.05.2027 | 1.600 | (52) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.05.2027 | 700 | (23) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month NOK-NIBOR | 1,635 | 18.03.2025 | NOK 6.200 | 37 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month NOK-NIBOR | 1,993 | 12.11.2024 | 4.200 | 21 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 4,870 | 07.07.2025 | MXN 41.500 | (137) | (0,03) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,080 | 26.02.2025 | 10.500 | (40) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,380 | 25.02.2025 | 12.300 | (48) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,415 | 25.02.2025 | 300 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | UKRPI | 3,700 | 15.04.2031 | £ 100 | (15) | 0,00 |
| Zahlung | UKRPI | 3,740 | 15.03.2031 | 800 | (124) | (0,03) |
| | | | | | $ (6.145) | (1,40) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (5.814)** | **(1,33)** |

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

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

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

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

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

### OPTIONSKAUF

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,180 % | 11.01.2024 | 1.900 | $ 54 | $ 137 | 0,03 |

#### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Put - OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052 | € 97,000 | 23.05.2025 | 800 | $ 61 | $ 277 | 0,06 |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 % | 20.07.2022 | 900 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 1.200 | (6) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 2.400 | (7) | (8) | (0,01) |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 500 | (1) | 0 | 0,00 |
| BRC | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 1.600 | (7) | (4) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 400 | (1) | 0 | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 1.400 | (3) | (2) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 95,000 | 17.08.2022 | 200 | (2) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 300 | (3) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,100 | 20.07.2022 | 1.400 | (5) | (5) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,350 | 17.08.2022 | 1.000 | (2) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ (39) | $ (31) | (0,01) |

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,150 % | 01.12.2023 | 1.300 | $ (4) | $ (5) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,650 | 01.12.2023 | 1.300 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,310 | 11.01.2024 | 16.900 | (55) | (142) | (0,03) |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,310 | 19.08.2022 | 2.200 | (19) | (6) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,010 | 19.08.2022 | 2.200 | (19) | (21) | (0,01) |
| BPS | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 11.04.2023 | 2.000 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 11.04.2023 | 2.000 | (6) | (8) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 28.04.2023 | 1.200 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 28.04.2023 | 1.200 | (2) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,451 | 23.05.2025 | 800 | (60) | (276) | (0,07) |
| CBK | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 01.09.2022 | 2.700 | (23) | (16) | (0,01) |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 01.09.2022 | 2.700 | (23) | (27) | (0,01) |
| DUB | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,920 | 13.10.2023 | 700 | (4) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,920 | 13.10.2023 | 700 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,790 | 08.04.2024 | 1.700 | (13) | (13) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,790 | 08.04.2024 | 1.700 | (13) | (11) | 0,00 |
| | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,350 | 08.08.2022 | 500 | (2) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,550 | 08.08.2022 | 500 | (2) | (10) | 0,00 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 02.09.2022 | 2.500 | (13) | (11) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 02.09.2022 | 2.500 | (13) | (18) | (0,01) |
| GLM | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,870 | 02.11.2022 | 49.200 | (98) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,270 | 02.11.2022 | 49.200 | (98) | (1.128) | (0,25) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,920 | 13.10.2023 | 500 | (3) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,920 | 13.10.2023 | 500 | (3) | (3) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,018 | 20.10.2023 | 500 | (3) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,018 | 20.10.2023 | 500 | (3) | (3) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,140 | 23.10.2023 | 600 | (4) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,140 | 23.10.2023 | 600 | (4) | (3) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,190 | 23.10.2023 | 600 | (4) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,190 | 23.10.2023 | 600 | (4) | (3) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,225 | 23.10.2023 | 500 | (3) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,225 | 23.10.2023 | 500 | (3) | (2) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,973 | 25.10.2023 | 600 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,973 | 25.10.2023 | 600 | (4) | (3) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,841 | 27.10.2023 | 400 | (3) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,841 | 27.10.2023 | 400 | (3) | (2) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,088 | 03.11.2023 | 300 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,088 | 03.11.2023 | 300 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,910 | 10.11.2023 | 900 | (6) | (7) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,910 | 10.11.2023 | 900 | (6) | (5) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 17.11.2023 | 1.600 | (6) | (7) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 17.11.2023 | 1.600 | (6) | (5) | 0,00 |

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,150 % | 20.11.2023 | 1.000 | $ (3) | $ (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,650 | 20.11.2023 | 1.000 | (3) | (3) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 07.12.2023 | 900 | (3) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 07.12.2023 | 900 | (3) | (3) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,697 | 02.04.2024 | 2.000 | (16) | (14) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,697 | 02.04.2024 | 2.000 | (16) | (13) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,721 | 08.04.2024 | 600 | (5) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,721 | 08.04.2024 | 600 | (5) | (4) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 05.04.2023 | 3.900 | (7) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 05.04.2023 | 3.900 | (7) | (14) | (0,01) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 11.04.2023 | 6.800 | (13) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 11.04.2023 | 6.800 | (13) | (25) | (0,01) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 24.04.2023 | 1.300 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 24.04.2023 | 1.300 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 26.04.2023 | 1.300 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 26.04.2023 | 1.300 | (2) | (4) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 15.05.2023 | 1.800 | (3) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 15.05.2023 | 1.800 | (3) | (7) | 0,00 |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,370 | 18.08.2022 | 1.600 | (11) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,070 | 18.08.2022 | 1.600 | (11) | (10) | 0,00 |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 06.09.2022 | 400 | (3) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 06.09.2022 | 400 | (3) | (3) | 0,00 |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 | 07.09.2022 | 1.200 | (8) | (8) | 0,00 |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,100 | 07.09.2022 | 1.200 | (8) | (9) | 0,00 |
| JPM | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 0,820 | 16.12.2024 | 4.600 | (32) | (13) | (0,01) |
| MYC | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,993 | 11.10.2023 | 400 | (3) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,993 | 11.10.2023 | 400 | (3) | (2) | 0,00 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,150 | 12.07.2022 | 2.300 | (18) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | $ (764) | $ (1.955) | (0,44) |

## ZINSCAPS

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYC | Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor | 1-Year USD-LIBOR | 0,000 % | 07.10.2022 | 12.500 | $ (13) | $ 0 | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor | 1-Year USD-LIBOR | 0,000 | 08.10.2022 | 3.500 | (3) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (16) | $ 0 | 0,00 |

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MSC | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 2,500 % fällig am 01.09.2052 | $ 91,359 | 07.09.2022 | 300 | $ (2) | $ (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 | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | South Korea Government International Bond | (1,000) % | 20.06.2023 | $ 2.100 | $ (52) | $ 32 | $ (20) | (0,01) |
| BRC | China Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 1.200 | (23) | 11 | (12) | 0,00 |
| | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 1.500 | (39) | 25 | (14) | 0,00 |
| GST | China Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 2.200 | (42) | 21 | (21) | (0,01) |
| HUS | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 1.200 | (30) | 19 | (11) | 0,00 |
| JPM | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 1.700 | (41) | 25 | (16) | 0,00 |
| | | | | | $ (227) | $ 133 | $ (94) | (0,02) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Italy Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2025 | $ 500 | $ (12) | $ 15 | $ 3 | 0,00 |
| BRC | Italy Government International Bond | 1,000 | 20.06.2025 | 400 | (10) | 12 | 2 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2025 | 1.100 | (64) | 8 | (56) | (0,01) |
| CBK | Italy Government International Bond | 1,000 | 20.06.2025 | 500 | (12) | 15 | 3 | 0,00 |
| GST | Abu Dhabi Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 1.100 | 32 | (16) | 16 | 0,00 |
| | | | | | $ (66) | $ 34 | $ (32) | (0,01) |

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

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

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

## CROSS-CURRENCY SWAPS

| Kontrahent | Erhalt | Zahlung | Fälligkeits-datum | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,290 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 04.01.2031 | AUD 700 | $ 527 | $ 3 | $ (2) | $ 1 | 0,00 |
| CBK | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,420 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 31.07.2029 | 5.900 | 4.071 | (2) | 2 | 0 | 0,00 |
| GLM | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,423 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 01.08.2029 | 5.600 | 3.864 | (11) | 2 | (9) | 0,00 |
| | | | | | | $ (10) | $ 2 | $ (8) | 0,00 |

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 4,250 % | 15.06.2027 | MYR 3.500 | $ 9 | $ 7 | $ 16 | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,000 | 15.06.2032 | THB 17.700 | (2) | (39) | (41) | (0,01) |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,750 | 15.06.2032 | 26.300 | (9) | (1) | (10) | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,250 | 15.06.2032 | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,250 | 15.06.2032 | 3.400 | 1 | 2 | 3 | 0,00 |
| CBK | Erhalt | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,500 | 16.03.2032 | MYR 8.100 | 9 | 77 | 86 | 0,02 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,480 | 18.05.2027 | THB 4.000 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,810 | 18.05.2037 | 32.000 | 0 | (73) | (73) | (0,02) |
| GLM | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 4,000 | 15.06.2027 | MYR 10.100 | (18) | 37 | 19 | 0,01 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,000 | 15.06.2032 | THB 13.800 | (1) | (31) | (32) | (0,01) |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,250 | 15.06.2032 | 800 | 0 | 1 | 1 | 0,00 |
| JPM | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,960 | 11.02.2029 | COP 15.800 | 0 | 1 | 1 | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,000 | 15.06.2032 | THB 24.400 | (3) | (53) | (56) | (0,01) |
| | | | | | | $ (14) | $ (73) | $ (87) | (0,02) |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | DKK | 3.745 | $ | 561 | $ 34 | $ 0 | $ 34 | 0,01 |
| | 07.2022 | £ | 18.754 | | 23.713 | 937 | 0 | 937 | 0,22 |
| | 07.2022 | $ | 11.357 | DKK | 79.848 | 0 | (132) | (132) | (0,03) |
| | 07.2022 | | 1.449 | PEN | 5.854 | 88 | 0 | 88 | 0,02 |
| | 07.2022 | | 362 | ZAR | 5.556 | 0 | (23) | (23) | (0,01) |
| | 08.2022 | CHF | 804 | $ | 815 | 0 | (27) | (27) | (0,01) |
| | 08.2022 | DKK | 79.686 | | 11.357 | 135 | 0 | 135 | 0,03 |
| | 08.2022 | € | 3.800 | | 4.026 | 43 | (1) | 42 | 0,01 |
| | 08.2022 | MXN | 727 | | 36 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 504 | CAD | 647 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.440 | € | 1.366 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 924 | ¥ | 119.400 | 0 | (42) | (42) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 2.171 | NOK | 20.675 | 0 | (77) | (77) | (0,02) |
| | 08.2022 | | 3.251 | SEK | 32.160 | 0 | (108) | (108) | (0,02) |
| | 11.2022 | | 101 | ZAR | 1.598 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 12.2022 | PEN | 2.431 | $ | 636 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 05.2023 | CNH | 8.080 | | 1.249 | 42 | 0 | 42 | 0,01 |
| BPS | 07.2022 | DKK | 3.910 | | 556 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 2.941 | | 141 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07.2022 | NZD | 189 | | 118 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.693 | DKK | 11.955 | 2 | (14) | (12) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 185 | MXN | 3.724 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 101 | $ | 78 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 1.733 | | 1.865 | 48 | 0 | 48 | 0,01 |
| | 08.2022 | THB | 9 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 1.603 | CAD | 2.073 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 556 | IDR | 8.196.554 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 4.912 | INR | 382.861 | 0 | (83) | (83) | (0,02) |
| | 08.2022 | | 5.004 | MXN | 109.921 | 410 | 0 | 410 | 0,09 |
| | 08.2022 | | 361 | PEN | 1.377 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 24 | THB | 842 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 416 | ZAR | 6.641 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 09.2022 | MXN | 3.724 | $ | 183 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 1.183 | TWD | 32.869 | 0 | (72) | (72) | (0,02) |
| | 11.2022 | | 221 | ZAR | 3.551 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 02.2023 | ILS | 2.588 | $ | 784 | $ 33 | $ 0 | $ 33 | 0,01 |
| BRC | 07.2022 | $ | 2.042 | £ | 1.648 | 0 | (41) | (41) | (0,01) |
| | 08.2022 | SGD | 1.236 | $ | 895 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 609 | IDR | 9.018.048 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.986 | ¥ | 266.700 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.724 | NOK | 16.867 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 1.400 | MYR | 6.135 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | BRL | 1.126 | $ | 215 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | NZD | 162 | | 101 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 2.460 | | 1.733 | 41 | 0 | 41 | 0,01 |
| | 08.2022 | CAD | 193 | | 153 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 1.988.170 | | 136 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | ILS | 1.014 | | 307 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 213 | BRL | 1.126 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 272 | CLP | 239.219 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 5.043 | ¥ | 661.700 | 0 | (159) | (159) | (0,04) |
| | 08.2022 | | 152 | PEN | 577 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 10.2022 | ILS | 300 | $ | 96 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 12.2022 | | 400 | | 130 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 12.2022 | PEN | 32.489 | | 8.415 | 30 | (38) | (8) | 0,00 |
| | 02.2023 | ILS | 7.262 | | 2.202 | 96 | 0 | 96 | 0,02 |
| | 04.2023 | | 6.456 | | 1.967 | 88 | 0 | 88 | 0,02 |
| | 05.2023 | CNH | 886 | | 137 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 05.2023 | ILS | 7.735 | | 2.354 | 99 | 0 | 99 | 0,02 |
| DUB | 07.2022 | DKK | 25.779 | | 3.817 | 193 | 0 | 193 | 0,04 |
| | 07.2022 | $ | 391 | DKK | 2.760 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.350 | PLN | 10.252 | 0 | (73) | (73) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 935 | RON | 4.381 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 7.180 | ¥ | 933.942 | 0 | (288) | (288) | (0,07) |
| | 08.2022 | | 165 | THB | 5.742 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 47 | TWD | 1.384 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 12.2022 | | 488 | ZAR | 7.672 | 0 | (27) | (27) | (0,01) |
| GLM | 07.2022 | BRL | 26.982 | $ | 5.206 | 46 | 0 | 46 | 0,01 |
| | 07.2022 | MXN | 525 | | 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | PLN | 594 | | 131 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 5.789 | BRL | 29.201 | 0 | (205) | (205) | (0,05) |
| | 08.2022 | PEN | 1.475 | $ | 390 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 5.165 | BRL | 26.982 | 0 | (49) | (49) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 147 | PEN | 549 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 524 | SGD | 727 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 1.245 | HKD | 9.749 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11.2022 | | 105 | ZAR | 1.692 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 03.2023 | CNH | 9.735 | $ | 1.507 | 53 | 0 | 53 | 0,01 |
| | 05.2023 | $ | 38 | ZAR | 630 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| IND | 05.2023 | CNH | 12.852 | $ | 1.987 | 66 | 0 | 66 | 0,02 |
| JPM | 07.2022 | BRL | 1.092 | | 226 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 22.486 | | 1.106 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07.2022 | PEN | 499 | | 136 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.084 | CZK | 25.404 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 16.179.354 | $ | 1.091 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 08.2022 | SGD | 9.919 | | 7.216 | 88 | 0 | 88 | 0,02 |
| | 08.2022 | $ | 2.763 | CNH | 18.571 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 464 | € | 432 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 993 | IDR | 14.478.057 | 0 | (27) | (27) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 1.383 | KRW | 1.760.594 | 0 | (26) | (26) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 2.530 | SGD | 3.507 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 547 | TWD | 16.127 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 1.400 | | 38.921 | 0 | (84) | (84) | (0,02) |
| | 09.2022 | | 967 | VND | 22.242.320 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 04.2023 | ILS | 7.351 | $ | 2.212 | 72 | 0 | 72 | 0,02 |
| MBC | 07.2022 | MXN | 783 | | 38 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.027 | NZD | 1.574 | 0 | (48) | (48) | (0,01) |
| | 08.2022 | AUD | 387 | $ | 275 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 08.2022 | INR | 29.493 | | 377 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 68.100 | | 539 | 37 | 0 | 37 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 4.322 | CNH | 29.020 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 753 | € | 699 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 947 | IDR | 13.884.841 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.209 | ¥ | 162.500 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 150 | PEN | 564 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 05.2023 | | 6.032 | CNH | 40.482 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | DKK | 88.183 | $ | 13.071 | 674 | 0 | 674 | 0,15 |
| | 07.2022 | $ | 2.849 | DKK | 19.988 | 0 | (39) | (39) | (0,01) |
| | 08.2022 | DKK | 15.905 | $ | 2.265 | 25 | 0 | 25 | 0,01 |
| | 08.2022 | € | 345 | | 365 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | NOK | 2.100 | | 224 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 293 | CHF | 291 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 8.434 | CNY | 56.619 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 540 | € | 513 | 1 | (3) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 688 | IDR | 10.144.940 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 8.231 | INR | 643.028 | 0 | (121) | (121) | (0,03) |
| | 08.2022 | | 1.789 | KRW | 2.278.743 | 0 | (32) | (32) | (0,01) |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08.2022 | $ | 407 | THB | 14.008 | $ 0 | $ (10) | $ (10) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 163 | TWD | 4.796 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 375 | KZT | 171.575 | 0 | (23) | (23) | (0,01) |
| | 09.2022 | | 569 | TWD | 15.887 | 0 | (32) | (32) | (0,01) |
| RBC | 08.2022 | KRW | 169.287 | $ | 131 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 5.666 | CAD | 7.332 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| RYL | 08.2022 | CHF | 312 | $ | 315 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | $ | 934 | CLP | 774.604 | 0 | (108) | (108) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 243 | DKK | 1.675 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 748 | £ | 609 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 151 | ILS | 510 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 1.130 | $ | 784 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 308 | | 240 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | CHF | 1.058 | | 1.087 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 572 | | 600 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 6.828 | CHF | 6.766 | 260 | 0 | 260 | 0,06 |
| | 08.2022 | | 8.083 | CNH | 54.147 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 13.542 | CNY | 90.629 | 0 | (29) | (29) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 277 | € | 261 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 09.2022 | MYR | 26.192 | $ | 6.238 | 299 | 0 | 299 | 0,07 |
| | 09.2022 | $ | 5.142 | MYR | 22.729 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 453 | ZAR | 6.996 | 0 | (29) | (29) | (0,01) |
| | 11.2022 | | 531 | COP | 2.258.511 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | | 759 | DKK | 5.380 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 20.077 | £ | 16.497 | 0 | (42) | (42) | (0,01) |
| | 08.2022 | £ | 16.497 | $ | 20.086 | 42 | 0 | 42 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 2.300 | NOK | 22.555 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| SSB | 07.2022 | CLP | 113.948 | $ | 136 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 593 | MYR | 2.596 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| TOR | 08.2022 | CHF | 304 | $ | 307 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | CLP | 774.604 | | 844 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 3.713 | | 183 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 605 | HUF | 212.009 | 0 | (47) | (47) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 876 | PHP | 45.973 | 0 | (42) | (42) | (0,01) |
| | 09.2022 | | 834 | CLP | 774.604 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 452 | HKD | 3.536 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 675 | MXN | 13.451 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 10.2022 | | 126 | | 2.580 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 11.2022 | | 238 | ZAR | 3.740 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | | | | | | $ 4.243 | $ (2.612) | $ 1.631 | 0,37 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Partially Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | $ | 772 | AUD | 1.111 | $ 0 | $ (8) | $ (8) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 1.111 | $ | 773 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | CHF | 431 | | 447 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 3.666 | | 4.636 | 183 | 0 | 183 | 0,04 |
| | 07.2022 | $ | 1.317 | AUD | 1.897 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 43.150 | CHF | 41.234 | 0 | (79) | (79) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 430 | DKK | 3.026 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 1.897 | $ | 1.317 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 3.020 | | 430 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CHF | 228 | | 238 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK | 4.192 | | 594 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 27.170 | | 210 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 278 | CHF | 275 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 25.620 | € | 24.359 | 0 | (155) | (155) | (0,04) |
| | 07.2022 | | 62 | £ | 51 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 122 | ¥ | 16.431 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 24.002 | $ | 25.291 | 152 | 0 | 152 | 0,04 |
| BRC | 07.2022 | $ | 5.780 | ¥ | 784.014 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 782.740 | $ | 5.780 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | $ | 43.121 | CHF | 41.274 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 350 | € | 326 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | CHF | 39.675 | $ | 41.768 | 326 | 0 | 326 | 0,08 |
| | 07.2022 | $ | 6.874 | CHF | 6.593 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 41.768 | | 39.609 | 0 | (325) | (325) | (0,07) |
| JPM | 07.2022 | $ | 15 | AUD | 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 22 | $ | 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | CAD | 301 | $ | 239 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 489 | | 514 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | NOK | 5.948 | | 636 | 34 | 0 | 34 | 0,01 |
| | 07.2022 | NZD | 652 | | 425 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 07.2022 | SEK | 9.168 | | 939 | 44 | 0 | 44 | 0,01 |
| MYI | 07.2022 | ¥ | 27.789 | | 204 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07.2022 | $ | 166 | DKK | 1.166 | $ 0 | $ (2) | $ (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.157 | ¥ | 157.462 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 634 | $ | 90 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 157.207 | | 1.157 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | $ | 116 | AUD | 169 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 899 | ¥ | 122.388 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 169 | $ | 116 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 122.190 | | 899 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | € | 24.196 | | 26.006 | 711 | 0 | 711 | 0,16 |
| TOR | 07.2022 | CAD | 3.289 | | 2.575 | 25 | 0 | 25 | 0,01 |
| | 07.2022 | ¥ | 1.090.956 | | 8.595 | 566 | 0 | 566 | 0,13 |
| | 07.2022 | $ | 30 | AUD | 43 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.791 | CAD | 2.304 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 43 | $ | 30 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 2.304 | | 1.791 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | AUD | 3.260 | | 2.328 | 87 | 0 | 87 | 0,02 |
| | | | | | | $ 2.240 | $ (626) | $ 1.614 | 0,37 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Partially Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | $ | 1.504 | AUD | 2.164 | $ 0 | $ (16) | $ (16) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 2.164 | $ | 1.505 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | CHF | 2.313 | | 2.421 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 66 | | 71 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 6.930 | | 8.762 | 347 | 0 | 347 | 0,08 |
| | 07.2022 | ¥ | 16.089 | | 118 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2.565 | AUD | 3.695 | 0 | (24) | (24) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 801 | DKK | 5.632 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 3.695 | $ | 2.566 | 24 | 0 | 24 | 0,01 |
| | 08.2022 | DKK | 5.620 | | 801 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CHF | 0 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK | 6.814 | | 966 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 76.697 | | 80.671 | 489 | 0 | 489 | 0,11 |
| | 07.2022 | ¥ | 323 | | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.612 | € | 1.535 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 252 | £ | 208 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 417 | NZD | 666 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 80.745 | € | 76.629 | 0 | (486) | (486) | (0,11) |
| BRC | 07.2022 | | 10.500 | ¥ | 1.424.356 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 1.422.043 | $ | 10.500 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | € | 369 | | 396 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | $ | 2.421 | CHF | 2.300 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 08.2022 | CHF | 2.296 | $ | 2.421 | 19 | 0 | 19 | 0,01 |
| JPM | 07.2022 | $ | 30 | AUD | 43 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 43 | $ | 30 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | CAD | 565 | | 448 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 41.903 | | 44.082 | 275 | 0 | 275 | 0,06 |
| | 07.2022 | NOK | 12.705 | | 1.358 | 72 | 0 | 72 | 0,02 |
| | 07.2022 | NZD | 1.483 | | 967 | 45 | 0 | 45 | 0,01 |
| | 07.2022 | SEK | 17.060 | | 1.747 | 83 | 0 | 83 | 0,02 |
| | 07.2022 | $ | 43.845 | € | 40.657 | 0 | (1.340) | (1.340) | (0,31) |
| | 08.2022 | | 44.159 | | 41.900 | 0 | (274) | (274) | (0,06) |
| MYI | 07.2022 | | 168 | DKK | 1.182 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.101 | ¥ | 286.069 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 1.180 | $ | 168 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 285.606 | | 2.101 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | $ | 226 | AUD | 329 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.710 | ¥ | 232.822 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 183 | NOK | 1.819 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 329 | $ | 226 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 232.445 | | 1.710 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | $ | 83.589 | € | 77.771 | 0 | (2.285) | (2.285) | (0,52) |
| TOR | 07.2022 | CAD | 6.327 | $ | 4.953 | 48 | 0 | 48 | 0,01 |
| | 07.2022 | ¥ | 2.051.667 | | 16.164 | 1.064 | 0 | 1.064 | 0,24 |
| | 07.2022 | $ | 58 | AUD | 84 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 3.438 | CAD | 4.423 | 1 | (10) | (9) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 84 | $ | 58 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 4.423 | | 3.438 | 10 | (1) | 9 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | AUD | 6.349 | | 4.535 | 169 | 0 | 169 | 0,04 |
| | | | | | | $ 2.732 | $ (4.500) | $ (1.768) | (0,40) |

Zum 30. Juni 2022 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | $ | 1 | AUD | 2 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 2 | $ | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | $ | 2 | AUD | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 0 | CHF | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 0 | DKK | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 73 | £ | 58 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 3 | $ | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CHF | 2 | | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK | 7 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 0 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 43 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 0 | AUD | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 42 | € | 40 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 0 | ¥ | 30 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 39 | $ | 42 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | $ | 6 | £ | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 10 | ¥ | 1.289 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | $ | 0 | AUD | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 0 | $ | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 1.287 | $ | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | CAD | 1 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | NOK | 12 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | NZD | 1 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | SEK | 16 | | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 0 | € | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | | 0 | DKK | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 0 | £ | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2 | ¥ | 259 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 2 | $ | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 259 | | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | $ | 0 | AUD | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1 | ¥ | 201 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 0 | $ | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 201 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | € | 40 | | 43 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 56 | | 69 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1 | DKK | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 4 | $ | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 69 | £ | 56 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | CAD | 6 | $ | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 1.845 | | 15 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 0 | AUD | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 3 | CAD | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 72 | £ | 57 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 0 | $ | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 4 | | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | AUD | 6 | | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 2 | $ (5) | $ (3) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | $ | 373 | AUD | 537 | $ 0 | $ (4) | $ (4) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 537 | $ | 373 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | £ | 1.784 | | 2.255 | 89 | 0 | 89 | 0,02 |
| | 07.2022 | $ | 636 | AUD | 916 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 41 | CHF | 41 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 213 | DKK | 1.494 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 4.600 | NOK | 43.419 | 0 | (205) | (205) | (0,05) |
| | 08.2022 | AUD | 916 | $ | 636 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 1.491 | | 213 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CHF | 582 | | 607 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK | 1.808 | | 256 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 16.646 | | 129 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 12.269 | € | 11.665 | 0 | (74) | (74) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 41 | £ | 34 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 101 | ¥ | 13.562 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 11.274 | $ | 11.880 | 71 | 0 | 71 | 0,02 |
| BRC | 07.2022 | NOK | 166.704 | | 17.005 | 131 | 0 | 131 | 0,03 |
| | 07.2022 | $ | 2.728 | ¥ | 370.077 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 21.084 | NOK | 198.610 | 0 | (981) | (981) | (0,22) |
| | 08.2022 | ¥ | 369.476 | $ | 2.728 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 17.005 | NOK | 166.631 | 0 | (130) | (130) | (0,03) |
| CBK | 07.2022 | € | 272 | $ | 292 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPM | 07.2022 | $ | 7 | AUD | 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 11 | $ | 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | CAD | 148 | | 117 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | NZD | 253 | | 165 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 07.2022 | SEK | 4.239 | | 434 | 21 | 0 | 21 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 145 | NOK | 1.360 | $ 0 | $ (8) | $ (8) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | | 45 | DKK | 314 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 546 | ¥ | 74.327 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 313 | $ | 45 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 74.206 | | 546 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | $ | 7 | NOK | 74 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 56 | AUD | 81 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 424 | ¥ | 57.771 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 81 | $ | 56 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 57.677 | | 424 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | € | 11.394 | | 12.246 | 334 | 0 | 334 | 0,08 |
| TOR | 07.2022 | CAD | 1.612 | | 1.262 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 530.066 | | 4.176 | 274 | 0 | 274 | 0,06 |
| | 07.2022 | $ | 14 | AUD | 21 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 878 | CAD | 1.130 | 1 | (3) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 21 | $ | 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 1.130 | | 878 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | AUD | 1.574 | | 1.125 | 42 | 0 | 42 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 19.732 | NOK | 186.065 | 0 | (899) | (899) | (0,21) |
| | | | | | | $ 1.024 | $ (2.320) | $ (1.296) | (0,30) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **$ (1.616)** | **(0,37)** |

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.07.2037 | $ 7.000 | $ (6.536) | (1,50) |
| 2,000 % fällig am 01.07.2052 | 6.500 | (5.643) | (1,30) |
| 2,000 % fällig am 01.08.2052 | 32.450 | (28.140) | (6,46) |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 | 12.700 | (11.425) | (2,62) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (51.744)** | **(11,88)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 457.332** | **104,99** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (21.721)** | **(4,99)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 435.611** | **100,00** |

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Nullkuponwertpapier.

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

(e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(g) Mit dem Fonds verbunden.

(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(i) Eingeschränkte Wertpapiere:

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeits-datum | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Citigroup, Inc. | 3,785 % | 17.03.2033 | 10.03.2022 | $ 1.300 | $ 1.172 | 0,27 |
| Deutsche Bank AG | 3,035 | 28.05.2032 | 21.06.2021 | 1.063 | 832 | 0,19 |
| | | | | $ 2.363 | $ 2.004 | 0,46 |

(j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 27.278 und Barmittel in Höhe von USD 1.177 als Sicherheiten verpfändet.

(k) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 7.141 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 350 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 11.295 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 5,690 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 490.912 | $ 0 | $ 490.912 |
| Investmentfonds | 23.623 | 0 | 0 | 23.623 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 351 | 0 | 351 |
| Finanzderivate[3] | 1.736 | (7.546) | 0 | (5.810) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (51.744) | 0 | (51.744) |
| **Summen** | **$ 25.359** | **$ 431.973** | **$ 0** | **$ 457.332** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 587.365 | $ 0 | $ 587.365 |
| Investmentfonds | 18.823 | 0 | 0 | 18.823 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 206 | 0 | 206 |
| Finanzderivate[3] | 1.409 | (154) | 0 | 1.255 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (57.191) | 0 | (57.191) |
| **Summen** | **$ 20.232** | **$ 530.226** | **$ 0** | **$ 550.458** |

(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 2022:**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 1,530 % | 16.06.2022 | 07.07.2022 | $ (9.184) | $ (9.190) | (2,11) |
| BRC | (5,000) | 23.05.2022 | TBD[1] | € (412) | (427) | (0,10) |
| | (0,530) | 14.02.2022 | 15.08.2022 | (11.715) | (12.222) | (2,80) |
| MYI | (0,580) | 14.02.2022 | 15.08.2022 | (5.583) | (5.823) | (1,34) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (27.662)** | **(6,35)** |

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

**Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2022:**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte(1) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| MSC | 1,170 % | 02.06.2022 | 15.07.2022 | $ (6.793) | $ (6.799) | (1,56) |
| UBS | 1,230 | 10.06.2022 | 11.07.2022 | (556) | (557) | (0,13) |
| **Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte** | | | | | **$ (7.356)** | **(1,69)** |

(1) In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 3 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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ 1 | $ 0 | $ 1 |
| BOA | 1.115 | (1.270) | (155) |
| BPS | 298 | (310) | (12) |
| BRC | (1.149) | 930 | (219) |
| CBK | 164 | 0 | 164 |
| DUB | (272) | 260 | (12) |
| GLM | (1.536) | 1.730 | 194 |
| GST | (5) | 0 | (5) |
| HUS | (11) | 0 | (11) |
| IND | 66 | 0 | 66 |
| JPM | (89) | 0 | (89) |
| MBC | (1 028) | 660 | (368) |
| MSC | (1) | 0 | (1) |
| MYC | (6) | (560) | (566) |
| MYI | 462 | (480) | (18) |
| RBC | 18 | 0 | 18 |

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| RYL | $ (12) | $ 0 | $ (12) |
| SCX | 358 | (430) | (72) |
| SOG | (1.256) | 1.300 | 44 |
| SSB | 11 | 0 | 11 |
| TOR | 1.977 | (2.110) | (133) |
| UAG | (721) | 810 | 89 |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 75,05 | 86,42 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 36,30 | 25,84 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 1,35 | 0,47 |
| Investmentfonds | 5,42 | 3,61 |
| Pensionsgeschäfte | 0,08 | 0,04 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,37 | 0,29 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (1,33) | (0,36) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (0,37) | 0,31 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (11,88) | (10,98) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (6,35) | (6,80) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (1,69) | k. A. |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Argentinien | 0,02 | 0,03 |
| Australien | 3,03 | 3,10 |
| Brasilien | 1,26 | 1,12 |
| Kanada | 0,71 | 0,79 |
| Cayman-Inseln | 5,49 | 2,41 |
| Chile | 0,50 | 0,46 |
| China | 0,36 | 5,11 |
| Kolumbien | 0,02 | 0,02 |
| Tschechische Republik | 0,09 | 0,09 |
| Dänemark | 3,52 | 3,92 |
| Dominikanische Republik | 0,14 | 0,16 |
| Frankreich | 2,49 | 2,73 |
| Deutschland | 2,45 | 2,82 |
| Guatemala | 0,08 | 0,09 |
| Hongkong | 0,32 | 0,27 |
| Ungarn | k. A. | 0,09 |
| Indien | 0,21 | 0,35 |
| Indonesien | 1,04 | 1,02 |
| Irland | 5,06 | 4,54 |
| Israel | 0,89 | 1,15 |
| Italien | 7,13 | 6,69 |
| Elfenbeinküste | 0,30 | k. A. |
| Japan | 4,20 | 9,32 |
| Kuwait | k. A. | 0,82 |
| Luxemburg | 1,04 | 1,01 |
| Malaysia | 0,23 | 1,14 |
| Mexiko | 0,26 | 0,31 |
| Marokko | 0,31 | k. A. |
| Multinational | 0,30 | 0,25 |
| Niederlande | 2,77 | 1,58 |
| Neuseeland | 0,07 | 0,07 |
| Norwegen | 0,19 | 0,13 |
| Peru | 1,58 | 1,80 |
| Philippinen | 0,08 | 0,09 |
| Portugal | 0,11 | 0,10 |
| Katar | 0,41 | 0,50 |
| Rumänien | 0,59 | 0,81 |
| Russland | 0,21 | 0,90 |
| Saudi-Arabien | 0,34 | 0,86 |
| Serbien | 0,82 | 0,91 |
| Singapur | 1,87 | 1,56 |
| Slowenien | 0,18 | 0,31 |
| Südafrika | 0,37 | 0,25 |
| Südkorea | 0,72 | 0,78 |
| Spanien | 1,20 | 1,42 |
| Supranational | 0,69 | 0,67 |
| Schweiz | 1,54 | 1,23 |
| Thailand | 0,53 | k. A. |
| Vereinigte Arabische Emirate | 0,04 | 0,41 |
| Großbritannien | 12,25 | 12,51 |
| USA | 42,56 | 35,04 |
| Kurzfristige Instrumente | 2,13 | 0,99 |
| Investmentfonds | 5,42 | 3,61 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Pensionsgeschäfte | 0,08 | 0,04 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,37 | 0,29 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | 0,00 | k. A. |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf | k. A. | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,02) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | 0,11 | (0,01) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,02) | 0,00 |
| Zinsswaps — Basisswaps | 0,00 | 0,01 |
| Zinsswaps | (1,40) | (0,36) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoptionen | 0,03 | 0,01 |
| Optionen auf Wertpapiere | 0,06 | 0,02 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,01) | 0,00 |
| Devisenoptionen | k. A. | 0,00 |
| Zinsswapoptionen | (0,44) | (0,15) |
| Zinscaps | 0,00 | 0,00 |
| Optionen auf Wertpapiere | 0,00 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf | (0,02) | (0,03) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,01) | 0,00 |
| Cross-Currency Swaps | 0,00 | 0,00 |
| Zinsswaps | (0,02) | 0,04 |
| Total Return Swaps auf Wertpapiere | k. A. | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | 0,37 | (0,14) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (0,33) | 0,56 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (11,88) | (10,98) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (4,99) | (5,64) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Pepper SPARKZ Trust** | | | | |
| 2,085 % fällig am 17.08.2028 | AUD | 7.852 | $ 5.391 | 0,05 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Interstar Millennium Trust** | | | | |
| 1,520 % fällig am 27.03.2038 | | 9 | 6 | 0,00 |
| **Pepper Residential Securities Trust** | | | | |
| 2,193 % fällig am 16.09.2059 | | 6.027 | 4.135 | 0,04 |
| **RESIMAC Bastille Trust** | | | | |
| 1,733 % fällig am 05.09.2057 | $ | 2.786 | 2.786 | 0,02 |
| | | | 6.927 | 0,06 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Australia Government International Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 21.09.2026 | AUD | 146.900 | 89.943 | 0,79 |
| 1,000 % fällig am 21.12.2030 | | 14.400 | 8.022 | 0,07 |
| 1,250 % fällig am 21.05.2032 | | 13.600 | 7.499 | 0,07 |
| 1,750 % fällig am 21.06.2051 | | 25.650 | 11.222 | 0,10 |
| 2,500 % fällig am 21.05.2030 | | 17.800 | 11.335 | 0,10 |
| 4,500 % fällig am 21.04.2033 | | 49.000 | 36.144 | 0,32 |
| **Northern Territory Treasury Corp.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 21.04.2031 | | 11.200 | 6.409 | 0,06 |
| **Queensland Treasury Corp.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 21.07.2025 | | 375 | 267 | 0,00 |
| **Treasury Corp. of Victoria** | | | | |
| 4,250 % fällig am 20.12.2032 | | 25.560 | 17.504 | 0,15 |
| | | | 188.345 | 1,66 |
| Summe Australien | | | 200.663 | 1,77 |
| **ÖSTERREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Erste Group Bank AG** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.10.2027 (g)(i) | € | 9.800 | 8.104 | 0,07 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Bradesco S.A.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 27.01.2023 | $ | 300 | 299 | 0,00 |
| **Banco Votorantim S.A.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 24.09.2022 | | 200 | 200 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 24.09.2024 | | 2.200 | 2.178 | 0,02 |
| Summe Brasilien | | | 2.677 | 0,02 |
| **KANADA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bank of Montreal** | | | | |
| 0,200 % fällig am 26.01.2023 | € | 500 | 523 | 0,01 |
| 0,750 % fällig am 21.09.2022 | | 400 | 419 | 0,00 |
| **Brookfield Finance, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.04.2024 | $ | 300 | 300 | 0,00 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028 | € | 15.200 | 14.722 | 0,13 |
| **HSBC Bank Canada** | | | | |
| 1,650 % fällig am 10.09.2022 | $ | 14.900 | 14.873 | 0,13 |
| | | | 30.837 | 0,27 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Real Estate Asset Liquidity Trust** | | | | |
| 3,072 % fällig am 12.08.2053 | CAD | 1.975 | 1.518 | 0,01 |
| 3,650 % fällig am 12.08.2053 | | 7.100 | 5.295 | 0,05 |
| | | | 6.813 | 0,06 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Canada Government International Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.06.2028 | | 650 | 473 | 0,00 |
| **Canadian Government Real Return Bond** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.12.2044 (f) | | 10.106 | 7.959 | 0,07 |
| **CPPIB Capital, Inc.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 02.02.2037 | € | 2.200 | 1.773 | 0,02 |
| **Ontario Teachers' Finance Trust** | | | | |
| 0,900 % fällig am 20.05.2041 | € | 9.700 | $ 7.382 | 0,07 |
| **Province of Alberta** | | | | |
| 3,350 % fällig am 01.11.2023 | $ | 3.800 | 3.816 | 0,03 |
| **Province of Ontario** | | | | |
| 0,010 % fällig am 25.11.2030 | € | 30.200 | 26.193 | 0,23 |
| **Province of Quebec** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.09.2023 | CAD | 16.200 | 12.532 | 0,11 |
| | | | 60.128 | 0,53 |
| Summe Kanada | | | 97.778 | 0,86 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Apidos CLO** | | | | |
| 2,124 % fällig am 15.04.2031 | $ | 4.500 | 4.417 | 0,04 |
| 2,233 % fällig am 20.10.2031 | | 12.240 | 12.014 | 0,11 |
| **Atlas Senior Loan Fund Ltd.** | | | | |
| 2,194 % fällig am 16.01.2030 | | 11.575 | 11.457 | 0,10 |
| **Benefit Street Partners CLO Ltd.** | | | | |
| 2,153 % fällig am 20.04.2031 | | 8.370 | 8.197 | 0,07 |
| **BlueMountain CLO Ltd.** | | | | |
| 2,124 % fällig am 15.07.2031 | | 8.250 | 8.087 | 0,07 |
| **Carbone CLO Ltd.** | | | | |
| 2,203 % fällig am 20.01.2031 | | 6.990 | 6.857 | 0,06 |
| **Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.** | | | | |
| 2,144 % fällig am 15.10.2030 | | 2.882 | 2.845 | 0,03 |
| 2,461 % fällig am 15.05.2031 | | 5.938 | 5.817 | 0,05 |
| **Catamaran CLO Ltd.** | | | | |
| 2,236 % fällig am 22.04.2030 | | 25.768 | 25.432 | 0,23 |
| **CBAM CLO Ltd.** | | | | |
| 2,183 % fällig am 20.10.2029 | | 30.330 | 29.950 | 0,26 |
| 2,313 % fällig am 20.07.2030 | | 18.600 | 18.394 | 0,16 |
| **Deer Creek CLO Ltd.** | | | | |
| 2,243 % fällig am 20.10.2030 | | 5.500 | 5.415 | 0,05 |
| **Dryden Senior Loan Fund** | | | | |
| 2,014 % fällig am 15.04.2031 | | 10.400 | 10.148 | 0,09 |
| **Gallatin CLO Ltd.** | | | | |
| 2,148 % fällig am 21.01.2028 | | 8.025 | 7.959 | 0,07 |
| **ICG U.S. CLO Ltd.** | | | | |
| 2,216 % fällig am 22.07.2031 | | 13.700 | 13.469 | 0,12 |
| **Marble Point CLO Ltd.** | | | | |
| 2,224 % fällig am 18.12.2030 | | 15.100 | 14.817 | 0,13 |
| **Midocean Credit CLO** | | | | |
| 2,164 % fällig am 19.07.2028 | | 14.125 | 14.018 | 0,12 |
| **OZLM Ltd.** | | | | |
| 2,213 % fällig am 20.01.2031 | | 3.900 | 3.826 | 0,03 |
| 2,441 % fällig am 16.05.2030 | | 9.200 | 9.044 | 0,08 |
| **Palmer Square CLO Ltd.** | | | | |
| 2,174 % fällig am 17.01.2031 | | 3.800 | 3.741 | 0,03 |
| **Regatta Funding Ltd.** | | | | |
| 2,294 % fällig am 17.10.2030 | | 8.700 | 8.599 | 0,08 |
| **Sound Point CLO Ltd.** | | | | |
| 2,314 % fällig am 26.07.2031 | | 1.200 | 1.173 | 0,01 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | |
| 1,924 % fällig am 15.04.2027 | | 2.189 | 2.165 | 0,02 |
| 2,113 % fällig am 20.07.2030 | | 11.100 | 10.967 | 0,10 |
| | | | 238.808 | 2,11 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | |
| 2,528 % fällig am 18.11.2027 | | 431 | 352 | 0,00 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 12.07.2026 | | 1.400 | 657 | 0,01 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 26.01.2026 | | 6.700 | 6.097 | 0,06 |
| **S.A. Global Sukuk Ltd.** | | | | |
| 2,694 % fällig am 17.06.2031 | | 6.400 | 5.637 | 0,05 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 08.08.2025 | | 4.100 | 3.446 | 0,03 |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028 | | 9.300 | 7.186 | 0,06 |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,595 % fällig am 19.01.2028 | | 13.540 | 12.875 | 0,11 |
| 3,925 % fällig am 19.01.2038 | | 1.100 | 940 | 0,01 |
| | | | 37.190 | 0,33 |
| Summe Cayman Inseln | | | 275.998 | 2,44 |
| **CHINA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Sinopec Group Overseas Development Ltd.** | | | | |
| 2,300 % fällig am 08.01.2031 | $ | 750 | $ 656 | 0,01 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **China Development Bank** | | | | |
| 4,880 % fällig am 09.02.2028 | CNY | 200.100 | 32.820 | 0,29 |
| **China Government Bond** | | | | |
| 3,530 % fällig am 18.10.2051 | | 204.100 | 31.634 | 0,28 |
| 3,720 % fällig am 12.04.2051 | | 158.800 | 25.323 | 0,22 |
| 3,810 % fällig am 14.09.2050 | | 186.900 | 30.207 | 0,27 |
| | | | 119.984 | 1,06 |
| Summe China | | | 120.640 | 1,07 |
| **TSCHECHISCHE REPUBLIK** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Czech Republic Government International Bond** | | | | |
| 2,500 % fällig am 25.08.2028 | CZK | 2.900 | 106 | 0,00 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 511.618 | 54.376 | 0,48 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 626.712 | 66.441 | 0,59 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 41.585 | 4.811 | 0,04 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2037 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2037 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 0,309 % fällig am 01.10.2022 | € | 200 | 209 | 0,00 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 2.265.326 | 241.954 | 2,14 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 68.180 | 7.481 | 0,06 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 8.398 | 971 | 0,01 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2036 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 121.877 | 13.459 | 0,12 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 36.231 | 3.959 | 0,03 |
| 1,430 % fällig am 01.01.2038 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 8.804 | 1.020 | 0,01 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.04.2036 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.04.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 01.07.2046 | | 0 | 0 | 0,00 |
| Summe Dänemark | | | 394.681 | 3,48 |
| **FINNLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj** | | | | |
| 0,625 % fällig am 23.05.2025 | € | 1.000 | 1.019 | 0,01 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 1,675 % fällig am 30.06.2027 | $ | 16.200 | 14.299 | 0,13 |
| 2,219 % fällig am 09.06.2026 | | 5.200 | 4.808 | 0,04 |
| 2,591 % fällig am 20.01.2028 | | 19.553 | 17.603 | 0,16 |
| 2,871 % fällig am 19.04.2032 | | 14.000 | 11.585 | 0,10 |
| 4,400 % fällig am 14.08.2028 | | 200 | 192 | 0,00 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 2,045 % fällig am 19.10.2027 | | 9.300 | 8.211 | 0,07 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.01.2028 (d) | € | 9.100 | $ 8.576 | 0,08 |
| 0,500 % fällig am 17.01.2025 | | 15.500 | 15.840 | 0,14 |
| 0,750 % fällig am 25.01.2023 | | 24.200 | 25.363 | 0,22 |
| 3,250 % fällig am 26.09.2023 | $ | 6.100 | 6.117 | 0,05 |
| **Holding d'Infrastructures de Transport SASU** | | | | |
| 1,625 % fällig am 18.09.2029 | € | 5.500 | 4.950 | 0,04 |
| **Mutuelle Assurance Des Commercants et Industriels de France et Des Cadres et Sal** | | | | |
| 0,625 % fällig am 21.06.2027 | | 7.000 | 6.263 | 0,06 |
| 2,125 % fällig am 21.06.2052 | | 100 | 79 | 0,00 |
| **Renault S.A.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 25.05.2026 | | 4.800 | 4.314 | 0,04 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 1,488 % fällig am 14.12.2026 | $ | 21.700 | 19.174 | 0,17 |
| 2,226 % fällig am 21.01.2026 | | 24.200 | 22.577 | 0,20 |
| 2,797 % fällig am 19.01.2028 | | 17.500 | 15.641 | 0,14 |
| 6,221 % fällig am 15.06.2033 | | 20.600 | 19.684 | 0,17 |
| | | | 205.276 | 1,81 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **France Government International Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 25.05.2040 | € | 1.500 | 1.145 | 0,01 |
| 0,500 % fällig am 25.06.2044 | | 6.750 | 4.779 | 0,04 |
| 0,500 % fällig am 25.05.2072 | | 15.250 | 7.016 | 0,06 |
| 0,750 % fällig am 25.05.2052 (I) | | 115.450 | 76.701 | 0,68 |
| 2,000 % fällig am 25.05.2048 (I) | | 73.081 | 69.897 | 0,62 |
| 3,250 % fällig am 25.05.2045 (I) | | 19.100 | 22.857 | 0,20 |
| **SNCF Reseau** | | | | |
| 0,750 % fällig am 25.05.2036 | | 400 | 334 | 0,01 |
| | | | 182.729 | 1,62 |
| Summe Frankreich | | | 388.005 | 3,43 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aareal Bank AG** | | | | |
| 0,625 % fällig am 14.02.2025 | $ | 800 | 743 | 0,01 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,050 % fällig am 20.11.2024 | € | 19.600 | 19.752 | 0,17 |
| 0,750 % fällig am 17.02.2027 | | 4.600 | 4.257 | 0,04 |
| 1,000 % fällig am 19.11.2025 | | 3.800 | 3.750 | 0,03 |
| 1,375 % fällig am 03.09.2026 | | 32.100 | 31.221 | 0,28 |
| 1,375 % fällig am 17.02.2032 | | 14.300 | 11.429 | 0,10 |
| 1,625 % fällig am 20.01.2027 | | 54.400 | 51.000 | 0,45 |
| 1,750 % fällig am 19.11.2030 | | 20.500 | 17.700 | 0,16 |
| 1,875 % fällig am 23.02.2028 | | 5.900 | 5.571 | 0,05 |
| 2,625 % fällig am 16.12.2024 | £ | 23.600 | 27.308 | 0,24 |
| 3,547 % fällig am 18.09.2031 | $ | 12.700 | 10.644 | 0,09 |
| 3,729 % fällig am 14.01.2032 (k) | | 2.000 | 1.505 | 0,01 |
| 3,961 % fällig am 26.11.2025 | | 26.750 | 25.874 | 0,23 |
| 4,100 % fällig am 13.01.2026 | | 1.800 | 1.769 | 0,02 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.09.2026 (c) | € | 12.050 | 10.479 | 0,09 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK)** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.05.2027 (c) | | 3.000 | 2.454 | 0,02 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (6,000 % bar oder 6,750 % PIK)** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.05.2027 (c) | $ | 600 | 535 | 0,01 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** | | | | |
| 5,000 % fällig am 19.03.2024 | AUD | 1.500 | 1.057 | 0,01 |
| **Schaeffler AG** | | | | |
| 3,375 % fällig am 12.10.2028 | € | 100 | 85 | 0,00 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 1,250 % fällig am 01.08.2022 | | 1.100 | 1.151 | 0,01 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | | |
| 0,875 % fällig am 12.04.2023 | | 200 | 208 | 0,00 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** | | | | |
| 2,375 % fällig am 06.09.2022 | | 300 | 315 | 0,00 |
| Summe Deutschland | | | 228.807 | 2,02 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Huarong Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 30.09.2023 | $ | 14.200 | 13.533 | 0,12 |
| **Poly Real Estate Finance Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 05.02.2023 | | 6.400 | 6.392 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.** | | | | |
| 3,074 % fällig am 25.05.2023 | $ | 6.900 | $ 6.852 | 0,06 |
| 3,150 % fällig am 12.05.2025 | | 8.300 | 7.668 | 0,07 |
| Summe Hongkong | | | 34.445 | 0,30 |
| **UNGARN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Hungary Government International Bond** | | | | |
| 3,000 % fällig am 27.10.2027 | HUF | 117.500 | 241 | 0,00 |
| **INDIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Shriram Transport Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 24.10.2022 | $ | 7.700 | 7.616 | 0,07 |
| **IRLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Accunia European CLO DAC** | | | | |
| 0,950 % fällig am 15.07.2030 | € | 6.324 | 6.527 | 0,06 |
| **Adagio CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.10.2031 | | 10.250 | 10.507 | 0,09 |
| **Aqueduct European CLO DAC** | | | | |
| 0,640 % fällig am 20.07.2030 | | 14.074 | 14.500 | 0,13 |
| **Ares European CLO** | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.10.2030 | | 8.185 | 8.403 | 0,07 |
| **Ares European CLO DAC** | | | | |
| 0,610 % fällig am 15.04.2030 | | 7.027 | 7.202 | 0,06 |
| 0,660 % fällig am 15.10.2030 | | 7.486 | 7.686 | 0,07 |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | | 24.100 | 24.637 | 0,22 |
| 0,850 % fällig am 20.04.2032 | | 9.100 | 9.266 | 0,08 |
| **Armada Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.07.2031 | | 9.000 | 9.167 | 0,08 |
| **Aurium CLO DAC** | | | | |
| 0,730 % fällig am 16.01.2031 | | 28.800 | 29.582 | 0,26 |
| **Avoca CLO DAC** | | | | |
| 0,820 % fällig am 15.10.2032 | | 9.800 | 9.992 | 0,09 |
| **Bain Capital Euro DAC** | | | | |
| 0,740 % fällig am 20.01.2032 | | 12.500 | 12.680 | 0,11 |
| **Black Diamond CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 03.10.2029 | | 356 | 371 | 0,00 |
| 0,980 % fällig am 15.05.2032 | | 5.400 | 5.517 | 0,05 |
| 2,012 % fällig am 03.10.2029 | $ | 464 | 463 | 0,00 |
| **Blackrock European CLO DAC** | | | | |
| 0,620 % fällig am 15.10.2031 | € | 10.800 | 10.919 | 0,10 |
| **BlueMountain Fuji EUR CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.01.2031 | | 11.250 | 11.459 | 0,10 |
| **BNPP AM Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,820 % fällig am 22.07.2032 | | 12.700 | 12.888 | 0,11 |
| **Cairn CLO DAC** | | | | |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | | 16.400 | 16.709 | 0,15 |
| **Carlyle Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 15.08.2030 | | 7.033 | 7.209 | 0,06 |
| 0,890 % fällig am 15.08.2032 | | 3.200 | 3.246 | 0,03 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.11.2031 | | 11.500 | 11.810 | 0,10 |
| **Contego CLO DAC** | | | | |
| 0,640 % fällig am 23.01.2030 | | 6.294 | 6.469 | 0,06 |
| **CVC Cordatus Loan Fund DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 21.07.2030 | | 21.600 | 22.290 | 0,20 |
| **Dryden Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.04.2033 | | 6.600 | 6.695 | 0,06 |
| 0,860 % fällig am 15.05.2034 | | 23.450 | 23.718 | 0,21 |
| **Griffith Park CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 21.11.2031 | | 14.300 | 14.636 | 0,13 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 26.06.2030 | | 9.849 | 10.120 | 0,09 |
| 0,680 % fällig am 20.10.2031 | | 15.500 | 15.815 | 0,14 |
| 0,760 % fällig am 15.07.2031 | | 9.850 | 9.916 | 0,09 |
| 0,850 % fällig am 15.01.2032 | | 22.300 | 22.693 | 0,20 |
| **Jubilee CLO DAC** | | | | |
| 0,391 % fällig am 12.07.2028 | | 509 | 532 | 0,00 |
| 0,519 % fällig am 15.12.2029 | | 3.096 | 3.202 | 0,03 |
| 0,600 % fällig am 15.04.2030 | | 20.800 | 21.442 | 0,19 |
| 0,650 % fällig am 15.04.2031 | | 1.100 | 1.129 | 0,01 |
| **Laurelin DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 20.10.2031 | | 15.000 | 15.368 | 0,14 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Madison Park Euro Funding DAC** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.01.2032 | € | 22.900 | $ 23.182 | 0,20 |
| 0,800 % fällig am 15.07.2032 | | 7.300 | 7.398 | 0,07 |
| **Man GLG Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,810 % fällig am 15.10.2032 | | 10.300 | 10.561 | 0,09 |
| **Oak Hill European Credit Partners DAC** | | | | |
| 0,740 % fällig am 20.10.2031 | | 24.100 | 24.527 | 0,22 |
| **OCP Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,880 % fällig am 22.09.2034 | | 22.300 | 22.568 | 0,20 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.10.2031 | | 12.700 | 13.006 | 0,12 |
| 0,730 % fällig am 15.07.2031 | | 3.893 | 3.990 | 0,04 |
| 0,780 % fällig am 15.04.2031 | | 18.181 | 18.774 | 0,17 |
| **Pepper Iberia Unsecured DAC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 07.04.2028 | | 113 | 119 | 0,00 |
| **Sculptor European CLO DAC** | | | | |
| 0,790 % fällig am 14.01.2032 | | 35.800 | 36.137 | 0,32 |
| **Segovia European CLO DAC** | | | | |
| 0,880 % fällig am 20.07.2032 | | 13.700 | 13.921 | 0,12 |
| **Tikehau CLO BV** | | | | |
| 0,870 % fällig am 04.08.2034 | | 10.600 | 10.803 | 0,10 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | |
| 0,810 % fällig am 15.02.2034 | | 22.750 | 22.988 | 0,20 |
| 0,920 % fällig am 12.01.2032 | | 9.300 | 9.444 | 0,08 |
| | | | 622.183 | 5,50 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 1,650 % fällig am 29.10.2024 | $ | 5.450 | 5.038 | 0,05 |
| 1,750 % fällig am 29.10.2024 | | 5.300 | 4.895 | 0,04 |
| 2,193 % fällig am 29.09.2023 | | 7.250 | 7.152 | 0,06 |
| 2,450 % fällig am 29.10.2026 | | 200 | 174 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 29.10.2028 | | 900 | 759 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 15.01.2025 | | 1.300 | 1.243 | 0,01 |
| **AIB Group PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 12.10.2023 | | 3.900 | 3.905 | 0,03 |
| **SMBC Aviation Capital Finance DAC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.07.2022 | | 900 | 900 | 0,01 |
| | | | 24.066 | 0,21 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Bruegel DAC** | | | | |
| 0,800 % fällig am 22.05.2031 | € | 344 | 348 | 0,00 |
| **European Loan Conduit DAC** | | | | |
| 1,000 % fällig am 17.02.2030 | | 3.184 | 3.286 | 0,03 |
| | | | 3.634 | 0,03 |
| Summe Irland | | | 649.883 | 5,74 |
| **ISRAEL** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Israel Government International Bond** | | | | |
| 0,000 % fällig am 22.07.2022 (d) | | 31.900 | 33.348 | 0,29 |
| 0,750 % fällig am 31.07.2022 | ILS | 90.300 | 25.782 | 0,23 |
| 1,000 % fällig am 31.03.2030 | | 800 | 203 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 31.03.2027 | | 87.900 | 24.686 | 0,22 |
| 3,375 % fällig am 15.01.2050 | $ | 800 | 649 | 0,01 |
| 3,800 % fällig am 13.05.2060 | | 33.400 | 27.914 | 0,25 |
| 4,125 % fällig am 17.01.2048 | | 6.700 | 6.193 | 0,05 |
| Summe Israel | | | 118.775 | 1,05 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aeroporti di Roma SpA** | | | | |
| 1,750 % fällig am 30.07.2031 | € | 200 | 160 | 0,00 |
| **AMCO - Asset Management Co. SpA** | | | | |
| 0,750 % fällig am 20.04.2028 | | 300 | 271 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 17.07.2023 | | 35.500 | 37.259 | 0,33 |
| **Atlantia SpA** | | | | |
| 1,875 % fällig am 12.02.2028 | | 8.700 | 7.104 | 0,06 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 0,875 % fällig am 08.10.2027 | | 8.000 | 7.909 | 0,07 |
| 2,000 % fällig am 29.01.2024 | | 26.600 | 28.054 | 0,25 |
| 2,625 % fällig am 28.04.2025 | | 2.800 | 2.601 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 10.07.2022 (I) | | 10.300 | 10.740 | 0,10 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.09.2031 (g)(i) | € | 8.800 | $ 7.191 | 0,06 |
| 7,750 % fällig am 11.01.2027 (g)(i) | | 200 | 199 | 0,00 |
| **Nexi SpA** | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.04.2026 | | 16.700 | 14.260 | 0,13 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 2,200 % fällig am 22.07.2027 | | 4.450 | 4.251 | 0,04 |
| 7,500 % fällig am 03.06.2026 (g)(i) | | 8.400 | 8.128 | 0,07 |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | $ | 26.210 | 27.151 | 0,24 |
| | | | 155.278 | 1,37 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Italy Government International Bond** | | | | |
| 6,000 % fällig am 04.08.2028 | £ | 5.684 | 7.707 | 0,07 |
| Summe Italien | | | 162.985 | 1,44 |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Mitsubishi Corp.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 14.07.2022 | $ | 400 | 400 | 0,00 |
| **Mitsubishi HC Capital, Inc.** | | | | |
| 2,652 % fällig am 19.09.2022 | | 5.100 | 5.100 | 0,05 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | |
| 1,412 % fällig am 17.07.2025 | | 29.800 | 27.403 | 0,24 |
| 2,193 % fällig am 25.02.2025 | | 33.700 | 32.026 | 0,28 |
| 3,455 % fällig am 02.03.2023 | | 24.400 | 24.442 | 0,22 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | |
| 1,241 % fällig am 10.07.2024 | | 9.000 | 8.754 | 0,08 |
| 2,154 % fällig am 25.05.2024 | | 13.100 | 12.961 | 0,11 |
| 2,721 % fällig am 16.07.2023 | | 19.600 | 19.601 | 0,17 |
| 2,721 % fällig am 11.09.2024 | | 13.000 | 12.984 | 0,12 |
| 3,549 % fällig am 05.03.2023 | | 19.900 | 19.965 | 0,18 |
| 3,922 % fällig am 11.09.2024 | | 11.000 | 10.973 | 0,10 |
| **Nissan Motor Co. Ltd.** | | | | |
| 3,043 % fällig am 15.09.2023 | | 11.800 | 11.608 | 0,10 |
| 3,522 % fällig am 17.09.2025 | | 18.800 | 17.816 | 0,16 |
| 4,345 % fällig am 17.09.2027 | | 17.500 | 16.078 | 0,14 |
| 4,810 % fällig am 17.09.2030 | | 18.200 | 16.186 | 0,14 |
| **Nomura Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,329 % fällig am 22.01.2027 | | 11.100 | 9.837 | 0,09 |
| **Panasonic Holdings Corp.** | | | | |
| 2,536 % fällig am 19.07.2022 | | 7.000 | 6.999 | 0,06 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,010 % fällig am 10.09.2025 | € | 43.700 | 43.179 | 0,38 |
| 0,409 % fällig am 07.11.2029 | | 26.500 | 24.183 | 0,21 |
| 0,550 % fällig am 06.11.2023 | | 35.700 | 36.985 | 0,33 |
| 2,014 % fällig am 07.11.2022 | $ | 46.200 | 46.103 | 0,41 |
| 2,440 % fällig am 18.06.2024 | | 26.400 | 25.933 | 0,23 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | |
| 1,904 % fällig am 19.07.2023 | | 31.100 | 31.074 | 0,27 |
| 3,748 % fällig am 19.07.2023 | | 23.700 | 23.805 | 0,21 |
| **Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.** | | | | |
| 0,010 % fällig am 15.10.2027 | € | 34.800 | 32.591 | 0,29 |
| | | | 516.986 | 4,57 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Development Bank of Japan, Inc.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 28.08.2024 | $ | 13.400 | 12.999 | 0,11 |
| 1,875 % fällig am 02.10.2024 | | 12.800 | 12.427 | 0,11 |
| **Japan Finance Organization for Municipalities** | | | | |
| 0,625 % fällig am 02.09.2025 | | 1.400 | 1.282 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 12.03.2024 | | 13.300 | 13.242 | 0,12 |
| 3,375 % fällig am 27.09.2023 | | 20.000 | 20.033 | 0,18 |
| **Japan Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 10.03.2028 (f) | ¥ | 10.326.576 | 79.888 | 0,71 |
| 0,200 % fällig am 20.06.2036 | | 362.750 | 2.537 | 0,02 |
| 0,500 % fällig am 20.09.2046 | | 9.268.000 | 60.161 | 0,53 |
| 0,500 % fällig am 20.03.2049 | | 12.188.000 | 76.313 | 0,67 |
| 0,600 % fällig am 20.06.2037 | | 120.000 | 879 | 0,01 |
| 0,700 % fällig am 20.12.2048 | | 8.791.650 | 58.213 | 0,51 |
| 0,700 % fällig am 20.06.2051 | | 202.000 | 1.306 | 0,01 |
| 1,300 % fällig am 20.06.2035 | | 4.810.000 | 38.902 | 0,34 |
| 1,600 % fällig am 20.03.2033 | | 1.089.900 | 9.063 | 0,08 |
| 1,750 % fällig am 17.10.2024 | $ | 6.600 | 6.399 | 0,06 |
| **Tokyo Metropolitan Government** | | | | |
| 0,750 % fällig am 16.07.2025 | $ | 18.600 | $ 17.129 | 0,15 |
| 2,625 % fällig am 29.05.2024 | | 4.100 | 4.037 | 0,04 |
| | | | 414.810 | 3,66 |
| Summe Japan | | | 931.796 | 8,23 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 11.09.2025 | € | 10.000 | 9.582 | 0,08 |
| **KASACHSTAN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Kazakhstan Government International Bond** | | | | |
| 5,125 % fällig am 21.07.2025 | $ | 600 | 622 | 0,01 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 16.07.2026 (d) | € | 11.000 | 9.353 | 0,08 |
| 0,375 % fällig am 15.04.2027 | | 1.700 | 1.388 | 0,01 |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | $ | 2.700 | 2.502 | 0,02 |
| **CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund** | | | | |
| 0,900 % fällig am 12.10.2029 | € | 200 | 166 | 0,00 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 23.04.2027 | | 14.500 | 12.128 | 0,11 |
| 1,750 % fällig am 14.01.2030 | | 10.400 | 7.707 | 0,07 |
| 2,750 % fällig am 12.05.2026 | | 1.400 | 1.304 | 0,01 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 0,625 % fällig am 17.11.2025 | | 4.600 | 4.296 | 0,04 |
| 0,750 % fällig am 15.07.2024 | | 10.900 | 10.812 | 0,10 |
| 2,250 % fällig am 13.05.2025 | | 2.000 | 1.997 | 0,02 |
| **Medtronic Global Holdings S.C.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 02.12.2022 (d) | | 8.100 | 8.462 | 0,07 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 29.10.2022 ^ | $ | 500 | 35 | 0,00 |
| | | | 60.150 | 0,53 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Miravet SARL** | | | | |
| 0,494 % fällig am 26.05.2065 | € | 15.602 | 16.359 | 0,15 |
| Summe Luxemburg | | | 76.509 | 0,68 |
| **MALAYSIA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Petronas Capital Ltd.** | | | | |
| 2,480 % fällig am 28.01.2032 | $ | 5.500 | 4.690 | 0,04 |
| 3,500 % fällig am 21.04.2030 | | 8.600 | 8.098 | 0,07 |
| 4,550 % fällig am 21.04.2050 | | 6.100 | 5.839 | 0,05 |
| 4,800 % fällig am 21.04.2060 | | 5.000 | 4.905 | 0,05 |
| | | | 23.532 | 0,21 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Malaysia Government International Bond** | | | | |
| 4,065 % fällig am 15.06.2050 | MYR | 17.700 | 3.483 | 0,03 |
| **Malaysia Government Investment Issue** | | | | |
| 4,369 % fällig am 31.10.2028 | | 258.020 | 59.081 | 0,52 |
| | | | 62.564 | 0,55 |
| Summe Malaysia | | | 86.096 | 0,76 |
| **MAURITIUS** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Greenko Solar Mauritius Ltd.** | | | | |
| 5,550 % fällig am 29.01.2025 | $ | 5.500 | 5.170 | 0,05 |
| **MEXIKO** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.03.2115 | € | 800 | 595 | 0,01 |
| 5,000 % fällig am 27.04.2051 | $ | 7.800 | 6.502 | 0,05 |
| 10,000 % fällig am 05.12.2024 | MXN | 130.573 | 6.563 | 0,06 |
| Summe Mexiko | | | 13.660 | 0,12 |
| **MULTINATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Preferred Term Securities Ltd.** | | | | |
| 2,139 % fällig am 22.12.2036 | $ | 9.235 | $ 8.576 | 0,07 |
| 2,229 % fällig am 22.03.2038 | | 3.264 | 3.032 | 0,03 |
| Summe multinational | | | 11.608 | 0,10 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | |
| 1,125 % fällig am 12.01.2032 | € | 300 | 284 | 0,00 |
| **Aegon Bank NV** | | | | |
| 0,625 % fällig am 21.06.2024 | | 4.800 | 4.860 | 0,04 |
| **Airbus SE** | | | | |
| 2,375 % fällig am 09.06.2040 | | 400 | 347 | 0,00 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 3,057 % fällig am 26.09.2023 | $ | 2.000 | 2.010 | 0,02 |
| 3,250 % fällig am 29.12.2026 (g)(i) | € | 2.000 | 1.715 | 0,02 |
| 3,649 % fällig am 06.04.2028 | $ | 13.000 | 12.358 | 0,11 |
| 3,758 % fällig am 06.04.2033 | | 4.050 | 3.659 | 0,03 |
| 4,375 % fällig am 29.06.2027 (g)(i) | € | 11.800 | 10.883 | 0,10 |
| **CTP NV** | | | | |
| 0,625 % fällig am 27.09.2026 | | 10.500 | 8.772 | 0,08 |
| 0,875 % fällig am 20.01.2026 | | 14.100 | 12.346 | 0,11 |
| 1,500 % fällig am 27.09.2031 | | 6.500 | 4.122 | 0,04 |
| **E.ON International Finance BV** | | | | |
| 5,625 % fällig am 06.12.2023 | £ | 400 | 501 | 0,00 |
| **Enel Finance International NV** | | | | |
| 0,000 % fällig am 28.05.2026 (d) | € | 5.300 | 4.979 | 0,04 |
| 0,375 % fällig am 28.05.2029 | | 2.600 | 2.227 | 0,02 |
| 0,875 % fällig am 28.09.2034 | | 100 | 73 | 0,00 |
| 1,875 % fällig am 12.07.2028 | $ | 2.500 | 2.099 | 0,02 |
| 2,250 % fällig am 12.07.2031 | | 400 | 314 | 0,00 |
| 2,650 % fällig am 10.09.2024 | | 25.800 | 25.014 | 0,22 |
| **IMCD NV** | | | | |
| 2,500 % fällig am 26.03.2025 | € | 200 | 195 | 0,00 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 3,285 % fällig am 02.10.2023 | $ | 2.400 | 2.408 | 0,02 |
| 4,100 % fällig am 02.10.2023 | | 2.600 | 2.609 | 0,02 |
| 4,875 % fällig am 16.05.2029 (g)(i) | | 35.900 | 29.417 | 0,26 |
| 5,750 % fällig am 16.11.2026 (g)(i) | | 20.400 | 18.683 | 0,17 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 0,125 % fällig am 13.09.2023 | € | 13.400 | 13.690 | 0,12 |
| 1,000 % fällig am 02.05.2023 | | 300 | 312 | 0,00 |
| **Sagax Euro MTN NL BV** | | | | |
| 1,625 % fällig am 24.02.2026 | | 11.900 | 11.352 | 0,10 |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | |
| 6,500 % (g) | | 3.324 | 3.384 | 0,03 |
| **Volkswagen Financial Services NV** | | | | |
| 0,875 % fällig am 20.02.2025 | £ | 2.800 | 3.123 | 0,03 |
| 1,125 % fällig am 18.09.2023 | | 9.600 | 11.273 | 0,10 |
| 1,625 % fällig am 30.11.2022 | | 11.500 | 13.882 | 0,12 |
| **Volkswagen International Finance NV** | | | | |
| 1,125 % fällig am 02.10.2023 | € | 4.100 | 4.245 | 0,04 |
| 1,144 % fällig am 16.11.2024 | | 24.400 | 26.066 | 0,23 |
| | | | 237.202 | 2,09 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Domi BV** | | | | |
| 0,569 % fällig am 15.06.2051 | | 160 | 167 | 0,00 |
| **Dutch Property Finance BV** | | | | |
| 0,215 % fällig am 28.04.2051 | | 316 | 329 | 0,00 |
| 0,235 % fällig am 28.07.2054 | | 322 | 334 | 0,00 |
| 0,235 % fällig am 28.07.2058 | | 18.061 | 18.727 | 0,17 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 1,052 % fällig am 17.10.2040 | | 84 | 88 | 0,00 |
| **Jubilee Place BV** | | | | |
| 0,382 % fällig am 17.07.2058 | | 12.918 | 13.395 | 0,12 |
| 0,552 % fällig am 17.10.2057 | | 8.220 | 8.485 | 0,08 |
| | | | 41.525 | 0,37 |
| Summe Niederlande | | | 278.727 | 2,46 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **NEUSEELAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Auckland Council** | | | | |
| 1,000 % fällig am 19.01.2027 | € | 5.800 | $ 5.864 | 0,05 |
| **New Zealand Government International Bond** | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.05.2031 | NZD | 22.600 | 11.605 | 0,10 |
| 2,000 % fällig am 20.09.2025 | | 1.196 | 761 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 15.04.2023 | | 9.063 | 5.730 | 0,05 |
| Summe Neuseeland | | | 23.960 | 0,21 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **DNB Boligkreditt A/S** | | | | |
| 3,250 % fällig am 28.06.2023 | $ | 4.600 | 4.597 | 0,04 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Kommunalbanken A/S** | | | | |
| 0,625 % fällig am 20.04.2026 | € | 600 | 604 | 0,01 |
| 1,900 % fällig am 19.01.2027 | AUD | 22.000 | 13.665 | 0,12 |
| 5,250 % fällig am 15.07.2024 | | 3.300 | 2.336 | 0,02 |
| **Norway Government International Bond** | | | | |
| 1,250 % fällig am 17.09.2031 | NOK | 1.900 | 165 | 0,00 |
| 1,750 % fällig am 13.03.2025 | | 86.700 | 8.513 | 0,07 |
| 1,750 % fällig am 17.02.2027 | | 1.100 | 106 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 26.04.2028 | | 7.300 | 700 | 0,01 |
| | | | 26.089 | 0,23 |
| Summe Norwegen | | | 30.686 | 0,27 |
| **PERU** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 2,780 % fällig am 01.12.2060 | $ | 6.000 | 3.729 | 0,04 |
| 3,230 % fällig am 28.07.2121 | | 4.200 | 2.587 | 0,02 |
| 5,350 % fällig am 12.08.2040 | PEN | 33.400 | 6.588 | 0,06 |
| 5,400 % fällig am 12.08.2034 | | 31.100 | 6.611 | 0,06 |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | | 89.600 | 21.553 | 0,19 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 97.648 | 22.735 | 0,20 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 | | 292.800 | 72.664 | 0,64 |
| 6,950 % fällig am 12.08.2031 | | 700 | 175 | 0,00 |
| Summe Peru | | | 136.642 | 1,21 |
| **PORTUGAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Espirito Santo S.A.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 21.01.2019 ^ | € | 6.900 | 1.262 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2018 ^ | | 1.900 | 348 | 0,00 |
| Summe Portugal | | | 1.610 | 0,01 |
| **KATAR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Qatar Energy** | | | | |
| 2,250 % fällig am 12.07.2031 | $ | 8.000 | 6.847 | 0,06 |
| 3,125 % fällig am 12.07.2041 | | 9.400 | 7.395 | 0,07 |
| 3,300 % fällig am 12.07.2051 | | 11.400 | 8.830 | 0,08 |
| | | | 23.072 | 0,21 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 4,400 % fällig am 16.04.2050 | | 7.600 | 7.273 | 0,06 |
| 4,817 % fällig am 14.03.2049 | | 17.900 | 18.063 | 0,16 |
| | | | 25.336 | 0,22 |
| Summe Katar | | | 48.408 | 0,43 |
| **RUMÄNIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Romania Government International Bond** | | | | |
| 1,375 % fällig am 02.12.2029 | € | 6.560 | 4.967 | 0,04 |
| 1,750 % fällig am 13.07.2030 | | 16.600 | 12.406 | 0,11 |
| 2,000 % fällig am 28.01.2032 (l) | | 1.000 | 716 | 0,01 |
| 2,000 % fällig am 14.04.2033 | | 2.150 | 1.463 | 0,01 |
| 2,124 % fällig am 16.07.2031 | | 2.600 | 1.930 | 0,02 |
| 2,125 % fällig am 07.03.2028 | | 9.800 | 8.456 | 0,08 |
| 2,625 % fällig am 02.12.2040 | | 7.400 | 4.509 | 0,04 |
| 2,750 % fällig am 14.04.2041 | | 7.000 | 4.290 | 0,04 |
| 2,875 % fällig am 13.04.2042 | | 17.300 | 10.618 | 0,09 |
| Summe Rumänien | | | 49.355 | 0,44 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **SAUDI-ARABIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Saudi Arabian Oil Co.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 24.11.2030 | $ | 10.600 | $ 9.046 | 0,08 |
| 3,250 % fällig am 24.11.2050 | | 8.700 | 6.339 | 0,05 |
| 3,500 % fällig am 24.11.2070 | | 2.900 | 2.063 | 0,02 |
| | | | 17.448 | 0,15 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Saudi Arabia Government International Bond** | | | | |
| 4,375 % fällig am 16.04.2029 | | 1.700 | 1.727 | 0,02 |
| Summe Saudi-Arabien | | | 19.175 | 0,17 |
| **SERBIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Serbia Government International Bond** | | | | |
| 1,000 % fällig am 23.09.2028 | € | 16.750 | 12.793 | 0,11 |
| 1,650 % fällig am 03.03.2033 | | 12.300 | 8.096 | 0,07 |
| 2,050 % fällig am 23.09.2036 | | 6.700 | 4.145 | 0,04 |
| Summe Serbien | | | 25.034 | 0,22 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 18.09.2022 | $ | 4.200 | 4.196 | 0,04 |
| **United Overseas Bank Ltd.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 05.09.2022 | | 500 | 500 | 0,00 |
| | | | 4.696 | 0,04 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Singapore Government International Bond** | | | | |
| 1,625 % fällig am 01.07.2031 | SGD | 146.048 | 93.994 | 0,83 |
| 2,875 % fällig am 01.09.2030 | | 119.970 | 85.801 | 0,76 |
| | | | 179.795 | 1,59 |
| Summe Singapur | | | 184.491 | 1,63 |
| **SLOWENIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Nova Kreditna Banka Maribor d.d.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 27.01.2025 | € | 11.200 | 11.060 | 0,09 |
| **Nova Ljubljanska Banka d.d.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 05.02.2030 | | 3.500 | 3.220 | 0,03 |
| 3,650 % fällig am 19.11.2029 | | 8.300 | 7.723 | 0,07 |
| Summe Slowenien | | | 22.003 | 0,19 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 4,850 % fällig am 30.09.2029 | $ | 4.700 | 4.027 | 0,04 |
| 7,750 % fällig am 28.02.2023 | ZAR | 4.275 | 263 | 0,00 |
| 8,750 % fällig am 28.02.2048 | | 2.125 | 100 | 0,00 |
| Summe Südafrika | | | 4.390 | 0,04 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **South Korea Government International Bond** | | | | |
| 2,125 % fällig am 10.06.2027 | KRW | 16.365.000 | 11.764 | 0,10 |
| 2,375 % fällig am 10.12.2027 | | 14.900.000 | 10.768 | 0,10 |
| 2,375 % fällig am 10.12.2028 | | 69.980.000 | 50.081 | 0,44 |
| 2,625 % fällig am 10.06.2028 | | 32.730.000 | 23.874 | 0,21 |
| 5,500 % fällig am 10.03.2028 | | 14.900.000 | 12.572 | 0,11 |
| Summe Südkorea | | | 109.059 | 0,96 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **BBVA Consumer Auto** | | | | |
| 0,270 % fällig am 20.07.2031 | € | 11.936 | 12.303 | 0,11 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (g)(i) | | 10.400 | 10.470 | 0,09 |
| 6,000 % fällig am 29.03.2024 (g) | | 0 | 0 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 1,849 % fällig am 25.03.2026 | $ | 5.800 | $ 5.222 | 0,05 |
| 4,175 % fällig am 24.03.2028 | | 7.800 | 7.449 | 0,07 |
| 4,375 % fällig am 14.01.2026 (g)(i) | € | 2.800 | 2.471 | 0,02 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 24.10.2023 | | 10.400 | 10.821 | 0,09 |
| 5,875 % fällig am 09.10.2027 (g)(i) | | 4.000 | 3.688 | 0,03 |
| | | | 40.121 | 0,35 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Fondo de Titulizacion de Activos Santander Hipotecario** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.07.2042 | | 379 | 396 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 18.01.2049 | | 534 | 551 | 0,01 |
| **Fondo de Titulizacion de Activos UCI** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.09.2041 | | 966 | 984 | 0,01 |
| **IM Pastor Fondo de Titluzacion Hipotecaria** | | | | |
| 0,002 % fällig am 22.09.2041 | | 1 | 1 | 0,00 |
| | | | 1.932 | 0,02 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 4,220 % fällig am 26.04.2035 | | 3.900 | 4.412 | 0,04 |
| **Autonomous Community of Madrid** | | | | |
| 1,571 % fällig am 30.04.2029 | | 1.300 | 1.313 | 0,01 |
| **Spain Government International Bond** | | | | |
| 1,450 % fällig am 31.10.2071 | | 7.375 | 4.320 | 0,04 |
| 1,900 % fällig am 31.10.2052 | | 2.700 | 2.123 | 0,02 |
| 3,450 % fällig am 30.07.2066 | | 53.300 | 58.034 | 0,51 |
| 5,250 % fällig am 06.04.2029 | £ | 800 | 1.104 | 0,01 |
| | | | 71.306 | 0,63 |
| Summe Spanien | | | 125.662 | 1,11 |
| **SUPRANATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.09.2023 | AUD | 5.400 | 3.587 | 0,03 |
| 0,500 % fällig am 21.12.2023 | | 4.000 | 2.624 | 0,02 |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | |
| 0,500 % fällig am 10.08.2023 | | 10.200 | 6.801 | 0,06 |
| 4,600 % fällig am 30.01.2037 | CAD | 1.050 | 842 | 0,01 |
| **Inter-American Development Bank** | | | | |
| 2,500 % fällig am 14.04.2027 | AUD | 15.200 | 9.690 | 0,09 |
| Summe Supranational | | | 23.544 | 0,21 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Molnlycke Holding AB** | | | | |
| 1,875 % fällig am 28.02.2025 | € | 400 | 410 | 0,00 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,250 % fällig am 05.01.2026 | | 11.800 | 11.068 | 0,10 |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (i) | $ | 30.906 | 30.983 | 0,27 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 2,193 % fällig am 05.06.2026 | | 400 | 363 | 0,00 |
| 2,875 % fällig am 02.04.2032 | € | 19.700 | 17.351 | 0,15 |
| 3,091 % fällig am 14.05.2032 | $ | 16.700 | 13.307 | 0,12 |
| 3,800 % fällig am 09.06.2023 | | 13.250 | 13.131 | 0,12 |
| 3,869 % fällig am 12.01.2029 | | 12.550 | 11.290 | 0,10 |
| 4,194 % fällig am 01.04.2031 | | 1.600 | 1.417 | 0,01 |
| 4,550 % fällig am 17.04.2026 | | 400 | 392 | 0,00 |
| 7,250 % fällig am 12.09.2025 (g)(i) | | 1.200 | 1.043 | 0,01 |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (g)(i) | | 3.300 | 3.053 | 0,03 |
| **UBS AG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (i) | | 14.550 | 14.547 | 0,13 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (i) | | 7.625 | 7.648 | 0,07 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 4,488 % fällig am 12.05.2026 | | 5.600 | 5.586 | 0,05 |
| 4,751 % fällig am 12.05.2028 | | 2.600 | 2.576 | 0,02 |
| Summe Schweiz | | | 133.755 | 1,18 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **THAILAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Thailand Government International Bond** | | | | |
| 1,585 % fällig am 17.12.2035 | THB | 2.670.500 | $ 61.219 | 0,54 |
| 3,300 % fällig am 17.06.2038 | | 280.500 | 7.637 | 0,07 |
| Summe Thailand | | | 68.856 | 0,61 |
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **MDGH GMTN RSC Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 21.05.2030 | $ | 6.400 | 5.762 | 0,05 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Emirate of Abu Dhabi Government International Bond** | | | | |
| 2,500 % fällig am 11.10.2022 | | 600 | 600 | 0,01 |
| 3,125 % fällig am 30.09.2049 | | 9.100 | 7.087 | 0,06 |
| 3,875 % fällig am 16.04.2050 | | 10.500 | 9.354 | 0,08 |
| | | | 17.041 | 0,15 |
| Summe Vereinigte Arabische Emirate | | | 22.803 | 0,20 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Bumper UK Finance PLC** | | | | |
| 1,540 % fällig am 20.12.2028 | £ | 80 | 97 | 0,00 |
| **PCL Funding PLC** | | | | |
| 1,690 % fällig am 15.10.2025 | | 400 | 482 | 0,01 |
| 1,990 % fällig am 15.09.2024 | | 22.600 | 27.441 | 0,24 |
| | | | 28.020 | 0,25 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Annington Funding PLC** | | | | |
| 1,650 % fällig am 12.07.2024 | € | 100 | 102 | 0,00 |
| **AstraZeneca PLC** | | | | |
| 2,109 % fällig am 17.08.2023 | $ | 400 | 400 | 0,00 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (i) | | 69.391 | 70.088 | 0,62 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 06.10.2023 | £ | 6.260 | 7.584 | 0,07 |
| 2,791 % fällig am 16.05.2024 | $ | 6.800 | 6.799 | 0,06 |
| 3,125 % fällig am 17.01.2024 | £ | 800 | 958 | 0,01 |
| 3,917 % fällig am 26.06.2024 | AUD | 4.000 | 2.803 | 0,02 |
| 4,338 % fällig am 16.05.2024 | $ | 1.200 | 1.200 | 0,01 |
| 4,375 % fällig am 12.01.2026 | | 2.200 | 2.181 | 0,02 |
| 6,375 % fällig am 15.12.2025 (g)(i) | £ | 4.300 | 4.819 | 0,04 |
| 7,125 % fällig am 15.06.2025 (g)(i) | | 3.900 | 4.556 | 0,04 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (g)(i) | | 2.800 | 3.352 | 0,03 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (g)(i) | $ | 2.100 | 2.069 | 0,02 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2022 (g)(i) | £ | 900 | 1.091 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 15.06.2024 (g)(i) | $ | 8.200 | 8.077 | 0,07 |
| **British Telecommunications PLC** | | | | |
| 9,625 % fällig am 15.12.2030 | | 708 | 882 | 0,01 |
| **Grainger PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 24.04.2028 | £ | 1.400 | 1.534 | 0,01 |
| **GSK Consumer Healthcare Capital UK PLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 24.03.2025 | $ | 16.600 | 16.187 | 0,14 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 04.12.2024 | € | 500 | 518 | 0,00 |
| 2,100 % fällig am 16.02.2024 | AUD | 4.000 | 2.749 | 0,02 |
| 2,455 % fällig am 18.05.2024 | $ | 6.900 | 6.846 | 0,06 |
| 2,848 % fällig am 04.06.2031 | | 9.900 | 8.374 | 0,07 |
| 2,999 % fällig am 10.03.2026 | | 1.300 | 1.239 | 0,01 |
| 3,019 % fällig am 15.06.2027 | € | 19.400 | 20.046 | 0,18 |
| 3,950 % fällig am 18.05.2024 | $ | 800 | 797 | 0,01 |
| 3,973 % fällig am 22.05.2030 | | 21.700 | 19.951 | 0,18 |
| 4,041 % fällig am 13.03.2028 | | 7.300 | 6.938 | 0,06 |
| 4,583 % fällig am 19.06.2029 | | 19.600 | 18.914 | 0,17 |
| 4,755 % fällig am 09.06.2028 | | 11.200 | 10.898 | 0,10 |
| 4,950 % fällig am 31.03.2030 | | 2.900 | 2.868 | 0,03 |
| 5,250 % fällig am 16.09.2022 (g)(i) | € | 200 | 207 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 23.03.2028 (g)(i) | $ | 1.300 | $ 1.181 | 0,01 |
| **Jaguar Land Rover Automotive PLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.11.2026 | € | 11.200 | 10.313 | 0,09 |
| **John Lewis PLC** | | | | |
| 6,125 % fällig am 21.01.2025 | £ | 100 | 126 | 0,00 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 3,574 % fällig am 07.11.2028 | $ | 3.700 | 3.465 | 0,03 |
| 4,650 % fällig am 24.03.2026 | | 12.401 | 12.171 | 0,11 |
| 4,947 % fällig am 27.06.2025 (g)(i) | € | 300 | 295 | 0,00 |
| 7,500 % fällig am 27.09.2025 (g)(i) | $ | 7.965 | 7.783 | 0,07 |
| 7,875 % fällig am 27.06.2029 (g)(i) | £ | 4.780 | 5.748 | 0,05 |
| **Marks & Spencer PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 19.05.2026 | | 4.895 | 5.233 | 0,05 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 1,700 % fällig am 13.02.2023 | $ | 11.700 | 11.604 | 0,10 |
| 2,972 % fällig am 16.02.2028 | | 8.800 | 8.040 | 0,07 |
| 3,766 % fällig am 08.03.2024 | | 400 | 399 | 0,00 |
| 4,363 % fällig am 01.08.2024 | | 11.200 | 11.217 | 0,10 |
| 5,750 % fällig am 20.06.2027 (g)(i) | £ | 7.800 | 8.492 | 0,08 |
| 5,875 % fällig am 20.12.2024 (g)(i) | | 200 | 231 | 0,00 |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 22.03.2023 | € | 1.700 | 1.794 | 0,02 |
| 3,875 % fällig am 12.09.2023 | $ | 5.000 | 4.987 | 0,04 |
| 4,445 % fällig am 08.05.2030 | | 4.775 | 4.500 | 0,04 |
| 5,076 % fällig am 27.01.2030 | | 19.200 | 18.813 | 0,17 |
| 6,000 % fällig am 29.12.2025 (g)(i) | | 11.900 | 11.042 | 0,10 |
| 8,000 % fällig am 10.08.2025 (g)(i) | | 2.300 | 2.282 | 0,02 |
| **NatWest Markets PLC** | | | | |
| 1,000 % fällig am 28.05.2024 | € | 7.721 | 7.904 | 0,07 |
| **Prudential PLC** | | | | |
| 2,950 % fällig am 03.11.2033 | $ | 24.600 | 20.752 | 0,18 |
| **Rolls-Royce PLC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 14.10.2025 | | 200 | 179 | 0,00 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 3,373 % fällig am 05.01.2024 | | 7.000 | 6.969 | 0,06 |
| 4,750 % fällig am 15.09.2025 | | 600 | 593 | 0,01 |
| 4,796 % fällig am 15.11.2024 | | 20.100 | 20.111 | 0,18 |
| **Santander UK PLC** | | | | |
| 1,626 % fällig am 12.02.2027 | £ | 16.900 | 20.507 | 0,18 |
| 5,000 % fällig am 07.11.2023 | $ | 1.338 | 1.349 | 0,01 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 0,991 % fällig am 12.01.2025 | | 13.400 | 12.667 | 0,11 |
| 1,456 % fällig am 14.01.2027 | | 13.700 | 12.098 | 0,11 |
| 1,822 % fällig am 23.11.2025 | | 28.100 | 26.044 | 0,23 |
| 2,608 % fällig am 12.01.2028 | | 12.700 | 11.353 | 0,10 |
| 2,678 % fällig am 29.06.2032 | | 600 | 482 | 0,00 |
| **Tesco Corporate Treasury Services PLC** | | | | |
| 1,375 % fällig am 24.10.2023 | € | 8.900 | 9.252 | 0,08 |
| **Tesco Property Finance PLC** | | | | |
| 5,411 % fällig am 13.07.2044 | £ | 1.106 | 1.362 | 0,01 |
| 5,661 % fällig am 13.10.2041 | | 677 | 854 | 0,01 |
| 5,744 % fällig am 13.04.2040 | | 651 | 834 | 0,01 |
| 5,801 % fällig am 13.10.2040 | | 7.788 | 10.002 | 0,09 |
| **TP ICAP Finance PLC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 18.11.2028 | | 9.800 | 9.812 | 0,09 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.04.2027 | | 5.900 | 6.511 | 0,06 |
| **Virgin Money UK PLC** | | | | |
| 0,375 % fällig am 27.05.2024 | € | 6.500 | 6.668 | 0,06 |
| | | | 551.046 | 4,87 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Alba PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.12.2038 | | 112 | 111 | 0,00 |
| 1,049 % fällig am 15.12.2038 | £ | 5.146 | 6.000 | 0,05 |
| **Avon Finance PLC** | | | | |
| 1,690 % fällig am 20.09.2048 | | 25.114 | 30.346 | 0,27 |
| **Brass PLC** | | | | |
| 0,871 % fällig am 16.11.2066 | | 5.651 | 6.855 | 0,06 |
| **Business Mortgage Finance PLC** | | | | |
| 3,282 % fällig am 15.02.2041 | | 32 | 39 | 0,00 |
| **Canada Square Funding PLC** | | | | |
| 1,550 % fällig am 17.10.2051 | | 14.481 | 17.572 | 0,16 |
| 1,550 % fällig am 17.06.2058 | | 20.565 | 24.491 | 0,22 |
| 1,720 % fällig am 17.06.2058 | | 364 | 436 | 0,00 |
| 2,020 % fällig am 17.12.2057 | | 5.671 | 6.808 | 0,06 |
| **Eurohome UK Mortgages PLC** | | | | |
| 1,739 % fällig am 15.06.2044 | £ | 200 | $ 237 | 0,00 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 10.12.2044 | € | 19 | 20 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 15.12.2044 | | 200 | 205 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 13.03.2045 | | 442 | 445 | 0,00 |
| 1,698 % fällig am 10.12.2044 | £ | 39 | 47 | 0,00 |
| 1,740 % fällig am 13.03.2045 | | 89 | 107 | 0,00 |
| 2,290 % fällig am 13.09.2045 | | 1.088 | 1.284 | 0,01 |
| 2,540 % fällig am 13.06.2045 | | 57 | 68 | 0,00 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | |
| 1,565 % fällig am 16.03.2070 | | 877 | 1.059 | 0,01 |
| 1,775 % fällig am 16.12.2069 | | 3.857 | 4.663 | 0,04 |
| 1,795 % fällig am 16.09.2069 | | 8.994 | 10.912 | 0,10 |
| 2,065 % fällig am 16.06.2070 | | 5.839 | 7.066 | 0,06 |
| **Friary PLC** | | | | |
| 1,358 % fällig am 21.11.2067 | | 961 | 1.166 | 0,01 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 18.06.2038 | € | 364 | 375 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 18.03.2039 | | 491 | 506 | 0,00 |
| 1,853 % fällig am 18.03.2039 | £ | 4.670 | 5.171 | 0,05 |
| 2,193 % fällig am 18.06.2039 | $ | 81 | 80 | 0,00 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | | |
| 1,703 % fällig am 25.05.2053 | £ | 43.800 | 53.095 | 0,47 |
| **Ludgate Funding PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.01.2061 | € | 558 | 543 | 0,01 |
| **Mansard Mortgages PLC** | | | | |
| 1,529 % fällig am 15.12.2049 | £ | 8.082 | 9.610 | 0,09 |
| **Mortimer BTL PLC** | | | | |
| 2,090 % fällig am 20.06.2051 | | 282 | 343 | 0,00 |
| **Newgate Funding PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.12.2050 | € | 2.330 | 2.266 | 0,02 |
| 0,319 % fällig am 15.12.2050 | | 767 | 787 | 0,01 |
| 0,969 % fällig am 15.12.2050 | | 2.374 | 2.268 | 0,02 |
| 1,219 % fällig am 15.12.2050 | | 4.143 | 3.839 | 0,03 |
| 1,452 % fällig am 01.12.2050 | £ | 577 | 665 | 0,01 |
| 1,578 % fällig am 01.12.2050 | | 699 | 802 | 0,01 |
| 1,618 % fällig am 01.12.2050 | | 416 | 470 | 0,00 |
| 2,589 % fällig am 15.12.2050 | | 2.866 | 3.336 | 0,03 |
| 2,839 % fällig am 15.12.2050 | | 2.552 | 2.845 | 0,03 |
| **Paragon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,631 % fällig am 15.11.2038 | $ | 28 | 27 | 0,00 |
| 1,651 % fällig am 15.05.2045 | £ | 12.730 | 15.380 | 0,14 |
| **Polaris PLC** | | | | |
| 1,730 % fällig am 23.12.2058 | | 8.496 | 10.174 | 0,09 |
| **Residential Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 2,040 % fällig am 20.06.2070 | | 20.203 | 24.464 | 0,22 |
| **Resloc UK PLC** | | | | |
| 1,749 % fällig am 15.12.2043 | | 61 | 68 | 0,00 |
| 1,809 % fällig am 15.12.2043 | | 2.895 | 3.272 | 0,03 |
| 1,989 % fällig am 15.12.2043 | $ | 153 | 146 | 0,00 |
| **Ripon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,351 % fällig am 28.08.2056 | £ | 101.882 | 122.511 | 1,08 |
| **RMAC PLC** | | | | |
| 1,571 % fällig am 12.06.2046 | | 22.561 | 27.238 | 0,24 |
| 1,841 % fällig am 12.06.2046 | | 11.990 | 14.569 | 0,13 |
| **RMAC Securities PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 12.06.2044 | € | 965 | 969 | 0,01 |
| 1,021 % fällig am 12.06.2044 | £ | 402 | 468 | 0,00 |
| 1,041 % fällig am 12.06.2044 | | 277 | 317 | 0,00 |
| **Southern Pacific Financing PLC** | | | | |
| 1,798 % fällig am 10.03.2044 | | 587 | 697 | 0,01 |
| **Stratton Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2060 | | 51.569 | 62.140 | 0,55 |
| 1,652 % fällig am 12.03.2052 | | 19.032 | 22.836 | 0,20 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2045 | | 26.969 | 32.709 | 0,29 |
| 1,605 % fällig am 20.10.2051 | | 17.606 | 21.313 | 0,19 |
| **Tower Bridge Funding PLC** | | | | |
| 2,160 % fällig am 20.09.2063 | | 21.214 | 25.807 | 0,23 |
| **Trinity Square PLC** | | | | |
| 1,300 % fällig am 15.07.2059 | | 18.613 | 22.460 | 0,20 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | |
| 1,602 % fällig am 12.03.2055 | | 13.692 | 16.181 | 0,14 |
| 1,632 % fällig am 12.09.2050 | | 267 | 323 | 0,00 |
| **Uropa Securities PLC** | | | | |
| 1,287 % fällig am 10.10.2040 | | 62 | 72 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Warwick Finance Residential Mortgages PLC** | | | |
| 0,000 % fällig am 21.12.2049 (d)£ | 1 $ | 1.595 | 0,01 |
| 1,742 % fällig am 21.12.2049 | 43.343 | 52.596 | 0,46 |
| 2,442 % fällig am 21.12.2049 | 7.280 | 8.823 | 0,08 |
| 2,942 % fällig am 21.12.2049 | 3.640 | 4.396 | 0,04 |
| 3,442 % fällig am 21.12.2049 | 2.080 | 2.511 | 0,02 |
| 3,942 % fällig am 21.12.2049 | 2.080 | 2.507 | 0,02 |
| | | 703.507 | 6,21 |
| | **AKTIEN** | | |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| **Nationwide Building Society** | | | |
| 10,250 % | 34.271 | 6.097 | 0,05 |
| | **PARI (000S)** | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | |
| 0,625 % fällig am 22.10.2050 £ | 46.810 | 34.679 | 0,31 |
| 1,500 % fällig am 31.07.2053 | 11.300 | 10.640 | 0,09 |
| 1,750 % fällig am 07.09.2022 | 25 | 30 | 0,00 |
| 4,250 % fällig am 07.06.2032 | 200 | 286 | 0,00 |
| | | 45.635 | 0,40 |
| Summe Großbritannien | | 1.334.305 | 11,78 |
| **USA** | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | |
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,884 % fällig am 25.09.2036 $ | 1.936 | 1.899 | 0,02 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | |
| 1,744 % fällig am 25.10.2036 | 4 | 2 | 0,00 |
| 1,754 % fällig am 25.12.2036 | 6.382 | 3.788 | 0,03 |
| 1,924 % fällig am 25.07.2036 | 2.195 | 873 | 0,01 |
| 2,419 % fällig am 25.01.2035 | 778 | 727 | 0,01 |
| 2,524 % fällig am 25.12.2034 | 1.017 | 940 | 0,01 |
| 2,524 % fällig am 25.08.2035 | 4.700 | 4.593 | 0,04 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,374 % fällig am 25.01.2036 | 600 | 588 | 0,01 |
| 2,599 % fällig am 25.07.2035 | 800 | 769 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.11.2034 | 771 | 756 | 0,01 |
| **Amortizing Residential Collateral Trust** | | | |
| 2,324 % fällig am 25.10.2031 | 29 | 28 | 0,00 |
| **AMRESCO Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,564 % fällig am 25.06.2029 | 46 | 43 | 0,00 |
| **Argent Securities Trust** | | | |
| 1,924 % fällig am 25.07.2036 | 6.681 | 5.918 | 0,05 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | |
| 2,324 % fällig am 25.06.2034 | 253 | 243 | 0,00 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,239 % fällig am 25.02.2036 | 3.345 | 3.844 | 0,03 |
| 2,264 % fällig am 25.12.2034 | 11 | 11 | 0,00 |
| 2,284 % fällig am 25.10.2032 | 8 | 8 | 0,00 |
| 2,449 % fällig am 25.06.2036 | 24 | 24 | 0,00 |
| 2,624 % fällig am 25.10.2037 | 263 | 262 | 0,00 |
| 2,624 % fällig am 25.11.2042 | 20 | 19 | 0,00 |
| 2,629 % fällig am 25.06.2035 | 1.478 | 1.459 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.08.2037 | 2.292 | 2.112 | 0,02 |
| **Centex Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,084 % fällig am 25.07.2032 | 17 | 15 | 0,00 |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,974 % fällig am 25.10.2037 | 4.431 | 4.413 | 0,04 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,684 % fällig am 25.07.2045 | 66 | 49 | 0,00 |
| 2,044 % fällig am 25.01.2037 | 500 | 486 | 0,00 |
| 5,764 % fällig am 25.01.2037 ^ | 133 | 74 | 0,00 |
| 7,250 % fällig am 25.05.2036 | 1.468 | 863 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | |
| 1,884 % fällig am 25.06.2037 | 4.714 | 4.614 | 0,04 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | |
| 2,304 % fällig am 25.12.2036 ^ | 127 | 98 | 0,00 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | |
| 1,764 % fällig am 25.06.2037 | 1.540 | 1.418 | 0,01 |
| 1,764 % fällig am 25.07.2037 | 822 | 761 | 0,01 |
| 1,764 % fällig am 25.08.2037 | 2.307 | 2.281 | 0,02 |
| 1,824 % fällig am 25.09.2047 ^ | 2.418 | 2.285 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| 1,844 % fällig am 25.08.2037 $ | 15.000 $ | 13.682 | 0,12 |
| 1,844 % fällig am 25.09.2037 ^ | 513 | 527 | 0,01 |
| 1,844 % fällig am 25.06.2047 | 14.732 | 14.145 | 0,13 |
| 1,884 % fällig am 25.09.2046 | 3.570 | 3.426 | 0,03 |
| 1,944 % fällig am 25.05.2047 ^ | 8.271 | 6.160 | 0,05 |
| 2,144 % fällig am 25.12.2036 ^ | 6.678 | 6.294 | 0,06 |
| 2,284 % fällig am 25.08.2035 | 2.418 | 2.375 | 0,02 |
| 2,314 % fällig am 25.05.2036 | 4.208 | 4.181 | 0,04 |
| 2,464 % fällig am 25.10.2047 | 3.150 | 3.039 | 0,03 |
| 2,599 % fällig am 25.01.2036 | 5.354 | 5.181 | 0,05 |
| 2,674 % fällig am 25.11.2034 | 97 | 96 | 0,00 |
| 5,270 % fällig am 25.02.2035 | 252 | 237 | 0,00 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.** | | | |
| 2,344 % fällig am 25.07.2034 | 152 | 149 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | |
| 2,244 % fällig am 25.01.2032 | 16 | 16 | 0,00 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | |
| 1,684 % fällig am 25.11.2036 | 33 | 16 | 0,00 |
| **CSAB Mortgage-Backed Trust** | | | |
| 6,672 % fällig am 25.06.2036 ^ | 217 | 72 | 0,00 |
| **Delta Funding Home Equity Loan Trust** | | | |
| 1,964 % fällig am 15.08.2030 | 13 | 12 | 0,00 |
| **Ellington Loan Acquisition Trust** | | | |
| 2,724 % fällig am 25.05.2037 | 357 | 346 | 0,00 |
| **EMC Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,364 % fällig am 25.05.2040 | 14 | 13 | 0,00 |
| **Encore Credit Receivables Trust** | | | |
| 2,524 % fällig am 25.01.2036 | 6.000 | 5.694 | 0,05 |
| **Fieldstone Mortgage Investment Trust** | | | |
| 1,246 % fällig am 25.11.2036 | 2.129 | 1.391 | 0,01 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,734 % fällig am 25.12.2037 | 3.034 | 2.900 | 0,03 |
| 2,344 % fällig am 25.10.2035 | 178 | 178 | 0,00 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | |
| 1,759 % fällig am 25.10.2036 | 2.382 | 2.165 | 0,02 |
| 1,764 % fällig am 25.01.2037 | 2.557 | 1.489 | 0,01 |
| 2,689 % fällig am 25.06.2035 | 6.247 | 6.065 | 0,05 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | |
| 2,084 % fällig am 25.04.2047 | 328 | 182 | 0,00 |
| 2,104 % fällig am 25.06.2036 | 2.984 | 1.057 | 0,01 |
| 2,224 % fällig am 25.03.2037 | 299 | 137 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.05.2047 | 121 | 87 | 0,00 |
| **GSAMP Trust** | | | |
| 1,754 % fällig am 25.12.2046 | 8.504 | 4.953 | 0,04 |
| 1,764 % fällig am 25.12.2036 | 6.180 | 3.539 | 0,03 |
| 1,854 % fällig am 25.12.2046 | 7.451 | 3.966 | 0,04 |
| 1,904 % fällig am 25.06.2036 | 173 | 166 | 0,00 |
| 2,124 % fällig am 25.05.2046 | 500 | 471 | 0,00 |
| 2,299 % fällig am 25.11.2035 | 3.197 | 3.126 | 0,03 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | |
| 2,184 % fällig am 25.08.2036 | 437 | 428 | 0,00 |
| 2,324 % fällig am 25.12.2033 | 4 | 4 | 0,00 |
| 2,544 % fällig am 25.02.2033 | 2 | 2 | 0,00 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | |
| 1,784 % fällig am 25.11.2036 | 7.225 | 6.325 | 0,06 |
| 1,944 % fällig am 25.04.2037 | 3.557 | 3.107 | 0,03 |
| **Home Equity Mortgage Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 ^ | 490 | 458 | 0,00 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | |
| 2,164 % fällig am 25.02.2036 | 2.917 | 2.880 | 0,03 |
| **Humboldt Americas LLC** | | | |
| 0,000 % fällig am 31.07.2022 COP | 20.000.000 | 4.297 | 0,04 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | |
| 1,844 % fällig am 25.08.2036 | 2.950 | 2.171 | 0,02 |
| 1,884 % fällig am 25.08.2036 | 927 | 920 | 0,01 |
| 1,894 % fällig am 25.08.2036 | 8.000 | 7.395 | 0,07 |
| 2,104 % fällig am 25.04.2036 | 6.182 | 5.982 | 0,05 |
| **Lehman ABS Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,714 % fällig am 25.06.2037 | 96 | 69 | 0,00 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,924 % fällig am 25.05.2036 | 3.954 | 2.415 | 0,02 |
| 2,184 % fällig am 25.10.2034 | 538 | 506 | 0,01 |
| 2,899 % fällig am 25.02.2035 | 8.389 | 8.241 | 0,07 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 1,724 % fällig am 25.08.2036 | 16.846 | 6.672 | 0,06 |
| **MASTR Specialized Loan Trust** | | | |
| 3,274 % fällig am 25.06.2043 | 247 | 243 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | |
| 1,784 % fällig am 25.09.2037 $ | 21 $ | 11 | 0,00 |
| 2,344 % fällig am 25.05.2036 | 287 | 283 | 0,00 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | |
| 1,684 % fällig am 25.05.2037 | 248 | 219 | 0,00 |
| 1,754 % fällig am 25.01.2037 | 2.775 | 1.475 | 0,01 |
| 1,764 % fällig am 25.10.2036 | 3.190 | 1.624 | 0,01 |
| 1,784 % fällig am 25.09.2036 | 4.527 | 2.130 | 0,02 |
| 1,854 % fällig am 25.10.2036 | 10.654 | 6.038 | 0,05 |
| 1,874 % fällig am 25.07.2036 | 529 | 449 | 0,00 |
| 2,124 % fällig am 25.04.2036 | 5.177 | 4.852 | 0,04 |
| 2,299 % fällig am 25.09.2035 | 500 | 478 | 0,00 |
| 3,524 % fällig am 25.02.2047 | 1.556 | 1.427 | 0,01 |
| 3,874 % fällig am 25.03.2033 | 63 | 61 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | |
| 1,794 % fällig am 25.04.2037 | 3.859 | 2.212 | 0,02 |
| 1,854 % fällig am 25.04.2037 | 11.797 | 6.880 | 0,06 |
| **Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust** | | | |
| 1,674 % fällig am 25.11.2036 | 2 | 1 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,084 % fällig am 25.02.2037 | 192 | 61 | 0,00 |
| 2,344 % fällig am 25.04.2037 | 310 | 112 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.04.2037 ^ | 111 | 63 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | 152 | 110 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Structured Trust** | | | |
| 1,854 % fällig am 25.06.2037 | 580 | 579 | 0,01 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,359 % fällig am 25.06.2035 | 1.578 | 1.575 | 0,01 |
| 3,677 % fällig am 20.06.2031 | 193 | 170 | 0,00 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,254 % fällig am 25.02.2036 | 4.400 | 4.097 | 0,04 |
| **Nomura Resecuritization Trust** | | | |
| 1,178 % fällig am 26.12.2037 | 1.082 | 976 | 0,01 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | |
| 1,794 % fällig am 25.01.2037 | 1.424 | 532 | 0,01 |
| 2,164 % fällig am 25.05.2036 | 3.600 | 3.379 | 0,03 |
| 2,284 % fällig am 25.01.2036 | 227 | 224 | 0,00 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,764 % fällig am 25.01.2037 | 782 | 541 | 0,01 |
| 1,764 % fällig am 25.03.2037 | 3.018 | 2.406 | 0,02 |
| 1,804 % fällig am 25.04.2037 | 15.023 | 7.744 | 0,07 |
| 1,844 % fällig am 25.04.2037 | 4.177 | 3.125 | 0,03 |
| 1,844 % fällig am 25.05.2037 | 5.190 | 3.498 | 0,03 |
| 2,304 % fällig am 25.11.2034 | 58 | 55 | 0,00 |
| 2,359 % fällig am 25.08.2035 | 176 | 175 | 0,00 |
| 2,494 % fällig am 25.05.2035 | 4.867 | 4.378 | 0,04 |
| **Ownit Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,924 % fällig am 25.05.2037 | 1.694 | 1.340 | 0,01 |
| **Park Place Securities, Inc.** | | | |
| 2,359 % fällig am 25.09.2035 | 200 | 196 | 0,00 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,344 % fällig am 25.08.2035 | 92 | 94 | 0,00 |
| **People's Choice Home Loan Securities Trust** | | | |
| 2,974 % fällig am 25.01.2035 | 162 | 157 | 0,00 |
| **PFS Financing Corp.** | | | |
| 0,930 % fällig am 15.08.2024 | 7.300 | 7.286 | 0,06 |
| 1,000 % fällig am 15.10.2025 | 14.700 | 14.148 | 0,13 |
| **RAAC Trust** | | | |
| 2,134 % fällig am 25.08.2036 | 4 | 4 | 0,00 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,324 % fällig am 25.08.2032 | 1 | 1 | 0,00 |
| 5,340 % fällig am 25.01.2037 | 15.639 | 6.123 | 0,05 |
| 5,879 % fällig am 25.06.2037 ^ | 19.229 | 6.549 | 0,06 |
| 5,893 % fällig am 25.06.2037 ^ | 9.958 | 3.400 | 0,03 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | |
| 1,844 % fällig am 25.12.2036 | 755 | 744 | 0,01 |
| 2,304 % fällig am 25.12.2035 | 3.886 | 3.520 | 0,03 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | |
| 2,329 % fällig am 25.11.2035 | 600 | 576 | 0,01 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | |
| 1,824 % fällig am 25.05.2047 | 8.966 | 7.961 | 0,07 |
| 1,934 % fällig am 25.09.2037 | 2.664 | 2.560 | 0,02 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | |
| 1,674 % fällig am 25.12.2036 | 6 | 4 | 0,00 |
| 1,744 % fällig am 25.12.2036 ^ | 84 | 24 | 0,00 |
| 1,754 % fällig am 25.05.2037 ^ | 166 | 132 | 0,00 |
| 2,344 % fällig am 25.10.2035 | 523 | 468 | 0,00 |
| 2,449 % fällig am 25.10.2035 | 2.208 | 2.107 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **SG Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.07.2036 | $ | 3.179 | $ 776 | 0,01 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.10.2039 | € | 195 | 195 | 0,00 |
| 0,269 % fällig am 15.12.2033 | | 1.112 | 1.099 | 0,01 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.03.2037 | $ | 721 | 680 | 0,01 |
| 1,794 % fällig am 25.07.2037 | | 2.018 | 1.792 | 0,02 |
| 1,794 % fällig am 25.08.2037 | | 273 | 241 | 0,00 |
| 1,804 % fällig am 25.07.2037 | | 169 | 159 | 0,00 |
| 1,824 % fällig am 25.06.2037 | | 6.882 | 5.091 | 0,05 |
| 1,834 % fällig am 25.06.2037 | | 13.274 | 9.593 | 0,09 |
| 2,029 % fällig am 25.12.2036 | | 6.800 | 6.561 | 0,06 |
| 2,124 % fällig am 25.10.2036 | | 10.194 | 9.794 | 0,09 |
| 2,124 % fällig am 25.11.2036 | | 6.034 | 5.689 | 0,05 |
| 2,374 % fällig am 25.03.2036 | | 1.000 | 976 | 0,01 |
| 2,524 % fällig am 25.10.2037 | | 5.667 | 4.461 | 0,04 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | | |
| 2,224 % fällig am 25.12.2036 | | 330 | 312 | 0,00 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 2,244 % fällig am 25.01.2036 | | 3.195 | 3.045 | 0,03 |
| 2,899 % fällig am 25.11.2034 | | 1.953 | 1.878 | 0,02 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,759 % fällig am 25.07.2036 | | 328 | 323 | 0,00 |
| 2,562 % fällig am 25.04.2035 | | 9 | 9 | 0,00 |
| **Terwin Mortgage Trust** | | | | |
| 0,142 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 219 | 89 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.11.2033 | | 5 | 5 | 0,00 |
| **WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust** | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.01.2037 | | 2.946 | 2.604 | 0,02 |
| **Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 1,684 % fällig am 25.10.2036 | | 51 | 23 | 0,00 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,969 % fällig am 25.01.2037 | | 6.343 | 6.084 | 0,05 |
| | | | 376.724 | 3,33 |

## UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **7-Eleven, Inc.** | | | | |
| 0,800 % fällig am 10.02.2024 | | 12.300 | 11.664 | 0,10 |
| **AbbVie, Inc.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.11.2023 | € | 1.200 | 1.250 | 0,01 |
| 3,250 % fällig am 01.10.2022 | $ | 5.100 | 5.100 | 0,05 |
| 3,750 % fällig am 14.11.2023 | | 5.700 | 5.719 | 0,05 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.11.2031 | | 300 | 334 | 0,00 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 04.04.2025 | € | 200 | 201 | 0,00 |
| 2,950 % fällig am 15.01.2025 | $ | 14.600 | 14.109 | 0,12 |
| 3,800 % fällig am 15.08.2029 | | 7.400 | 6.799 | 0,06 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 0,523 % fällig am 05.09.2023 | € | 100 | 105 | 0,00 |
| 3,150 % fällig am 04.09.2036 | | 100 | 96 | 0,00 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.08.2025 | $ | 23.600 | 22.456 | 0,20 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,652 % fällig am 24.08.2025 | € | 15.400 | 15.966 | 0,14 |
| 0,822 % fällig am 22.09.2026 | | 6.200 | 6.396 | 0,06 |
| 1,949 % fällig am 27.10.2026 | | 17.600 | 17.823 | 0,16 |
| 2,551 % fällig am 04.02.2028 | $ | 12.100 | 11.014 | 0,10 |
| 2,972 % fällig am 04.02.2033 | | 10.500 | 8.955 | 0,08 |
| 3,384 % fällig am 02.04.2026 | | 11.800 | 11.453 | 0,10 |
| 4,376 % fällig am 27.04.2028 | | 7.300 | 7.193 | 0,06 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** | | | | |
| 2,839 % fällig am 15.12.2023 | | 10.200 | 10.148 | 0,09 |
| 4,250 % fällig am 15.12.2025 | | 5.700 | 5.635 | 0,05 |
| 4,375 % fällig am 15.12.2028 | | 4.300 | 4.192 | 0,04 |
| **Boeing Co.** | | | | |
| 1,167 % fällig am 04.02.2023 | | 13.100 | 12.955 | 0,11 |
| 1,433 % fällig am 04.02.2024 | | 3.700 | 3.537 | 0,03 |
| 1,950 % fällig am 01.02.2024 | | 36.000 | 34.859 | 0,31 |
| 2,750 % fällig am 01.02.2026 | | 1.300 | 1.209 | 0,01 |
| 3,250 % fällig am 01.02.2028 | | 6.200 | 5.546 | 0,05 |
| 3,625 % fällig am 01.02.2031 | | 19.000 | 16.419 | 0,15 |
| **BP Capital Markets America, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 10.05.2023 | | 700 | 699 | 0,01 |
| 3,790 % fällig am 06.02.2024 | | 4.600 | 4.622 | 0,04 |
| **Bristol-Myers Squibb Co.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.08.2022 | | 1.800 | 1.802 | 0,02 |
| **British Airways Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,300 % fällig am 15.06.2034 | $ | 5.772 | $ 5.158 | 0,05 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | |
| 1,950 % fällig am 15.02.2028 | | 3.900 | 3.325 | 0,03 |
| 2,450 % fällig am 15.02.2031 | | 8.300 | 6.677 | 0,06 |
| 2,600 % fällig am 15.02.2033 | | 11.100 | 8.549 | 0,08 |
| 3,137 % fällig am 15.11.2035 | | 100 | 76 | 0,00 |
| 3,187 % fällig am 15.11.2036 | | 2.600 | 1.980 | 0,02 |
| 3,419 % fällig am 15.04.2033 | | 100 | 83 | 0,00 |
| 3,469 % fällig am 15.04.2034 | | 3.000 | 2.446 | 0,02 |
| **Campbell Soup Co.** | | | | |
| 3,650 % fällig am 15.03.2023 | | 58 | 58 | 0,00 |
| **Charles Schwab Corp.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 18.03.2024 | | 6.000 | 5.760 | 0,05 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 2,936 % fällig am 01.02.2024 | | 7.700 | 7.761 | 0,07 |
| 3,750 % fällig am 15.02.2028 | | 10.900 | 10.076 | 0,09 |
| 3,850 % fällig am 01.04.2061 | | 5.100 | 3.364 | 0,03 |
| 4,500 % fällig am 01.02.2024 | | 3.800 | 3.826 | 0,03 |
| 5,125 % fällig am 01.07.2049 | | 600 | 498 | 0,00 |
| 6,384 % fällig am 23.10.2035 | | 24.800 | 24.980 | 0,22 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 3,010 % fällig am 01.09.2023 | | 1.100 | 1.099 | 0,01 |
| 3,290 % fällig am 17.03.2026 (k) | | 33.100 | 32.040 | 0,28 |
| 3,785 % fällig am 17.03.2033 (k) | | 14.500 | 13.077 | 0,12 |
| **Comcast Corp.** | | | | |
| 1,674 % fällig am 15.04.2024 | | 12.400 | 12.399 | 0,11 |
| **Conagra Brands, Inc.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 01.05.2024 | | 5.200 | 5.223 | 0,05 |
| **Corebridge Financial, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 04.04.2025 | | 7.500 | 7.294 | 0,06 |
| **D.R. Horton, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.09.2022 | | 100 | 100 | 0,00 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 4,900 % fällig am 01.10.2026 | | 3.000 | 3.007 | 0,03 |
| 5,300 % fällig am 01.10.2029 | | 800 | 789 | 0,01 |
| 6,020 % fällig am 15.06.2026 | | 2.700 | 2.807 | 0,02 |
| **Discover Bank** | | | | |
| 4,200 % fällig am 08.08.2023 | | 2.700 | 2.711 | 0,02 |
| **Doctors Co. An Interinsurance Exchange** | | | | |
| 4,500 % fällig am 18.01.2032 | | 3.900 | 3.424 | 0,03 |
| **Energy Transfer LP** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.04.2024 | | 1.300 | 1.301 | 0,01 |
| **Entergy Arkansas LLC** | | | | |
| 3,700 % fällig am 01.06.2024 | | 1.100 | 1.105 | 0,01 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 21.05.2023 | € | 100 | 104 | 0,00 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 1,744 % fällig am 19.07.2024 | | 1.600 | 1.549 | 0,01 |
| 2,330 % fällig am 25.11.2025 | | 400 | 371 | 0,00 |
| 2,366 % fällig am 03.08.2022 | $ | 1.500 | 1.497 | 0,01 |
| 2,386 % fällig am 17.02.2026 | € | 800 | 734 | 0,01 |
| 2,748 % fällig am 14.06.2024 | £ | 2.400 | 2.696 | 0,02 |
| 2,900 % fällig am 16.02.2028 | $ | 700 | 565 | 0,00 |
| 3,250 % fällig am 15.09.2025 | € | 200 | 192 | 0,00 |
| 3,350 % fällig am 01.11.2022 | $ | 3.800 | 3.780 | 0,03 |
| 3,370 % fällig am 17.11.2023 | | 14.500 | 14.152 | 0,13 |
| 3,375 % fällig am 13.11.2025 | | 2.700 | 2.440 | 0,02 |
| 3,664 % fällig am 08.09.2024 | | 1.100 | 1.042 | 0,01 |
| 3,815 % fällig am 02.11.2027 | | 1.400 | 1.193 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 20.09.2022 | | 200 | 200 | 0,00 |
| 4,389 % fällig am 08.01.2026 | | 1.000 | 924 | 0,01 |
| 4,535 % fällig am 06.03.2025 | £ | 1.600 | 1.823 | 0,02 |
| 4,687 % fällig am 09.06.2025 | $ | 600 | 568 | 0,01 |
| 5,584 % fällig am 18.03.2024 | | 2.400 | 2.393 | 0,02 |
| **GA Global Funding Trust** | | | | |
| 2,250 % fällig am 06.01.2027 | | 9.400 | 8.416 | 0,07 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 3,550 % fällig am 08.07.2022 | | 2.600 | 2.600 | 0,02 |
| **GLP Capital LP** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.06.2025 | | 1.500 | 1.474 | 0,01 |
| 5,300 % fällig am 15.01.2029 | | 2.500 | 2.394 | 0,02 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 0,010 % fällig am 30.04.2024 | € | 18.600 | 19.132 | 0,17 |
| 0,250 % fällig am 26.01.2028 | | 10.300 | 9.029 | 0,08 |
| 0,579 % fällig am 07.02.2025 | | 6.800 | 7.077 | 0,06 |
| 1,250 % fällig am 07.02.2029 | | 8.000 | 7.204 | 0,06 |
| 1,675 % fällig am 24.01.2025 | $ | 19.000 | 18.574 | 0,16 |
| 3,000 % fällig am 15.03.2024 | | 15.800 | 15.603 | 0,14 |
| 3,850 % fällig am 08.07.2024 | $ | 100 | $ 100 | 0,00 |
| 4,223 % fällig am 01.05.2029 | | 3.400 | 3.271 | 0,03 |
| **Goodman U.S. Finance Three LLC** | | | | |
| 3,700 % fällig am 15.03.2028 | | 6.600 | 6.324 | 0,06 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.09.2026 | | 2.170 | 2.155 | 0,02 |
| 5,875 % fällig am 01.02.2029 | | 500 | 501 | 0,00 |
| **Helmerich & Payne, Inc.** | | | | |
| 2,900 % fällig am 29.09.2031 | | 100 | 86 | 0,00 |
| **Hyatt Hotels Corp.** | | | | |
| 1,300 % fällig am 01.10.2023 | | 100 | 97 | 0,00 |
| **JetBlue Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.05.2034 | | 5.952 | 5.549 | 0,05 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 2,595 % fällig am 24.02.2026 | | 21.600 | 20.555 | 0,18 |
| 3,797 % fällig am 23.07.2024 | | 13.291 | 13.249 | 0,12 |
| 4,080 % fällig am 26.04.2026 | | 33.800 | 33.425 | 0,30 |
| **Kilroy Realty LP** | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.12.2024 | | 1.800 | 1.757 | 0,02 |
| **Kinder Morgan Energy Partners LP** | | | | |
| 6,950 % fällig am 15.01.2038 | | 600 | 647 | 0,01 |
| **Komatsu Finance America, Inc.** | | | | |
| 0,849 % fällig am 09.09.2023 | | 500 | 485 | 0,00 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 30.06.2023 | € | 2.800 | 2.932 | 0,03 |
| **Lehman Brothers Holdings, Inc.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.05.2010 ^ | $ | 8.800 | 37 | 0,00 |
| 5,625 % fällig am 24.01.2013 ^ | | 12.700 | 54 | 0,00 |
| 6,200 % fällig am 26.09.2014 ^ | | 9.800 | 42 | 0,00 |
| 7,875 % fällig am 08.05.2018 ^ | £ | 14.000 | 111 | 0,00 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 2,103 % fällig am 08.05.2026 | € | 30.000 | 30.765 | 0,27 |
| 2,630 % fällig am 18.02.2026 | $ | 11.600 | 11.082 | 0,10 |
| 3,875 % fällig am 29.04.2024 | | 75 | 75 | 0,00 |
| 4,210 % fällig am 20.04.2028 | | 8.800 | 8.612 | 0,08 |
| **Nissan Motor Acceptance Co. LLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 21.09.2023 | | 1.400 | 1.391 | 0,01 |
| **ONEOK, Inc.** | | | | |
| 4,350 % fällig am 15.03.2029 | | 900 | 847 | 0,01 |
| 4,550 % fällig am 15.07.2028 | | 4.400 | 4.259 | 0,04 |
| **Oracle Corp.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.04.2025 | | 600 | 571 | 0,01 |
| 2,875 % fällig am 25.03.2031 (k) | | 500 | 412 | 0,00 |
| 3,950 % fällig am 25.03.2051 (k) | | 100 | 74 | 0,00 |
| **Organon & Co.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 30.04.2028 | € | 3.400 | 2.987 | 0,03 |
| 4,125 % fällig am 30.04.2028 | $ | 4.900 | 4.355 | 0,04 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | | |
| 2,100 % fällig am 01.08.2027 | | 500 | 420 | 0,00 |
| 2,950 % fällig am 01.03.2026 ^ | | 1.900 | 1.729 | 0,02 |
| 3,150 % fällig am 01.01.2026 | | 5.300 | 4.860 | 0,04 |
| 3,300 % fällig am 01.12.2027 ^ | | 800 | 699 | 0,01 |
| 3,400 % fällig am 15.08.2024 ^ | | 1.300 | 1.250 | 0,01 |
| 3,450 % fällig am 01.07.2025 | | 400 | 377 | 0,00 |
| 3,750 % fällig am 01.07.2028 | | 1.500 | 1.326 | 0,01 |
| 3,950 % fällig am 01.12.2047 ^ | | 2.400 | 1.667 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 01.12.2046 ^ | | 1.600 | 1.125 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 15.03.2046 ^ | | 800 | 586 | 0,01 |
| 4,300 % fällig am 15.03.2045 ^ | | 1.500 | 1.093 | 0,01 |
| 4,450 % fällig am 15.04.2042 ^ | | 1.900 | 1.430 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 01.07.2040 | | 800 | 621 | 0,01 |
| 4,550 % fällig am 01.07.2030 | | 3.100 | 2.757 | 0,02 |
| 4,600 % fällig am 15.06.2043 ^ | | 1.000 | 765 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 15.02.2044 ^ | | 200 | 154 | 0,00 |
| 4,950 % fällig am 01.07.2050 | | 600 | 480 | 0,00 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | | |
| 3,450 % fällig am 01.07.2024 | | 4.800 | 4.702 | 0,04 |
| **Principal Life Global Funding** | | | | |
| 1,375 % fällig am 10.01.2025 | | 7.200 | 6.723 | 0,06 |
| **Public Service Enterprise Group, Inc.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 15.11.2022 | | 1.100 | 1.099 | 0,01 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.05.2024 | | 6.500 | 6.635 | 0,06 |
| **Southern California Edison Co.** | | | | |
| 0,700 % fällig am 03.04.2023 | | 6.300 | 6.159 | 0,05 |
| 1,100 % fällig am 01.04.2024 | | 5.700 | 5.426 | 0,05 |
| 2,153 % fällig am 03.04.2023 | | 6.800 | 6.788 | 0,06 |
| 2,343 % fällig am 01.04.2024 | | 2.900 | 2.870 | 0,03 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Southern Co.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 01.07.2023 | $ | 600 | $ 595 | 0,01 |
| **Southern Co. Gas Capital Corp.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 01.10.2023 | | 1.747 | 1.724 | 0,02 |
| **Southwest Airlines Co.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 04.05.2025 | | 100 | 102 | 0,00 |
| **Sprint Spectrum Co. LLC** | | | | |
| 4,738 % fällig am 20.09.2029 | | 3.850 | 3.854 | 0,03 |
| **UnitedHealth Group, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.02.2023 | | 1.200 | 1.196 | 0,01 |
| **Virginia Electric & Power Co.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.03.2023 | | 500 | 497 | 0,00 |
| **Walt Disney Co.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 13.05.2040 | | 3.300 | 2.818 | 0,02 |
| 3,600 % fällig am 13.01.2051 | | 4.500 | 3.766 | 0,03 |
| **Warner Media LLC** | | | | |
| 1,950 % fällig am 15.09.2023 | € | 350 | 365 | 0,00 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 2,469 % fällig am 31.10.2023 | $ | 33.500 | 33.521 | 0,30 |
| 3,908 % fällig am 25.04.2026 | | 8.700 | 8.567 | 0,08 |
| | | | 822.528 | 7,26 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **CenturyLink, Inc.** | | | | |
| 3,916 % fällig am 15.03.2027 (b) | | 9.254 | 8.524 | 0,07 |
| **Organon & Co.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 02.06.2028 (b) | | 6.516 | 6.282 | 0,06 |
| | | | 14.806 | 0,13 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | | |
| 6,270 % fällig am 15.02.2050 | | 95 | 110 | 0,00 |
| **American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010** | | | | |
| 7,734 % fällig am 15.02.2033 | | 100 | 127 | 0,00 |
| 7,834 % fällig am 15.02.2041 | | 1.700 | 2.292 | 0,02 |
| **Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021** | | | | |
| 3,850 % fällig am 01.06.2050 | | 4.000 | 3.613 | 0,03 |
| **Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021** | | | | |
| 2,346 % fällig am 01.06.2030 | | 200 | 175 | 0,00 |
| 2,687 % fällig am 01.06.2030 | | 6.000 | 5.246 | 0,05 |
| 2,787 % fällig am 01.06.2031 | | 4.400 | 3.816 | 0,04 |
| 3,037 % fällig am 01.06.2032 | | 8.045 | 6.917 | 0,06 |
| **Los Angeles County, California Public Works Financing Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | | |
| 7,618 % fällig am 01.08.2040 | | 2.800 | 3.665 | 0,03 |
| **Municipal Electric Authority of Georgia Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | | |
| 6,655 % fällig am 01.04.2057 | | 289 | 347 | 0,00 |
| **New Jersey Transportation Trust Fund Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | | |
| 5,754 % fällig am 15.12.2028 | | 200 | 210 | 0,00 |
| **New Jersey Transportation Trust Fund Authority Revenue Bonds, Series 2019** | | | | |
| 4,081 % fällig am 15.06.2039 | | 6.180 | 5.578 | 0,05 |
| | | | 32.096 | 0,28 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,774 % fällig am 25.03.2035 | | 602 | 522 | 0,01 |
| 2,925 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 69 | 62 | 0,00 |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | | |
| 1,396 % fällig am 25.11.2046 | | 7.607 | 2.483 | 0,02 |
| 1,814 % fällig am 25.05.2046 ^ | | 286 | 240 | 0,00 |
| 1,834 % fällig am 25.10.2046 | | 69 | 40 | 0,00 |
| 2,004 % fällig am 25.09.2046 ^ | | 824 | 741 | 0,01 |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 3,687 % fällig am 25.09.2035 | | 3.680 | 1.783 | 0,02 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 1,932 % fällig am 20.02.2047 | | 705 | 659 | 0,01 |
| 2,245 % fällig am 20.11.2035 ^ | | 95 | 85 | 0,00 |
| 2,736 % fällig am 20.02.2036 | | 314 | 304 | 0,00 |
| 3,461 % fällig am 20.01.2047 ^ | | 115 | 109 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 5,750 % fällig am 25.11.2035 | $ | 13 | $ 12 | 0,00 |
| 12,358 % fällig am 20.10.2046 ^ | | 120 | 101 | 0,00 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | | |
| 2,340 % fällig am 25.09.2035 | | 17 | 16 | 0,00 |
| 2,719 % fällig am 25.09.2033 | | 7 | 6 | 0,00 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 1,064 % fällig am 26.01.2047 | | 328 | 309 | 0,00 |
| 1,964 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 27 | 24 | 0,00 |
| 2,064 % fällig am 25.05.2047 ^ | | 182 | 178 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 26.04.2037 | | 593 | 383 | 0,00 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,233 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 47 | 41 | 0,00 |
| 2,400 % fällig am 25.02.2036 | | 56 | 55 | 0,00 |
| 2,535 % fällig am 25.10.2033 | | 35 | 34 | 0,00 |
| 2,817 % fällig am 25.02.2034 | | 9 | 9 | 0,00 |
| 2,846 % fällig am 25.05.2034 | | 130 | 116 | 0,00 |
| 2,995 % fällig am 25.05.2034 | | 71 | 67 | 0,00 |
| 3,160 % fällig am 25.08.2033 | | 6 | 6 | 0,00 |
| 3,278 % fällig am 25.05.2047 ^ | | 113 | 106 | 0,00 |
| 3,500 % fällig am 25.08.2033 | | 55 | 53 | 0,00 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.02.2034 | | 123 | 114 | 0,00 |
| 2,344 % fällig am 25.08.2035 | | 11.384 | 10.784 | 0,10 |
| 2,752 % fällig am 25.05.2035 | | 48 | 46 | 0,00 |
| 2,890 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 657 | 546 | 0,01 |
| 2,899 % fällig am 25.03.2036 | | 282 | 180 | 0,00 |
| 2,954 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 2.776 | 1.568 | 0,01 |
| 2,999 % fällig am 25.01.2036 | | 1.769 | 1.695 | 0,02 |
| 3,074 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 1.703 | 1.131 | 0,01 |
| 3,134 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 11 | 8 | 0,00 |
| 3,232 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 483 | 296 | 0,00 |
| 3,497 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 1.278 | 736 | 0,01 |
| **Bear Stearns Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.12.2046 | | 378 | 336 | 0,00 |
| **Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust** | | | | |
| 2,999 % fällig am 26.12.2046 ^ | | 1.763 | 1.469 | 0,01 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.02.2037 | | 161 | 157 | 0,00 |
| 3,057 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 55 | 52 | 0,00 |
| 3,342 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 605 | 580 | 0,01 |
| 3,718 % fällig am 25.07.2037 | | 41 | 36 | 0,00 |
| **Citicorp Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 70 | 60 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,146 % fällig am 25.08.2036 | | 9.862 | 4.181 | 0,04 |
| 2,470 % fällig am 25.10.2035 | | 10 | 9 | 0,00 |
| 2,829 % fällig am 25.08.2035 | | 79 | 78 | 0,00 |
| 3,950 % fällig am 25.05.2035 | | 8 | 7 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 2,190 % fällig am 25.09.2035 | | 13 | 13 | 0,00 |
| 3,790 % fällig am 25.09.2035 | | 133 | 131 | 0,00 |
| 4,255 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 324 | 306 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,266 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 566 | 508 | 0,01 |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,224 % fällig am 25.02.2037 | | 1.726 | 1.502 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 334 | 303 | 0,00 |
| **Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 0,696 % fällig am 10.03.2046 (a) | | 21.812 | 71 | 0,00 |
| 1,389 % fällig am 10.01.2046 (a) | | 8.793 | 17 | 0,00 |
| 3,545 % fällig am 10.02.2036 | | 28.500 | 27.091 | 0,24 |
| 3,590 % fällig am 10.11.2047 | | 15.500 | 15.289 | 0,14 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,792 % fällig am 20.02.2047 ^ | | 5.480 | 4.261 | 0,04 |
| 1,807 % fällig am 20.12.2046 ^ | | 2.595 | 2.179 | 0,02 |
| 1,822 % fällig am 20.07.2046 ^ | | 275 | 212 | 0,00 |
| 1,864 % fällig am 25.06.2036 | | 1.048 | 987 | 0,01 |
| 1,892 % fällig am 20.09.2046 | | 1.244 | 835 | 0,01 |
| 1,944 % fällig am 25.02.2047 | | 148 | 132 | 0,00 |
| 1,964 % fällig am 25.05.2047 | | 3.749 | 3.292 | 0,03 |
| 1,974 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 539 | 209 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.05.2036 | | 75 | 65 | 0,00 |
| 2,032 % fällig am 20.03.2046 | | 1.800 | 1.422 | 0,01 |
| 2,044 % fällig am 25.05.2035 | | 35 | 32 | 0,00 |
| 2,044 % fällig am 25.07.2046 ^ | | 57 | 50 | 0,00 |
| 2,072 % fällig am 20.05.2046 ^ | | 2.718 | 2.341 | 0,02 |
| 2,084 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 5.565 | 5.181 | 0,05 |
| 2,184 % fällig am 25.02.2037 | | 945 | 775 | 0,01 |
| 2,252 % fällig am 20.12.2035 | | 1.771 | 1.624 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 2,264 % fällig am 25.11.2035 | $ | 12 | $ 10 | 0,00 |
| 2,266 % fällig am 20.11.2035 | | 447 | 420 | 0,00 |
| 2,272 % fällig am 20.11.2035 | | 32 | 29 | 0,00 |
| 2,304 % fällig am 25.10.2046 ^ | | 830 | 650 | 0,01 |
| 2,334 % fällig am 25.11.2035 | | 350 | 311 | 0,00 |
| 2,351 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 9 | 8 | 0,00 |
| 2,374 % fällig am 25.07.2036 | | 291 | 146 | 0,00 |
| 3,051 % fällig am 25.11.2035 | | 271 | 246 | 0,00 |
| 3,164 % fällig am 25.11.2035 | | 289 | 247 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 25.06.2035 ^ | | 191 | 159 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 896 | 729 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 | | 1.636 | 1.213 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 197 | 126 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2036 | | 1.954 | 1.053 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 188 | 98 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 136 | 110 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 503 | 316 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2032 | | 4 | 4 | 0,00 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 1,985 % fällig am 20.02.2036 ^ | | 42 | 36 | 0,00 |
| 2,084 % fällig am 25.05.2035 | | 451 | 381 | 0,00 |
| 2,204 % fällig am 25.04.2035 | | 226 | 199 | 0,00 |
| 2,264 % fällig am 25.03.2035 | | 1.183 | 1.030 | 0,01 |
| 2,284 % fällig am 25.02.2035 | | 272 | 255 | 0,00 |
| 2,304 % fällig am 25.02.2035 | | 99 | 87 | 0,00 |
| 2,324 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 25 | 12 | 0,00 |
| 2,384 % fällig am 25.09.2034 | | 28 | 27 | 0,00 |
| 2,592 % fällig am 25.04.2035 | | 153 | 125 | 0,00 |
| 2,711 % fällig am 25.11.2034 | | 157 | 152 | 0,00 |
| 2,930 % fällig am 20.04.2036 | | 1.073 | 993 | 0,01 |
| 2,939 % fällig am 20.09.2036 ^ | | 60 | 54 | 0,00 |
| 3,182 % fällig am 20.02.2036 ^ | | 29 | 24 | 0,00 |
| 3,571 % fällig am 25.08.2034 ^ | | 5 | 5 | 0,00 |
| 3,991 % fällig am 25.09.2033 ^ | | 11 | 11 | 0,00 |
| 4,366 % fällig am 19.01.2034 | | 35 | 34 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 65 | 37 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.07.2037 | | 331 | 196 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | | 310 | 192 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 | | 1.084 | 575 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.12.2037 | | 672 | 347 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2047 | | 508 | 310 | 0,00 |
| **Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust** | | | | |
| 1,984 % fällig am 25.03.2035 ^ | | 778 | 752 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2035 ^ | | 51 | 49 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 1,081 % fällig am 25.03.2032 | | 41 | 38 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.04.2033 | | 4 | 4 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,593 % fällig am 25.07.2033 | | 6 | 6 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust** | | | | |
| 5,579 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 68 | 23 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Trust** | | | | |
| 3,705 % fällig am 25.06.2050 | | 4.975 | 4.378 | 0,04 |
| 3,850 % fällig am 25.09.2057 | | 10.488 | 10.206 | 0,09 |
| **Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,864 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 1.792 | 1.704 | 0,02 |
| 1,924 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 1.886 | 1.854 | 0,02 |
| 1,924 % fällig am 25.09.2047 ^ | | 2.918 | 2.639 | 0,02 |
| 1,954 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 3.026 | 2.651 | 0,02 |
| 2,004 % fällig am 25.08.2047 | | 3.678 | 3.112 | 0,03 |
| **Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,445 % fällig am 25.10.2035 | | 32 | 31 | 0,00 |
| **Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,724 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 7 | 6 | 0,00 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,802 % fällig am 19.10.2036 | | 1.333 | 1.170 | 0,01 |
| 2,452 % fällig am 19.09.2044 | | 34 | 32 | 0,00 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,729 % fällig am 25.04.2035 | | 95 | 95 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 165 | 69 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 176 | 89 | 0,00 |
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,213 % fällig am 25.08.2035 | | 53 | 36 | 0,00 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 1,804 % fällig am 25.01.2037 | | 683 | 604 | 0,01 |
| 2,044 % fällig am 25.04.2036 | | 319 | 274 | 0,00 |
| 2,064 % fällig am 25.06.2045 | | 56 | 52 | 0,00 |
| 2,164 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 209 | 197 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| 2,164 % fällig am 25.11.2045 | $ 112 | $ 98 | 0,00 |
| 2,264 % fällig am 25.09.2046 ^ | 1.019 | 863 | 0,01 |
| 2,304 % fällig am 25.10.2046 ^ | 1.279 | 947 | 0,01 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,684 % fällig am 25.10.2033 | 8 | 8 | 0,00 |
| **GS Mortgage Securities Corp.** | | | |
| 1,606 % fällig am 10.02.2046 (a) | 11.550 | 53 | 0,00 |
| **GS Mortgage Securities Corp. Trust** | | | |
| 2,224 % fällig am 15.07.2031 | 5.000 | 4.908 | 0,04 |
| **GS Mortgage Securities Trust** | | | |
| 2,039 % fällig am 10.11.2045 (a) | 44.129 | 16 | 0,00 |
| **GSMSC Pass-Through Trust** | | | |
| 7,500 % fällig am 25.10.2036 | 53 | 14 | 0,00 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,854 % fällig am 25.05.2037 | 10.339 | 6.225 | 0,06 |
| 2,867 % fällig am 25.01.2036 ^ | 42 | 41 | 0,00 |
| 2,880 % fällig am 25.03.2033 | 25 | 25 | 0,00 |
| 2,938 % fällig am 25.09.2035 | 43 | 42 | 0,00 |
| 3,037 % fällig am 25.06.2034 | 21 | 21 | 0,00 |
| 3,049 % fällig am 25.11.2035 | 17 | 17 | 0,00 |
| 3,760 % fällig am 25.04.2032 | 81 | 70 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.01.2037 | 171 | 204 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2032 | 0 | 0 | 0,00 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,326 % fällig am 19.12.2036 ^ | 302 | 275 | 0,00 |
| 1,802 % fällig am 19.09.2037 | 550 | 505 | 0,01 |
| 1,817 % fällig am 19.12.2036 | 9.073 | 7.977 | 0,07 |
| 1,995 % fällig am 19.09.2046 ^ | 691 | 641 | 0,01 |
| 2,075 % fällig am 19.03.2036 ^ | 125 | 119 | 0,00 |
| 2,112 % fällig am 19.01.2036 | 331 | 212 | 0,00 |
| 2,312 % fällig am 19.01.2035 | 101 | 90 | 0,00 |
| 2,476 % fällig am 19.10.2035 | 402 | 249 | 0,00 |
| 3,112 % fällig am 19.10.2035 | 239 | 166 | 0,00 |
| 3,217 % fällig am 19.07.2035 ^ | 57 | 44 | 0,00 |
| 3,401 % fällig am 19.08.2036 ^ | 50 | 47 | 0,00 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | |
| 1,984 % fällig am 25.12.2036 | 4 | 4 | 0,00 |
| 2,164 % fällig am 25.10.2035 | 88 | 88 | 0,00 |
| 2,284 % fällig am 25.10.2035 | 25 | 25 | 0,00 |
| **HSI Asset Loan Obligation Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^ | 37 | 33 | 0,00 |
| **Impac CMB Trust** | | | |
| 2,264 % fällig am 25.03.2035 | 8 | 7 | 0,00 |
| 2,624 % fällig am 25.07.2033 | 9 | 9 | 0,00 |
| **Impac Secured Assets Trust** | | | |
| 2,144 % fällig am 25.01.2037 | 4.648 | 4.245 | 0,04 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,804 % fällig am 25.02.2037 ^ | 1.591 | 1.480 | 0,01 |
| 1,864 % fällig am 25.06.2037 | 126 | 114 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.06.2046 | 997 | 878 | 0,01 |
| 2,735 % fällig am 25.01.2036 ^ | 54 | 51 | 0,00 |
| 2,766 % fällig am 25.10.2035 | 109 | 94 | 0,00 |
| 2,864 % fällig am 25.03.2036 | 517 | 444 | 0,01 |
| 2,917 % fällig am 25.03.2036 ^ | 2.009 | 1.636 | 0,02 |
| 2,985 % fällig am 25.08.2035 ^ | 99 | 82 | 0,00 |
| 3,016 % fällig am 25.12.2034 | 57 | 56 | 0,00 |
| 3,080 % fällig am 25.06.2036 | 172 | 157 | 0,00 |
| **JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust** | | | |
| 0,796 % fällig am 15.04.2047 (a) | 29.098 | 283 | 0,00 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | |
| 1,523 % fällig am 27.06.2037 | 154 | 120 | 0,00 |
| 2,104 % fällig am 25.10.2036 | 3.208 | 3.002 | 0,03 |
| 2,892 % fällig am 25.12.2035 ^ | 730 | 569 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2036 ^ | 13 | 6 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | |
| 1,061 % fällig am 15.12.2047 (a) | 45.639 | 143 | 0,00 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | |
| 1,997 % fällig am 25.12.2034 | 194 | 186 | 0,00 |
| 2,203 % fällig am 25.11.2033 | 60 | 58 | 0,00 |
| 2,417 % fällig am 25.07.2035 | 106 | 102 | 0,00 |
| 2,743 % fällig am 25.06.2036 ^ | 224 | 173 | 0,00 |
| 2,766 % fällig am 25.08.2034 | 136 | 132 | 0,00 |
| 2,808 % fällig am 25.07.2035 | 41 | 40 | 0,00 |
| 2,811 % fällig am 25.02.2036 ^ | 144 | 113 | 0,00 |
| 2,896 % fällig am 25.02.2036 ^ | 438 | 359 | 0,00 |
| **Lehman XS Trust** | | | |
| 1,984 % fällig am 25.12.2036 | 2.790 | 2.765 | 0,03 |
| 2,084 % fällig am 25.05.2046 | 1.106 | 1.231 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Luminent Mortgage Trust** | | | |
| 1,984 % fällig am 25.12.2036 ^ | $ 249 | $ 231 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.10.2046 | 405 | 369 | 0,00 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | |
| 3,052 % fällig am 21.11.2034 | 96 | 92 | 0,00 |
| **MASTR Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,024 % fällig am 25.03.2036 ^ | 678 | 63 | 0,00 |
| **MASTR Asset Securitization Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 ^ | 158 | 115 | 0,00 |
| **Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,024 % fällig am 15.11.2031 | 62 | 60 | 0,00 |
| **Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 1,764 % fällig am 15.12.2030 | 55 | 53 | 0,00 |
| 2,610 % fällig am 20.10.2029 | 19 | 19 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust** | | | |
| 1,944 % fällig am 25.01.2037 | 9.071 | 3.440 | 0,03 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | |
| 2,254 % fällig am 25.06.2037 | 16 | 16 | 0,00 |
| 2,277 % fällig am 25.02.2033 | 84 | 77 | 0,00 |
| 2,284 % fällig am 25.06.2028 | 20 | 19 | 0,00 |
| 2,292 % fällig am 25.12.2034 | 161 | 156 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,731 % fällig am 25.04.2037 ^ | 778 | 727 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust** | | | |
| 1,021 % fällig am 15.12.2048 (a) | 33.551 | 97 | 0,00 |
| 1,399 % fällig am 15.02.2046 (a) | 47.066 | 139 | 0,00 |
| 3,732 % fällig am 15.05.2048 | 8.100 | 7.972 | 0,07 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,884 % fällig am 25.04.2035 | 211 | 202 | 0,00 |
| 2,593 % fällig am 25.11.2035 ^ | 26 | 20 | 0,00 |
| 2,789 % fällig am 25.11.2037 | 510 | 401 | 0,00 |
| **MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,084 % fällig am 25.06.2047 | 4.575 | 4.393 | 0,04 |
| **New Century Alternative Mortgage Loan Trust** | | | |
| 6,173 % fällig am 25.07.2036 | 5.046 | 1.415 | 0,01 |
| **New Residential Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,500 % fällig am 25.12.2057 | 2.580 | 2.524 | 0,02 |
| **Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,549 % fällig am 25.10.2035 | 34 | 23 | 0,00 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | |
| 0,371 % fällig am 25.09.2046 | 1.368 | 507 | 0,01 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | |
| 1,572 % fällig am 25.11.2037 | 1.792 | 1.625 | 0,02 |
| 1,774 % fällig am 25.02.2047 | 417 | 175 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.06.2037 ^ | 1.108 | 1.055 | 0,01 |
| 1,944 % fällig am 25.03.2047 | 1.670 | 1.538 | 0,01 |
| 1,984 % fällig am 25.06.2046 | 4.599 | 1.166 | 0,01 |
| 2,044 % fällig am 25.04.2046 | 3.489 | 1.106 | 0,01 |
| 2,124 % fällig am 25.08.2037 | 565 | 516 | 0,01 |
| 3,313 % fällig am 25.08.2035 ^ | 40 | 17 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 | 408 | 353 | 0,00 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | |
| 2,024 % fällig am 25.01.2046 ^ | 11 | 4 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 | 1.894 | 1.594 | 0,02 |
| 5,750 % fällig am 25.04.2037 ^ | 1.144 | 667 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 ^ | 772 | 351 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2036 ^ | 1.104 | 401 | 0,00 |
| **Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust** | | | |
| 3,027 % fällig am 25.09.2035 ^ | 233 | 164 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.03.2032 | 8 | 8 | 0,00 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | |
| 2,224 % fällig am 20.01.2047 ^ | 292 | 206 | 0,00 |
| 2,295 % fällig am 19.10.2026 | 30 | 29 | 0,00 |
| 2,295 % fällig am 20.07.2033 | 219 | 208 | 0,00 |
| 2,355 % fällig am 20.10.2027 | 3 | 2 | 0,00 |
| 2,602 % fällig am 20.04.2035 | 34 | 34 | 0,00 |
| 2,978 % fällig am 20.07.2037 | 697 | 583 | 0,01 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,944 % fällig am 25.10.2035 | 401 | 378 | 0,00 |
| 2,064 % fällig am 25.05.2037 | 10 | 9 | 0,00 |
| 2,513 % fällig am 25.04.2034 | 96 | 96 | 0,00 |
| 2,543 % fällig am 25.02.2034 | 64 | 62 | 0,00 |
| 2,716 % fällig am 25.09.2034 | 5 | 5 | 0,00 |
| 2,873 % fällig am 25.09.2034 | 238 | 231 | 0,00 |
| 2,911 % fällig am 25.11.2035 ^ | 48 | 44 | 0,00 |
| 2,961 % fällig am 25.08.2035 | 111 | 102 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| 3,074 % fällig am 25.07.2035 ^ | $ 883 | $ 780 | 0,01 |
| 3,111 % fällig am 25.12.2035 | 456 | 386 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | |
| 1,744 % fällig am 25.08.2036 | 2.309 | 2.137 | 0,02 |
| 1,804 % fällig am 25.01.2037 | 2.145 | 1.939 | 0,02 |
| 1,804 % fällig am 25.09.2047 | 1.703 | 1.624 | 0,02 |
| 1,844 % fällig am 25.09.2047 | 25 | 21 | 0,00 |
| 1,876 % fällig am 25.12.2035 ^ | 76 | 63 | 0,00 |
| 1,944 % fällig am 25.01.2037 | 1.298 | 1.169 | 0,01 |
| 1,976 % fällig am 25.08.2047 ^ | 1.284 | 1.186 | 0,01 |
| 2,004 % fällig am 25.06.2036 | 44 | 43 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.10.2036 | 4.017 | 3.731 | 0,03 |
| 2,044 % fällig am 25.05.2036 | 485 | 393 | 0,00 |
| 2,044 % fällig am 25.09.2047 ^ | 2.368 | 2.636 | 0,02 |
| 2,064 % fällig am 25.05.2036 | 2.481 | 2.123 | 0,02 |
| 2,064 % fällig am 25.05.2046 | 2.505 | 812 | 0,01 |
| 2,095 % fällig am 19.07.2035 | 34 | 32 | 0,00 |
| 2,144 % fällig am 25.05.2046 ^ | 51 | 32 | 0,00 |
| 2,175 % fällig am 19.07.2034 | 29 | 27 | 0,00 |
| 2,184 % fällig am 25.02.2036 ^ | 497 | 457 | 0,01 |
| 2,255 % fällig am 19.09.2032 | 28 | 27 | 0,00 |
| 2,295 % fällig am 19.03.2034 | 6 | 6 | 0,00 |
| 3,079 % fällig am 25.05.2047 ^ | 2.498 | 2.078 | 0,02 |
| **Structured Asset Securities Corp.** | | | |
| 1,904 % fällig am 25.01.2036 | 75 | 72 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,914 % fällig am 25.10.2036 | 555 | 487 | 0,01 |
| **TBW Mortgage-Backed Trust** | | | |
| 6,130 % fällig am 25.01.2037 ^ | 28 | 11 | 0,00 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | |
| 2,140 % fällig am 25.09.2037 | 28 | 27 | 0,00 |
| 2,874 % fällig am 25.06.2037 ^ | 583 | 526 | 0,01 |
| 4,733 % fällig am 25.06.2037 | 1.353 | 1.189 | 0,01 |
| 4,783 % fällig am 25.06.2037 ^ | 1.639 | 1.531 | 0,01 |
| 4,783 % fällig am 25.06.2047 ^ | 1.074 | 931 | 0,01 |
| 4,833 % fällig am 25.03.2037 ^ | 732 | 641 | 0,01 |
| **Towd Point Mortgage Trust** | | | |
| 2,624 % fällig am 25.10.2059 | 7.811 | 7.694 | 0,07 |
| 3,750 % fällig am 25.05.2058 | 11.335 | 11.097 | 0,10 |
| **UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 1,014 % fällig am 10.03.2046 (a) | 66.484 | 93 | 0,00 |
| 1,687 % fällig am 10.12.2045 (a) | 38.053 | 66 | 0,00 |
| **Verus Securitization Trust** | | | |
| 1,829 % fällig am 25.10.2066 | 7.152 | 6.457 | 0,06 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 1,134 % fällig am 25.12.2046 | 22 | 20 | 0,00 |
| 1,356 % fällig am 25.10.2046 ^ | 2.435 | 2.147 | 0,02 |
| 1,456 % fällig am 25.06.2046 | 620 | 593 | 0,01 |
| 1,473 % fällig am 27.02.2034 | 82 | 80 | 0,00 |
| 1,473 % fällig am 25.01.2047 | 363 | 324 | 0,00 |
| 1,476 % fällig am 25.02.2046 | 1.610 | 1.470 | 0,01 |
| 1,476 % fällig am 25.08.2046 | 75 | 73 | 0,00 |
| 1,676 % fällig am 25.11.2042 | 36 | 34 | 0,00 |
| 1,723 % fällig am 25.10.2046 | 10 | 9 | 0,00 |
| 1,876 % fällig am 25.08.2042 | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,084 % fällig am 25.04.2045 | 18 | 17 | 0,00 |
| 2,164 % fällig am 25.12.2045 | 17 | 16 | 0,00 |
| 2,204 % fällig am 25.07.2045 | 256 | 241 | 0,00 |
| 2,204 % fällig am 25.10.2045 | 84 | 80 | 0,00 |
| 2,244 % fällig am 25.01.2045 | 160 | 155 | 0,00 |
| 2,264 % fällig am 25.01.2045 | 48 | 46 | 0,00 |
| 2,364 % fällig am 25.11.2034 | 190 | 177 | 0,00 |
| 2,368 % fällig am 25.03.2033 | 8 | 8 | 0,00 |
| 2,383 % fällig am 25.09.2033 | 13 | 12 | 0,00 |
| 2,444 % fällig am 25.11.2045 | 298 | 273 | 0,00 |
| 2,444 % fällig am 25.12.2045 | 3.676 | 3.380 | 0,03 |
| 2,462 % fällig am 25.03.2034 | 5 | 5 | 0,00 |
| 2,529 % fällig am 25.09.2033 | 6 | 6 | 0,00 |
| 2,713 % fällig am 25.12.2036 ^ | 476 | 440 | 0,01 |
| 2,716 % fällig am 25.12.2035 | 258 | 252 | 0,00 |
| 2,819 % fällig am 25.08.2035 | 27 | 25 | 0,00 |
| 2,831 % fällig am 25.09.2036 | 260 | 226 | 0,00 |
| 2,856 % fällig am 25.09.2036 ^ | 3.026 | 2.779 | 0,03 |
| 2,874 % fällig am 25.08.2034 | 70 | 69 | 0,00 |
| 3,087 % fällig am 25.03.2036 | 50 | 48 | 0,00 |
| 3,198 % fällig am 25.03.2036 ^ | 1.124 | 1.037 | 0,01 |
| 3,201 % fällig am 25.05.2037 ^ | 1.512 | 1.409 | 0,01 |
| 3,220 % fällig am 25.06.2033 | 38 | 36 | 0,00 |
| 3,340 % fällig am 25.05.2037 ^ | 1.057 | 877 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 1,416 % fällig am 25.07.2046 ^ | $ 469 | $ 305 | 0,00 |
| 2,074 % fällig am 25.04.2035 | 137 | 112 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.07.2036 ^ | 73 | 49 | 0,00 |
| **Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 3,639 % fällig am 25.06.2033 | 4 | 4 | 0,00 |
| **Wells Fargo Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,895 % fällig am 28.12.2037 ^ | 290 | 275 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.07.2037 ^ | 532 | 479 | 0,01 |
| **Wells Fargo Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 1,768 % fällig am 15.10.2045 (a) | 4.153 | 0 | 0,00 |
| | | 291.002 | 2,57 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae** | | | |
| 0,491 % fällig am 25.08.2022 (a) | 5.287 | 0 | 0,00 |
| 1,066 % fällig am 25.12.2036 | 201 | 198 | 0,00 |
| 1,356 % fällig am 25.09.2042 | 43 | 42 | 0,00 |
| 1,465 % fällig am 01.10.2034 | 2 | 2 | 0,00 |
| 1,523 % fällig am 01.06.2043 | 5 | 5 | 0,00 |
| 1,524 % fällig am 01.11.2042 - 01.10.2044 | 53 | 54 | 0,00 |
| 1,628 % fällig am 01.12.2034 | 44 | 45 | 0,00 |
| 1,664 % fällig am 01.01.2033 | 27 | 27 | 0,00 |
| 1,676 % fällig am 01.10.2034 | 20 | 19 | 0,00 |
| 1,724 % fällig am 01.09.2040 | 17 | 17 | 0,00 |
| 1,744 % fällig am 25.03.2034 | 42 | 42 | 0,00 |
| 1,774 % fällig am 25.08.2034 | 22 | 22 | 0,00 |
| 1,828 % fällig am 01.08.2033 | 23 | 23 | 0,00 |
| 1,974 % fällig am 25.03.2044 | 5 | 5 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.06.2029 - 25.06.2036 | 251 | 251 | 0,00 |
| 2,084 % fällig am 25.05.2035 | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,085 % fällig am 01.04.2033 | 38 | 39 | 0,00 |
| 2,274 % fällig am 25.09.2023 | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,295 % fällig am 01.04.2033 - 01.08.2035 | 130 | 130 | 0,00 |
| 2,383 % fällig am 01.06.2030 | 6 | 6 | 0,00 |
| 2,430 % fällig am 01.11.2034 | 322 | 335 | 0,00 |
| 2,560 % fällig am 01.08.2036 | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,633 % fällig am 01.12.2030 | 1 | 1 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 01.03.2060 | 9.441 | 8.863 | 0,08 |
| 3,248 % fällig am 01.06.2035 | 2 | 2 | 0,00 |
| 3,500 % fällig am 01.01.2059 | 27.345 | 26.569 | 0,23 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2043 - 25.07.2044 | 711 | 750 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 01.11.2036 | 80 | 80 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 01.11.2036 - 25.07.2042 | 121 | 129 | 0,00 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 0,878 % fällig am 25.09.2022 (a) | 26.820 | 15 | 0,00 |
| 1,039 % fällig am 25.11.2022 (a) | 30.318 | 55 | 0,00 |
| 1,524 % fällig am 25.02.2045 | 72 | 73 | 0,00 |
| 1,676 % fällig am 25.10.2044 | 1.009 | 1.037 | 0,01 |
| 1,774 % fällig am 15.12.2031 | 1 | 1 | 0,00 |
| 1,804 % fällig am 15.10.2040 | 1.887 | 1.890 | 0,02 |
| 1,824 % fällig am 15.06.2041 | 2.847 | 2.850 | 0,03 |
| 1,876 % fällig am 25.07.2044 | 24 | 25 | 0,00 |
| 1,878 % fällig am 01.10.2034 | 22 | 22 | 0,00 |
| 1,884 % fällig am 25.08.2031 | 1 | 1 | 0,00 |
| 1,904 % fällig am 25.09.2031 | 51 | 51 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 15.12.2037 | 68 | 69 | 0,00 |
| 1,981 % fällig am 01.08.2035 | 20 | 20 | 0,00 |
| 2,021 % fällig am 01.09.2035 | 13 | 13 | 0,00 |
| 2,344 % fällig am 01.10.2033 | 20 | 21 | 0,00 |
| 2,485 % fällig am 01.09.2037 | 130 | 135 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 01.11.2026 - 01.04.2045 | 409 | 392 | 0,00 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2026 - 01.04.2049 | 5.838 | 5.713 | 0,05 |
| 4,000 % fällig am 01.09.2024 - 01.09.2041 | 8 | 8 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 15.08.2035 - 01.12.2039 | 553 | 577 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 01.06.2037 - 01.10.2039 | 51 | 56 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 15.04.2036 | 1.424 | 1.552 | 0,01 |
| 7,000 % fällig am 01.10.2037 | 7 | 8 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Ginnie Mae** | | | |
| 1,553 % fällig am 20.01.2066 | $ 1.776 | $ 1.765 | 0,02 |
| 1,625 % fällig am 20.09.2023 - 20.09.2026 | 5 | 5 | 0,00 |
| 1,633 % fällig am 20.08.2066 | 4.449 | 4.441 | 0,04 |
| 1,750 % fällig am 20.11.2026 | 1 | 0 | 0,00 |
| 1,875 % fällig am 20.04.2027 - 20.05.2030 | 9 | 10 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 20.04.2030 | 6 | 7 | 0,00 |
| 2,625 % fällig am 20.01.2025 - 20.01.2030 | 3 | 3 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 20.07.2046 - 20.05.2047 | 484 | 475 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 15.04.2039 | 32 | 33 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 20.04.2038 | 14 | 15 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 20.08.2035 - 15.02.2039 | 187 | 199 | 0,00 |
| **Small Business Administration** | | | |
| 4,760 % fällig am 01.09.2025 | 15 | 15 | 0,00 |
| 4,840 % fällig am 01.05.2025 | 8 | 8 | 0,00 |
| 5,090 % fällig am 01.10.2025 | 8 | 8 | 0,00 |
| 5,110 % fällig am 01.04.2025 | 1 | 1 | 0,00 |
| 5,490 % fällig am 01.05.2028 | 18 | 18 | 0,00 |
| 5,600 % fällig am 01.09.2028 | 7 | 7 | 0,00 |
| 5,680 % fällig am 01.06.2028 | 4 | 4 | 0,00 |
| 6,220 % fällig am 01.12.2028 | 54 | 57 | 0,00 |
| **Tennessee Valley Authority** | | | |
| 5,880 % fällig am 01.04.2036 | 500 | 607 | 0,01 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.02.2052 | 71.575 | 62.426 | 0,55 |
| 2,500 % fällig am 01.05.2030 - 01.01.2052 | 61.170 | 55.448 | 0,50 |
| 3,000 % fällig am 01.01.2027 - 01.06.2051 | 46.239 | 43.201 | 0,38 |
| 3,500 % fällig am 01.11.2034 - 01.07.2050 | 36.945 | 36.057 | 0,32 |
| 4,000 % fällig am 01.01.2026 - 01.06.2050 | 17.272 | 17.194 | 0,15 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2023 - 01.03.2046 | 1.367 | 1.394 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 01.06.2023 - 01.11.2039 | 40 | 42 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 01.06.2036 - 01.06.2037 | 13 | 14 | 0,00 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.07.2052 | 526.638 | 457.188 | 4,04 |
| 3,000 % fällig am 01.08.2052 | 130.700 | 121.633 | 1,07 |
| 3,500 % fällig am 01.07.2037 - 01.08.2052 | 1.028.300 | 988.534 | 8,72 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 592.958 | 584.011 | 5,16 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2052 | 5.500 | 5.511 | 0,05 |
| | | 2.432.573 | 21,47 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | |
| 1,375 % fällig am 15.11.2040 | 61.050 | 43.992 | 0,39 |
| 1,625 % fällig am 15.11.2050 (l) | 171.110 | 120.422 | 1,06 |
| 1,875 % fällig am 15.02.2041 | 320.000 | 251.106 | 2,22 |
| 1,875 % fällig am 15.02.2051 | 100 | 75 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 15.08.2051 | 7.100 | 5.491 | 0,05 |
| 2,875 % fällig am 15.05.2052 | 26.900 | 25.414 | 0,23 |
| 3,250 % fällig am 15.05.2042 | 200 | 195 | 0,00 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (f)** | | | |
| 0,375 % fällig am 15.01.2027 | 41.882 | 41.744 | 0,37 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2027 | 154 | 153 | 0,00 |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028 | 83.934 | 83.405 | 0,74 |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 | 8.867 | 8.936 | 0,08 |
| 1,750 % fällig am 15.01.2028 | 24.422 | 25.936 | 0,23 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2027 | 1.433 | 1.557 | 0,01 |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 | 54.257 | 60.349 | 0,53 |
| 3,875 % fällig am 15.04.2029 | 34.815 | 42.059 | 0,37 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | |
| 2,000 % fällig am 30.11.2022 | 5.228 | 5.220 | 0,04 |
| 2,875 % fällig am 31.10.2023 | 990 | 989 | 0,01 |
| 2,875 % fällig am 30.04.2025 | 96.500 | 96.108 | 0,85 |
| | | 813.151 | 7,18 |
| Summe USA | | 4.782.880 | 42,22 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | |
| 51,049 % fällig am 30.09.2022 (d)(e) | ARS 253.200 | $ 849 | 0,01 |
| **FRANCE TREASURY BILLS** | | | |
| (0,448) % fällig am 14.09.2022 (d)(e) | € 400 | 419 | 0,00 |
| **ISRAEL TREASURY BILLS** | | | |
| 0,493 % fällig am 08.02.2023 (d)(e) | ILS 365.200 | 103.585 | 0,91 |
| 0,753 % fällig am 05.04.2023 (d)(e) | 88.200 | 24.973 | 0,22 |
| 0,875 % fällig am 03.05.2023 (d)(e) | 75.100 | 21.211 | 0,19 |
| 0,913 % fällig am 05.04.2023 (d)(e) | 65.600 | 18.574 | 0,16 |
| 0,950 % fällig am 05.04.2023 (d)(e) | 21.900 | 6.201 | 0,06 |
| | | 174.544 | 1,54 |
| **JAPAN TREASURY BILLS** | | | |
| (0,166) % fällig am 20.09.2022 (d)(e) | ¥ 2.025.800 | 14.916 | 0,13 |
| (0,136) % fällig am 20.09.2022 (d)(e) | 6.544.200 | 48.187 | 0,43 |
| | | 63.103 | 0,56 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 238.915 | 2,11 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | **$ 11.492.136** | **101,46** |
| | **AKTIEN** | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Global Bond Ex-US Fund (h)** | 10.956.929 | 106.282 | 0,94 |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (h)** | 1.355.380 | 13.249 | 0,11 |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - UK Corporate Bond Fund (h)** | 7.715.431 | 84.892 | 0,75 |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (h)** | 325.909 | 3.243 | 0,03 |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)** | 4.554.098 | 45.304 | 0,40 |
| **PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (h)** | 345.274 | 4.696 | 0,04 |
| | | 257.666 | 2,27 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (h)** | 3.455.880 | 350.969 | 3,10 |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (h)** | 5.291.340 | 523.562 | 4,63 |
| | | 874.531 | 7,73 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$ 1.132.197** | **10,00** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | 1,530 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 404.800 | U.S. Treasury Bonds 3,375 % fällig am 15.11.2048 | $ (153.125) | $ 404.800 | $ 404.817 | 3,58 |
| | | | | | U.S. Treasury Notes 1,125 % fällig am 15.02.2031 | (262.902) | | | |
| CIB | 1,450 | 29.06.2022 | 06.07.2022 | 150.000 | U.S. Treasury Notes 0,500 % fällig am 30.04.2027 | (154.654) | 150.000 | 150.042 | 1,32 |
| FICC | 0,400 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 31.921 | U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | (32.560) | 31.921 | 31.921 | 0,28 |
| MEI | 1,400 | 27.06.2022 | 06.07.2022 | CAD 200.000 | Canada Treasury Bills 0,000 % fällig am 29.09.2022 | (158.253) | 155.045 | 155.114 | 1,37 |
| RCY | 1,480 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 13.400 | U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2024 | (13.686) | 13.400 | 13.401 | 0,12 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (775.180)** | **$ 755.166** | **$ 755.295** | **6,67** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month SOFR June Futures | Long | 09.2023 | 1.040 | $ 1.033 | 0,01 |
| Australia Government 3-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 1.037 | (796) | (0,01) |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 1.336 | 280 | 0,00 |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 754 | (1.765) | (0,02) |
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09.2022 | 6.014 | (9.344) | (0,08) |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09.2022 | 481 | (1.473) | (0,01) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 1.642 | (9.356) | (0,08) |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 14 | 161 | 0,00 |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 5.099 | 829 | 0,01 |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 139 | (21) | 0,00 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 2.841 | (1.356) | (0,01) |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 10.711 | 3.858 | 0,03 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 4.947 | 12.560 | 0,11 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2022 | 4.565 | (2.947) | (0,03) |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 11 | (52) | 0,00 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09.2022 | 2.161 | (8.398) | (0,07) |
| | | | | $ (16.787) | (0,15) |

## VERKAUFSOPTIONEN

### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CME Kaufoptionen mit Ausübungskurs von @ USD 98,000 auf 3-Month SOFR December Futures | $ 98,000 | 15.12.2023 | 222 | $ 0 | $ (179) | 0,00 |
| Call - CME Verkaufoptionen mit Ausübungskurs von @ USD 96,500 auf 3-Month SOFR December Futures | 96,500 | 15.12.2023 | 222 | 0 | (274) | 0,00 |
| | | | | $ 0 | $ (453) | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ (17.240)** | **(0,15)** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 5.900 | $ (69) | 0,00 |
| Barclays Bank PLC | 1,000 | 20.12.2022 | € 6.000 | (27) | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.12.2027 | 5.700 | (110) | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.06.2028 | 5.700 | (197) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.06.2026 | $ 800 | (4) | 0,00 |
| Jaguar Land Rover Automotive PLC | 5,000 | 20.06.2026 | € 17.500 | (3.650) | (0,03) |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.12.2024 | 7.400 | (343) | (0,01) |
| Shell International Finance BV | 1,000 | 20.12.2026 | 8.900 | (133) | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 | 20.06.2025 | 2.900 | 94 | 0,00 |
| | | | | $ (4.439) | (0,04) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[2]

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-36 5-Year Index | (5,000) % | 20.06.2026 | $ 97.243 | $ 10.028 | 0,09 |
| CDX.IG-37 10-Year Index | (1,000) | 20.12.2031 | 78.800 | 988 | 0,01 |
| CDX.IG-38 10-Year Index | (1,000) | 20.06.2032 | 311.200 | 3.272 | 0,03 |
| | | | | $ 14.288 | 0,13 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-38 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2027 | $ 33.500 | $ (322) | 0,00 |
| iTraxx Crossover 37 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2027 | € 39.100 | (2.739) | (0,03) |
| iTraxx Europe Main 36 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 32.800 | (225) | 0,00 |
| iTraxx Europe Main 37 10-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 48.500 | (613) | (0,01) |
| | | | | $ (3.899) | (0,04) |

## ZINSSWAPS - BASISSWAPS

| Zahlung variabler Zinssatzindex | Erhalt variabler Zinssatzindex | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month USD-LIBOR | 1-Month USD-LIBOR + 0,086 % | 12.04.2023 | $ 400 | $ 0 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR | 1-Month USD-LIBOR + 0,073 % | 27.04.2023 | 339.800 | 45 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR | 1-Month USD-LIBOR + 0,070 % | 07.03.2024 | 110.900 | (7) | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR[4] | 1-Month USD-LIBOR + 0,088 % | 06.09.2024 | 611.900 | 143 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR[4] | 1-Month USD-LIBOR + 0,105 % | 27.09.2024 | 350.000 | 123 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR[4] | 1-Month USD-LIBOR + 0,102 % | 04.10.2024 | 300.600 | 151 | 0,00 |
| | | | | $ 455 | 0,00 |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,010 % | 07.02.2023 | £ 579.800 | $ (10.339) | (0,09) |
| Erhalt[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 | 21.09.2024 | 158.200 | 747 | 0,01 |
| Zahlung[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 | 21.09.2027 | 67.800 | (2.296) | (0,02) |
| Zahlung[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2032 | 212.700 | (7.157) | (0,06) |
| Zahlung[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2052 | 31.900 | 92 | 0,00 |
| Zahlung[4] | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 5,750 | 15.03.2024 | INR 87.075.800 | (3.505) | (0,03) |
| Erhalt | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 5,750 | 16.03.2027 | 18.562.540 | 197 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 6,250 | 16.03.2032 | 1.797.200 | (68) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 17.03.2031 | ¥ 14.710.000 | (3.248) | (0,03) |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,050 | 15.12.2031 | 19.980.000 | (1.114) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,200 | 19.06.2029 | 6.440.000 | (1.780) | (0,02) |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,400 | 19.06.2039 | 13.160.000 | 6.754 | 0,06 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,800 | 15.06.2052 | 4.750.000 | 2.090 | 0,02 |
| Erhalt | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 1,250 | 16.03.2024 | SGD 688.320 | 4.259 | 0,04 |
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 1,250 | 15.09.2031 | 510 | (10) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 2,250 | 15.06.2032 | 12.140 | (276) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 2,500 | 15.06.2032 | 9.700 | (149) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 2,750 | 15.06.2027 | 120.300 | 242 | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 3,000 | 15.06.2027 | 132.900 | 1.218 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 0,250 | 15.12.2023 | $ 71.100 | 2.319 | 0,02 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 0,500 | 15.06.2024 | 177.500 | (5.649) | (0,05) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 | 15.06.2029 | 145.400 | (5.416) | (0,05) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,250 | 15.12.2028 | 58.224 | (5.142) | (0,05) |
| Erhalt[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,320 | 21.12.2023 | 4.604.000 | 75.825 | 0,67 |
| Zahlung[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,430 | 31.03.2024 | 256.050 | (7.101) | (0,06) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,488 | 15.08.2031 | 25.600 | (2.600) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,500 | 15.06.2052 | 53.800 | (11.054) | (0,10) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,618 | 09.02.2029 | 21.600 | (1.349) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,695 | 15.11.2031 | 422.100 | (37.153) | (0,33) |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2027 | 1.291.620 | 6.921 | 0,06 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2032 | 94.090 | (982) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2052 | 26.100 | (144) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,817 | 05.04.2032 | 103.500 | (7.801) | (0,07) |
| Erhalt[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,850 | 21.04.2024 | 894.700 | 1.037 | 0,01 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,888 | 22.03.2029 | 63.800 | (3.052) | (0,03) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,175 | 21.04.2029 | 61.700 | (1.944) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,370 | 21.06.2027 | 82.900 | (1.234) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,400 | 21.06.2024 | 248.400 | (2.351) | (0,02) |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,703 | 22.06.2052 | 14.700 | (180) | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,792 | 23.06.2052 | 9.300 | (281) | 0,00 |
| Zahlung[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,886 | 15.05.2032 | 534.500 | 5.664 | 0,05 |
| Erhalt[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,965 | 30.11.2026 | 1.139.100 | (6.504) | (0,06) |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,004 % | 30.06.2024 | $ | 160.600 | $ (333) | 0,00 |
| Zahlung[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,005 | 15.05.2032 | | 40.100 | 651 | 0,01 |
| Zahlung[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,026 | 30.06.2024 | | 69.800 | (119) | 0,00 |
| Erhalt[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,059 | 30.11.2026 | | 116.800 | (1.002) | (0,01) |
| Zahlung[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,486 | 30.06.2024 | | 113.400 | 680 | 0,01 |
| Zahlung[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,527 | 30.06.2024 | | 111.800 | 747 | 0,01 |
| Zahlung[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,531 | 30.06.2024 | | 148.400 | 1.002 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,235 | 04.03.2025 | CAD | 57.400 | (2.653) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,250 | 16.06.2031 | | 37.200 | (903) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,500 | 17.06.2025 | | 84.100 | (3.023) | (0,03) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,500 | 17.06.2030 | | 207.300 | (21.818) | (0,19) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,713 | 02.10.2029 | | 81.100 | (7.431) | (0,07) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,900 | 18.12.2029 | | 107.300 | (10.486) | (0,09) |
| Zahlung[4] | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,000 | 14.11.2023 | | 171.800 | (2.189) | (0,02) |
| Zahlung[4] | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,060 | 28.10.2023 | | 360.350 | (4.451) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,500 | 28.01.2052 | | 14.500 | (2.154) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 3,028 | 25.03.2052 | | 21.700 | (1.585) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,283 | 14.02.2027 | CHF | 47.600 | (1.718) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,294 | 10.02.2027 | | 19.900 | (660) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,295 | 17.02.2027 | | 25.500 | (908) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,300 | 15.02.2027 | | 45.100 | (1.588) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,343 | 16.05.2027 | | 31.300 | (1.219) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,368 | 15.06.2027 | | 200.700 | (7.582) | (0,07) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,500 | 15.09.2026 | | 350.350 | (22.981) | (0,20) |
| Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,500 | 16.03.2027 | CNY | 904.100 | (1.254) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 3,000 | 15.06.2032 | KRW | 38.248.600 | (743) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 3,250 | 15.06.2032 | | 14.534.600 | (84) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month NZD-BBR | 0,110 | 16.12.2023 | NZD | 600 | (20) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month NZD-BBR | 0,528 | 17.03.2024 | | 10.000 | (356) | 0,00 |
| Zahlung[4] | 3-Month NZD-BBR | 3,000 | 01.11.2023 | | 324.700 | (2.558) | (0,02) |
| Zahlung[4] | 3-Month NZD-BBR | 3,000 | 15.12.2023 | | 370.050 | (2.858) | (0,03) |
| Zahlung | 3-Month NZD-BBR | 3,750 | 15.06.2027 | | 102.300 | 86 | 0,00 |
| Zahlung[4] | 3-Month NZD-BBR | 4,000 | 14.06.2024 | | 624.400 | 702 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month SEK-STIBOR | 0,500 | 19.06.2024 | SEK | 260.100 | (1.578) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month SEK-STIBOR | 1,000 | 19.06.2029 | | 56.700 | (813) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,250 | 30.03.2023 | $ | 63.900 | (1.372) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,400 | 15.01.2028 | | 578.050 | (72.978) | (0,65) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,500 | 15.12.2023 | | 14.100 | (521) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,500 | 16.06.2028 | | 59.180 | (5.261) | (0,05) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,750 | 16.12.2022 | | 315.375 | (6.261) | (0,06) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,750 | 15.12.2024 | | 1.200 | (60) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,249 | 31.08.2024 | | 179.400 | 6.769 | 0,06 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 15.12.2026 | | 542.300 | 47.366 | 0,42 |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 1,270 | 04.11.2023 | | 1.330.700 | 15.894 | 0,14 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,298 | 25.08.2024 | | 155.100 | 5.670 | 0,05 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,305 | 21.08.2023 | | 180.550 | 3.348 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,306 | 21.08.2023 | | 3.950 | 196 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,360 | 17.09.2024 | | 53.950 | 1.974 | 0,02 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 15.12.2028 | | 233.690 | (24.424) | (0,22) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,518 | 20.01.2029 | | 17.800 | (1.502) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,545 | 20.01.2029 | | 3.000 | (248) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,630 | 20.01.2029 | | 63.600 | (4.909) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,630 | 26.01.2029 | | 14.700 | (1.137) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 15.12.2051 | | 94.300 | (25.322) | (0,22) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,250 | 20.06.2023 | ZAR | 263.900 | 47 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 1,250 | 17.06.2030 | AUD | 128.300 | 20.362 | 0,18 |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 1,750 | 16.03.2027 | | 92.600 | (5.371) | (0,05) |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,913 | 30.01.2029 | CZK | 158.300 | (1.282) | (0,01) |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,054 | 27.05.2050 | € | 7.450 | 2.973 | 0,03 |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,064 | 17.11.2052 | | 17.650 | 8.054 | 0,07 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2027 | | 531.900 | (25.242) | (0,22) |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | | 1.331.460 | (82.045) | (0,72) |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2024 | | 377.822 | (2.990) | (0,03) |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2052 | | 187.760 | 36.795 | 0,32 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 12.04.2027 | | 34.400 | (1.582) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 11.05.2027 | | 24.400 | (1.125) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,700 | 11.04.2027 | | 19.200 | (845) | (0,01) |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 30.03.2024 | | 76.900 | (394) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 13.05.2027 | | 41.000 | (1.326) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.05.2027 | | 18.100 | (590) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 4,870 | 07.07.2025 | MXN | 393.200 | (2.324) | (0,02) |
| Zahlung | UKRPI | 3,700 | 15.04.2031 | £ | 49.050 | (8.509) | (0,08) |
| Zahlung | UKRPI | 3,740 | 15.03.2031 | | 28.100 | (4.315) | (0,04) |
| | | | | | | $ (256.200) | (2,26) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | | **$ (249.795)** | **(2,21)** |

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

(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 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,180 % | 11.01.2024 | 49.700 | $ 1.420 | $ 3.584 | 0,03 |

### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Put - OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052 | € 97,000 | 23.05.2025 | 26.800 | $ 2.027 | $ 9.296 | 0,08 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 % | 20.07.2022 | 6.500 | $ (10) | $ (5) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Crossover 36 5-Year Index | Verkauf | 5,250 | 20.07.2022 | 17.100 | (178) | (339) | (0,01) |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 31.200 | (144) | (68) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 56.500 | (161) | (185) | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 29.100 | (53) | (12) | 0,00 |
| BRC | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 3.500 | (32) | (39) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 41.600 | (188) | (90) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 12.100 | (18) | (9) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 33.300 | (64) | (38) | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,300 | 17.08.2022 | 16.700 | (37) | (27) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 95,000 | 17.08.2022 | 6.000 | (73) | (91) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 8.200 | (73) | (92) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,100 | 20.07.2022 | 60.100 | (228) | (229) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,250 | 20.07.2022 | 8.400 | (14) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,350 | 17.08.2022 | 24.400 | (55) | (33) | 0,00 |
| | | | | | | $ (1.328) | $ (1.261) | (0,01) |

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,150 % | 01.12.2023 | 31.200 | $ (97) | $ (123) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,650 | 01.12.2023 | 31.200 | (97) | (104) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,310 | 11.01.2024 | 441.600 | (1.424) | (3.698) | (0,04) |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,310 | 19.08.2022 | 59.800 | (512) | (154) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,010 | 19.08.2022 | 59.800 | (512) | (562) | (0,01) |
| BPS | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 11.04.2023 | 47.000 | (47) | (27) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 11.04.2023 | 47.000 | (143) | (176) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 28.04.2023 | 32.900 | (57) | (25) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 28.04.2023 | 32.900 | (57) | (112) | 0,00 |
| | Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,451 | 23.05.2025 | 26.800 | (2.027) | (9.260) | (0,08) |
| CBK | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,690 | 02.04.2024 | 33.700 | (265) | (242) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,690 | 02.04.2024 | 33.700 | (265) | (221) | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 01.09.2022 | 72.800 | (608) | (426) | (0,01) |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 01.09.2022 | 72.800 | (608) | (728) | (0,01) |
| DUB | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,920 | 13.10.2023 | 19.700 | (119) | (136) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,920 | 13.10.2023 | 19.700 | (119) | (111) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,790 | 08.04.2024 | 39.000 | (300) | (302) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,790 | 08.04.2024 | 39.000 | (300) | (240) | 0,00 |
| | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,350 | 08.08.2022 | 12.500 | (49) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,550 | 08.08.2022 | 12.500 | (49) | (249) | 0,00 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 02.09.2022 | 67.650 | (348) | (300) | (0,01) |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 02.09.2022 | 67.650 | (348) | (473) | (0,01) |
| FAR | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,688 | 02.04.2024 | 14.400 | (113) | (103) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,688 | 02.04.2024 | 14.400 | (113) | (94) | 0,00 |
| GLM | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,870 | 02.11.2022 | 1.330.700 | (2.650) | (14) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,270 | 02.11.2022 | 1.330.700 | (2.650) | (30.499) | (0,27) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,920 | 13.10.2023 | 12.100 | (74) | (83) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,920 | 13.10.2023 | 12.100 | (74) | (68) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,018 | 20.10.2023 | 13.000 | (84) | (98) | 0,00 |

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,018 % | 20.10.2023 | 13.000 | $ (84) | $ (68) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,140 | 23.10.2023 | 14.200 | (100) | (117) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,140 | 23.10.2023 | 14.200 | (100) | (68) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,190 | 23.10.2023 | 13.700 | (95) | (117) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,190 | 23.10.2023 | 13.700 | (95) | (63) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,225 | 23.10.2023 | 14.200 | (98) | (124) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,225 | 23.10.2023 | 14.200 | (98) | (64) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,973 | 25.10.2023 | 17.400 | (120) | (128) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,973 | 25.10.2023 | 17.400 | (120) | (94) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,841 | 27.10.2023 | 14.900 | (102) | (99) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,841 | 27.10.2023 | 14.900 | (102) | (89) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,088 | 03.11.2023 | 10.800 | (78) | (87) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,088 | 03.11.2023 | 10.800 | (78) | (54) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,910 | 10.11.2023 | 25.900 | (172) | (186) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,910 | 10.11.2023 | 25.900 | (172) | (147) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 17.11.2023 | 38.900 | (141) | (163) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 17.11.2023 | 38.900 | (141) | (119) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,150 | 20.11.2023 | 24.600 | (86) | (94) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,650 | 20.11.2023 | 24.600 | (86) | (81) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 07.12.2023 | 22.800 | (71) | (100) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 07.12.2023 | 22.800 | (71) | (71) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,697 | 02.04.2024 | 6.300 | (49) | (45) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,697 | 02.04.2024 | 6.300 | (49) | (41) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,721 | 08.04.2024 | 15.300 | (115) | (113) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,721 | 08.04.2024 | 15.300 | (115) | (98) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 05.04.2023 | 103.300 | (192) | (59) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 05.04.2023 | 103.300 | (192) | (382) | (0,01) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 11.04.2023 | 171.700 | (334) | (98) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 11.04.2023 | 171.700 | (334) | (642) | (0,01) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 24.04.2023 | 32.200 | (35) | (25) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 24.04.2023 | 32.200 | (91) | (108) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 26.04.2023 | 38.500 | (68) | (30) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 26.04.2023 | 38.500 | (68) | (131) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 15.05.2023 | 55.200 | (97) | (32) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 15.05.2023 | 55.200 | (97) | (221) | 0,00 |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,370 | 18.08.2022 | 38.500 | (262) | (124) | 0,00 |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,070 | 18.08.2022 | 38.500 | (262) | (243) | 0,00 |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 06.09.2022 | 11.300 | (71) | (65) | 0,00 |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 06.09.2022 | 11.300 | (71) | (93) | 0,00 |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 | 07.09.2022 | 31.000 | (195) | (210) | 0,00 |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,100 | 07.09.2022 | 31.000 | (195) | (232) | 0,00 |
| JPM | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 0,820 | 16.12.2024 | 123.600 | (873) | (359) | (0,01) |
| MYC | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,993 | 11.10.2023 | 9.500 | (64) | (69) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,993 | 11.10.2023 | 9.500 | (64) | (51) | 0,00 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,150 | 12.07.2022 | 63.500 | (495) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | $ (20.707) | $ (54.233) | (0,48) |

## ZINSCAPS

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYC | Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor | 1-Year USD-LIBOR | 0,000 % | 07.10.2022 | 256.250 | $ (264) | $ 0 | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor | 1-Year USD-LIBOR | 0,000 | 08.10.2022 | 117.500 | (116) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (380) | $ 0 | 0,00 |

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SAL | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | $ 94,688 | 07.09.2022 | 33.000 | $ (196) | $ (170) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 98,234 | 07.09.2022 | 14.900 | (84) | (65) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 100,234 | 07.09.2022 | 14.900 | (67) | (120) | 0,00 |
| | | | | | $ (347) | $ (355) | 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 | South Korea Government International Bond | (1,000) % | 20.06.2023 | $ 22.300 | $ (544) | $ 334 | $ (210) | 0,00 |
| BRC | China Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 37.000 | (706) | 345 | (361) | 0,00 |
| | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 48.550 | (1.225) | 768 | (457) | (0,01) |
| GST | China Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 10.700 | (207) | 103 | (104) | 0,00 |
| HUS | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 34.100 | (851) | 530 | (321) | 0,00 |
| JPM | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 11.200 | (268) | 162 | (106) | 0,00 |
| | | | | | $ (3.801) | $ 2.242 | $ (1.559) | (0,01) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Italy Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2025 | $ 11.810 | $ (285) | $ 354 | $ 69 | 0,00 |
| BRC | Italy Government International Bond | 1,000 | 20.06.2025 | 17.350 | (421) | 504 | 83 | 0,00 |
| CBK | Italy Government International Bond | 1,000 | 20.06.2025 | 4.020 | (97) | 100 | 3 | 0,00 |
| FBF | Italy Government International Bond | 1,000 | 20.06.2025 | 8.200 | (200) | 248 | 48 | 0,00 |
| GST | Abu Dhabi Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 7.400 | 217 | (109) | 108 | 0,00 |
| | | | | | $ (786) | $ 1.097 | $ 311 | 0,00 |

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

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

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

## CROSS-CURRENCY SWAPS

| Kontrahent | Erhalt | Zahlung | Fälligkeits-datum | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,290 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 04.01.2031 | AUD 106.300 | $ 80.086 | $ 526 | $ (352) | $ 174 | 0,00 |
| CBK | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,420 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 31.07.2029 | 105.500 | 72.795 | (26) | 32 | 6 | 0,00 |
| GLM | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,423 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 01.08.2029 | 101.200 | 69.828 | (205) | 39 | (166) | 0,00 |
| MYC | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,298 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 14.10.2030 | 65.900 | 47.343 | 286 | (209) | 77 | 0,00 |
| | | | | | | $ 581 | $ (490) | $ 91 | 0,00 |

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Erhalt | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,250 % | 16.03.2032 | MYR | 424.600 | $ 1.422 | $ 5.202 | $ 6.624 | 0,06 |
| | Erhalt | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,500 | 16.03.2032 | | 1.100 | 0 | 12 | 12 | 0,00 |
| | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 4,000 | 15.06.2027 | | 95.100 | (252) | 427 | 175 | 0,00 |
| | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 4,250 | 15.06.2027 | | 198.000 | 510 | 392 | 902 | 0,01 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,000 | 16.03.2032 | THB | 196.200 | 30 | (452) | (422) | (0,01) |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,000 | 15.06.2032 | | 634.000 | (72) | (1.387) | (1.459) | (0,01) |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,750 | 15.06.2032 | | 603.800 | (209) | (11) | (220) | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,250 | 15.06.2032 | | 218.700 | 33 | 169 | 202 | 0,00 |
| BPS | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,000 | 15.06.2032 | | 10.000 | (3) | (20) | (23) | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,250 | 15.06.2032 | | 12.700 | 2 | 10 | 12 | 0,00 |
| CBK | Erhalt | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,500 | 16.03.2032 | MYR | 11.200 | (19) | 138 | 119 | 0,00 |
| GLM | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 4,000 | 15.06.2027 | | 80.500 | (159) | 307 | 148 | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,000 | 15.06.2032 | THB | 318.300 | (19) | (714) | (733) | (0,01) |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,250 | 15.06.2032 | | 128.500 | 23 | 96 | 119 | 0,00 |
| JPM | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,000 | 15.06.2032 | | 637.000 | (69) | (1.397) | (1.466) | (0,01) |
| MBC | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,000 | 15.06.2032 | | 176.300 | (47) | (359) | (406) | 0,00 |
| SCX | Erhalt | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,500 | 16.03.2032 | MYR | 29.600 | (92) | 407 | 315 | 0,00 |
| | | | | | | | $ 1.079 | $ 2.820 | $ 3.899 | 0,03 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | $ | 5.782 | AUD | 8.317 | $ 0 | $ (63) | $ (63) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.697 | NZD | 4.267 | 0 | (44) | (44) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 8.317 | $ | 5.783 | 63 | 0 | 63 | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | CHF | 4.536 | | 4.609 | 0 | (129) | (129) | 0,00 |
| | 07.2022 | CZK | 41.793 | | 1.759 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 8.189 | AUD | 11.798 | 0 | (76) | (76) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 6.986 | CAD | 9.036 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 31.046 | CHF | 29.667 | 0 | (57) | (57) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 331.900 | DKK | 2.333.407 | 0 | (3.868) | (3.868) | (0,03) |
| | 07.2022 | | 33.611 | € | 31.692 | 0 | (478) | (478) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.785 | £ | 1.462 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.217 | ¥ | 166.000 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 18.190 | NZD | 29.186 | 0 | (44) | (44) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 12.600 | PEN | 50.923 | 767 | 0 | 767 | 0,01 |
| | 07.2022 | | 7.990 | ZAR | 122.596 | 0 | (513) | (513) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 11.798 | $ | 8.191 | 76 | 0 | 76 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 2.328.674 | | 331.900 | 3.941 | 0 | 3.941 | 0,03 |
| | 08.2022 | MXN | 7.311 | | 360 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | NZD | 29.656 | | 18.477 | 43 | 0 | 43 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 243 | IDR | 3.572.716 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 09.2022 | PEN | 11.723 | $ | 3.035 | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| | 12.2022 | | 117.011 | | 30.628 | 295 | 0 | 295 | 0,00 |
| | 05.2023 | CNH | 208.936 | | 32.298 | 1.075 | 0 | 1.075 | 0,01 |
| BPS | 07.2022 | AUD | 2.209 | | 1.526 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | CAD | 15.065 | | 11.815 | 136 | 0 | 136 | 0,00 |
| | 07.2022 | CHF | 12.016 | | 12.543 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07.2022 | CZK | 8.063 | | 340 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK | 122.435 | | 17.406 | 194 | 0 | 194 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 58.366 | | 61.478 | 459 | 0 | 459 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 66.163 | | 3.292 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 07.2022 | NZD | 8.115 | | 5.113 | 67 | 0 | 67 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.592 | AUD | 2.278 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 31.872 | BRL | 154.461 | 0 | (2.335) | (2.335) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 3.887 | CAD | 5.037 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 22.604 | CHF | 21.940 | 315 | (2) | 313 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.852 | CLP | 2.511.636 | 0 | (177) | (177) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 57.471 | DKK | 402.850 | 39 | (877) | (838) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 128.781 | € | 122.322 | 0 | (900) | (900) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 26.805 | £ | 21.526 | 0 | (663) | (663) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 418.648 | ¥ | 56.423.300 | 49 | (3.377) | (3.328) | (0,03) |
| | 07.2022 | | 3.458 | MXN | 72.330 | 127 | 0 | 127 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.417 | NZD | 2.244 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 486 | ZAR | 7.610 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 666.076 | $ | 45 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | MXN | 147.894 | | 6.733 | 0 | (551) | (551) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 4.925 | PEN | 18.817 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 30 | THB | 1.052 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | ZAR | 1.788 | $ | 112 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 3.244 | MXN | 66.163 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 218 | TWD | 6.067 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 2.025 | $ | 126 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 02.2023 | ILS | 60.216 | | 18.238 | 773 | 0 | 773 | 0,01 |
| | 03.2023 | CNH | 57.650 | | 8.930 | 321 | 0 | 321 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | NOK | 1.062.819 | | 108.414 | 838 | 0 | 838 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 7.662 | £ | 6.264 | 0 | (55) | (55) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 235.394 | ¥ | 31.931.228 | 0 | (355) | (355) | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 732.814 | $ | 50 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 31.879.370 | | 235.394 | 346 | 0 | 346 | 0,00 |
| | 08.2022 | SGD | 40.127 | | 29.055 | 220 | 0 | 220 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 108.414 | NOK | 1.062.353 | 0 | (830) | (830) | (0,01) |
| | 09.2022 | | 42.076 | MYR | 184.749 | 0 | (181) | (181) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | BRL | 137.338 | $ | 26.631 | 369 | 0 | 369 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 5.972 | DKK | 41.975 | 0 | (72) | (72) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 9.598 | € | 8.939 | 0 | (252) | (252) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 3.247 | £ | 2.640 | 0 | (41) | (41) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 7 | ILS | 23 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 4.593 | NZD | 7.366 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN | 30.293 | $ | 7.756 | 0 | (191) | (191) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 26.422 | BRL | 137.338 | 0 | (386) | (386) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 5.624 | CLP | 4.952.641 | 0 | (374) | (374) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 9.041 | PEN | 34.044 | 0 | (114) | (114) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 725 | THB | 25.721 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 10.2022 | PEN | 16.726 | $ | 4.232 | 0 | (123) | (123) | 0,00 |
| | 10.2022 | $ | 8.172 | MXN | 171.567 | 184 | 0 | 184 | 0,00 |
| | 12.2022 | PEN | 367.725 | $ | 87.554 | 0 | (7.822) | (7.822) | (0,07) |
| | 02.2023 | ILS | 303.164 | | 91.819 | 3.889 | 0 | 3.889 | 0,03 |
| | 04.2023 | | 65.101 | | 19.947 | 995 | 0 | 995 | 0,01 |
| | 05.2023 | CNH | 17.100 | | 2.644 | 89 | 0 | 89 | 0,00 |
| | 05.2023 | ILS | 74.477 | | 22.667 | 950 | 0 | 950 | 0,01 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| DUB | 07.2022 | CHF | 21.334 | $ | 22.460 | $ 175 | $ 0 | $ 175 | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK | 732.253 | | 108.434 | 5.493 | 0 | 5.493 | 0,05 |
| | 07.2022 | RON | 1.313 | | 280 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 730 | PLN | 3.183 | 0 | (23) | (23) | 0,00 |
| | 08.2022 | THB | 676.340 | $ | 19.476 | 319 | 0 | 319 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 22.460 | CHF | 21.299 | 0 | (174) | (174) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 11 | TWD | 317 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 12.2022 | | 10.774 | ZAR | 169.275 | 0 | (606) | (606) | (0,01) |
| | 05.2023 | CNH | 6.227 | $ | 963 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | CAD | 100.000 | | 77.387 | 0 | (135) | (135) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 21.622 | CLP | 17.952.931 | 0 | (2.500) | (2.500) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 5.562 | MXN | 113.352 | 55 | (8) | 47 | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN | 50.000 | $ | 13.325 | 218 | 0 | 218 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 5.854 | CNH | 39.241 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 9.005 | MYR | 39.354 | 0 | (80) | (80) | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 735 | $ | 46 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 03.2023 | CNH | 123.686 | | 19.153 | 682 | 0 | 682 | 0,01 |
| IND | 09.2022 | $ | 10.227 | MXN | 207.000 | 0 | (89) | (89) | 0,00 |
| | 05.2023 | CNH | 330.343 | $ | 51.075 | 1.709 | 0 | 1.709 | 0,01 |
| JPM | 07.2022 | CAD | 107.164 | | 83.064 | 145 | (157) | (12) | 0,00 |
| | 07.2022 | CHF | 1.428 | | 1.463 | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| | 07.2022 | CZK | 348 | | 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 644.079 | | 31.668 | 0 | (198) | (198) | 0,00 |
| | 07.2022 | PEN | 13.326 | | 3.634 | 136 | 0 | 136 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 924 | AUD | 1.343 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 8.149 | DKK | 57.870 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 5.010 | £ | 3.977 | 0 | (180) | (180) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.915 | ¥ | 260.012 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 1.343 | $ | 924 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 104.505 | | 15.533 | 0 | (48) | (48) | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 556.302.608 | | 37.518 | 364 | 0 | 364 | 0,00 |
| | 08.2022 | ILS | 91.605 | | 28.317 | 2.123 | 0 | 2.123 | 0,02 |
| | 08.2022 | KRW | 64.091.723 | | 50.349 | 937 | 0 | 937 | 0,01 |
| | 08.2022 | SGD | 322.065 | | 234.298 | 2.865 | 0 | 2.865 | 0,03 |
| | 08.2022 | $ | 4.313 | CNH | 28.946 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 18.953 | IDR | 276.194.824 | 0 | (506) | (506) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 78.009 | SGD | 108.172 | 0 | (277) | (277) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 125 | TWD | 3.694 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 258 | | 7.184 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 10.2022 | COP | 108.663 | $ | 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 04.2023 | ILS | 109.354 | | 32.969 | 1.136 | 0 | 1.136 | 0,01 |
| MBC | 07.2022 | AUD | 36.355 | | 25.194 | 195 | 0 | 195 | 0,00 |
| | 07.2022 | CAD | 6.298 | | 4.988 | 106 | 0 | 106 | 0,00 |
| | 07.2022 | CHF | 5.917 | | 6.136 | 0 | (45) | (45) | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 2.426.287 | | 2.616.498 | 79.938 | 0 | 79.938 | 0,71 |
| | 07.2022 | £ | 6.019 | | 7.375 | 65 | 0 | 65 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 6.167 | | 299 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07.2022 | NZD | 37.156 | | 24.200 | 1.098 | 0 | 1.098 | 0,01 |
| | 07.2022 | SEK | 23.200 | | 2.376 | 112 | 0 | 112 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 110.019 | AUD | 159.749 | 0 | (168) | (168) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.497 | CAD | 1.945 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 15.488 | DKK | 105.985 | 4 | (592) | (588) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 2.444.328 | € | 2.323.726 | 113 | (15.104) | (14.991) | (0,13) |
| | 07.2022 | | 46.418 | ¥ | 6.282.500 | 0 | (173) | (173) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 159.749 | $ | 110.034 | 159 | 0 | 159 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 328.066 | | 48.856 | 0 | (57) | (57) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 2.284.634 | | 2.407.805 | 14.922 | 0 | 14.922 | 0,13 |
| | 08.2022 | $ | 18.066 | IDR | 264.878.150 | 0 | (375) | (375) | 0,00 |
| | 05.2023 | CNH | 350.028 | $ | 52.157 | 0 | (145) | (145) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | BRL | 17.122 | | 3.321 | 47 | 0 | 47 | 0,00 |
| | 07.2022 | CHF | 800 | | 819 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK | 2.650.010 | | 392.635 | 20.105 | (10) | 20.095 | 0,18 |
| | 07.2022 | € | 87 | | 91 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 5.079 | | 6.138 | 1 | (31) | (30) | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 1.242.500 | | 9.516 | 370 | 0 | 370 | 0,00 |
| | 07.2022 | SEK | 6 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | SGD | 58 | | 42 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.376 | CAD | 1.784 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 3.154 | CHF | 3.026 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 65.951 | DKK | 464.032 | 0 | (717) | (717) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 2.273 | € | 2.166 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.304 | £ | 1.074 | 2 | (2) | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 47.103 | ¥ | 6.413.106 | 102 | 0 | 102 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 0 | NOK | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 162 | SGD | 225 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 463.092 | $ | 65.951 | 732 | 0 | 732 | 0,01 |
| | 08.2022 | IDR | 824.355 | | 56 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 6.402.720 | | 47.103 | 0 | (104) | (104) | 0,00 |
| | 08.2022 | KRW | 82.851.220 | | 65.045 | 1.171 | 0 | 1.171 | 0,01 |
| | 08.2022 | THB | 1.649.945 | | 47.890 | 1.155 | 0 | 1.155 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 3.295 | BRL | 17.122 | 0 | (49) | (49) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 961 | CNY | 6.453 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08.2022 | $ | 17 | IDR | 246.504 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 37 | TWD | 1.098 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 8.039 | MYR | 35.286 | 0 | (37) | (37) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 105 | TWD | 2.933 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| RBC | 07.2022 | | 8.164 | CAD | 10.496 | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 10.497 | $ | 8.164 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | NOK | 2.925 | | 299 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | SEK | 3.330 | | 329 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 10.514 | £ | 8.643 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | CHF | 7.720 | $ | 7.987 | 20 | (97) | (77) | 0,00 |
| | 07.2022 | ILS | 83.506 | | 24.770 | 915 | 0 | 915 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 7.006 | AUD | 10.188 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.111 | CHF | 2.035 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 16.268 | £ | 13.272 | 9 | (159) | (150) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 46.509 | ¥ | 6.320.153 | 75 | (62) | 13 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.393 | NZD | 2.208 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 10.188 | $ | 7.008 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 536.017 | | 80.017 | 100 | 0 | 100 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 4.868.647 | | 35.820 | 0 | (77) | (77) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 1.543 | CNY | 10.329 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 116 | ZAR | 1.788 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 09.2022 | MYR | 1.042.144 | $ | 248.149 | 11.856 | 0 | 11.856 | 0,10 |
| | 09.2022 | $ | 107.219 | MYR | 473.925 | 238 | 0 | 238 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 9.985 | ZAR | 154.363 | 0 | (629) | (629) | (0,01) |
| | 11.2022 | COP | 21.748.119 | $ | 5.117 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 12.2022 | PEN | 41.264 | | 9.855 | 0 | (851) | (851) | (0,01) |
| | 03.2023 | CNH | 70.401 | | 10.906 | 393 | 0 | 393 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | $ | 11.699 | DKK | 82.970 | 0 | (35) | (35) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | AUD | 906 | $ | 657 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| | 07.2022 | CAD | 38.667 | | 30.273 | 298 | 0 | 298 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 901.405 | | 1.136.419 | 41.708 | 0 | 41.708 | 0,37 |
| | 07.2022 | ¥ | 116.952.357 | | 921.409 | 60.548 | 0 | 60.548 | 0,53 |
| | 07.2022 | $ | 1.790 | AUD | 2.601 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 24.639 | CAD | 31.697 | 5 | (71) | (66) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 58.520 | ¥ | 7.783.900 | 0 | (1.225) | (1.225) | (0,01) |
| | 08.2022 | AUD | 2.601 | $ | 1.791 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 31.699 | | 24.639 | 71 | (5) | 66 | 0,00 |
| | 09.2022 | ¥ | 8.570.000 | | 64.173 | 753 | 0 | 753 | 0,01 |
| UAG | 07.2022 | AUD | 157.854 | | 112.754 | 4.205 | 0 | 4.205 | 0,04 |
| | 07.2022 | CHF | 4.101 | | 4.243 | 0 | (41) | (41) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2.172 | DKK | 15.295 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 113.060 | NOK | 1.066.086 | 0 | (5.154) | (5.154) | (0,05) |
| | 09.2022 | | 5.375 | MXN | 107.098 | 0 | (129) | (129) | 0,00 |
| | 10.2022 | | 336 | | 6.877 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 11.2022 | | 281 | ZAR | 4.384 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 1.624 | $ | 104 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | | | | | | $ 274.822 | $ (56.452) | $ 218.370 | 1,93 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | $ | 16.732 | CAD | 21.234 | $ 0 | $ (271) | $ (271) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | | 16.867 | | 21.388 | 0 | (286) | (286) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | CAD | 848 | $ | 653 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 16.861 | CAD | 21.367 | 0 | (297) | (297) | (0,01) |
| | | | | | | $ 0 | $ (858) | $ (858) | (0,01) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend, Class W CHF (Hedged) thesaurierend und Class W CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | CHF | 3.393 | $ | 3.409 | $ 0 | $ (135) | $ (135) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 309.684 | CHF | 295.932 | 0 | (569) | (569) | (0,01) |
| BPS | 07.2022 | CHF | 1.708 | $ | 1.756 | 1 | (29) | (28) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 6.026 | CHF | 5.780 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | | 309.474 | | 296.221 | 0 | (56) | (56) | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | CHF | 281.908 | $ | 296.786 | 2.319 | 0 | 2.319 | 0,02 |
| | 07.2022 | $ | 300.191 | CHF | 287.938 | 575 | 0 | 575 | 0,01 |
| | 08.2022 | | 296.786 | | 281.440 | 0 | (2.300) | (2.300) | (0,02) |
| JPM | 07.2022 | CHF | 155 | $ | 159 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | $ | 668 | CHF | 646 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | CHF | 7.580 | $ | 7.865 | 2 | (55) | (53) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 16 | CHF | 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | CHF | 230 | $ | 237 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | | | | | | $ 2.916 | $ (3.150) | $ (234) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional GBP (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) ausschüttend, E Class USD (Currency Exposure) thesaurierend, E Class USD (Currency Exposure) ausschüttend, H Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend, W Class USD (Currency Exposure) thesaurierend und W Class USD (Currency Exposure) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | AUD | 4.803 | $ | 3.339 | $ 36 | $ 0 | $ 36 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 3.340 | AUD | 4.803 | 0 | (36) | (36) | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | AUD | 8.203 | $ | 5.695 | 54 | 0 | 54 | 0,00 |
| | 07.2022 | COP | 124 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK | 5.309 | | 755 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 653 | | 691 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 07.2022 | SGD | 47 | | 34 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 609 | € | 567 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 35.063 | £ | 27.732 | 0 | (1.385) | (1.385) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 267 | HUF | 98.023 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 551 | IDR | 8.015.501 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1 | SGD | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 5.696 | AUD | 8.203 | 0 | (54) | (54) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 755 | DKK | 5.298 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 34 | SGD | 47 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | AUD | 570 | $ | 396 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07.2022 | CAD | 1.077 | | 833 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | CNY | 409.655 | | 61.083 | 3 | (90) | (87) | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 152.330 | | 160.246 | 992 | 0 | 992 | 0,01 |
| | 07.2022 | £ | 1.678 | | 2.061 | 28 | (4) | 24 | 0,00 |
| | 07.2022 | IDR | 44.464.511 | | 2.991 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 07.2022 | ILS | 3.022 | | 877 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 872.417 | | 6.548 | 127 | 0 | 127 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 29.824 | | 1.475 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 3.037 | CHF | 2.913 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 530 | CNY | 3.561 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 911 | DKK | 6.424 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.292 | € | 2.151 | 0 | (43) | (43) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 57.256 | CNY | 384.078 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 150.279 | € | 142.618 | 0 | (904) | (904) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 2.991 | IDR | 44.488.951 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 876 | ILS | 3.016 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.466 | MXN | 29.824 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | | 910 | ILS | 3.021 | 0 | (48) | (48) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 803 | ¥ | 107.297 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | € | 2.456 | $ | 2.636 | 69 | 0 | 69 | 0,00 |
| | 07.2022 | PLN | 3 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | THB | 4 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | TWD | 4.109 | | 141 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 456 | CZK | 10.520 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.498 | IDR | 36.360.170 | 0 | (60) | (60) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 8.000 | KRW | 9.892.744 | 0 | (380) | (380) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 1.494 | MXN | 29.825 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | € | 2.406 | $ | 2.511 | 4 | (8) | (4) | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 171.983 | | 1.287 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 641 | AUD | 887 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 788 | CAD | 995 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 424 | € | 401 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 0 | HUF | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 649 | NOK | 6.072 | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 923 | NZD | 1.414 | 0 | (43) | (43) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.180 | PLN | 5.051 | 0 | (56) | (56) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.987 | SEK | 29.161 | 0 | (141) | (141) | 0,00 |
| IND | 07.2022 | | 538 | MYR | 2.356 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | AUD | 96 | $ | 66 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | CZK | 13 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 1 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 727 | CNY | 4.841 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 66 | AUD | 96 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | COP | 2.356.741 | $ | 584 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 07.2022 | MYR | 10.007 | | 2.277 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07.2022 | PLN | 5.045 | | 1.132 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 07.2022 | SGD | 1.537 | | 1.106 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 590 | COP | 2.356.865 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.740 | MYR | 7.651 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 581 | COP | 2.356.671 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 2.276 | MYR | 10.007 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.132 | PLN | 5.065 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.106 | SGD | 1.537 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | DKK | 1.114 | $ | 158 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 85.126 | | 652 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 472 | CHF | 453 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 0 | SGD | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 158 | DKK | 1.112 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | | 138 | TWD | 4.109 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 4.109 | $ | 139 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SCX | 07.2022 | AUD | 729 | $ | 501 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | KRW | 10.312.177 | | 7.948 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 61.218 | CNY | 408.395 | 0 | (237) | (237) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 96.315 | ¥ | 12.373.959 | 0 | (5.233) | (5.233) | (0,05) |
| | 07.2022 | | 598 | KRW | 742.098 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.134 | SGD | 1.550 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 502 | AUD | 729 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 7.948 | KRW | 10.307.885 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | £ | 26.054 | $ | 31.708 | 66 | 0 | 66 | 0,00 |
| | 07.2022 | HUF | 5 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 166.281 | € | 154.708 | 0 | (4.542) | (4.542) | (0,04) |
| | 07.2022 | | 4 | IDR | 53.100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 17 | KRW | 20.743 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 31.722 | £ | 26.054 | 0 | (66) | (66) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | AUD | 186 | $ | 128 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 20.930 | CAD | 26.733 | 0 | (206) | (206) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 128 | AUD | 186 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | CZK | 10.507 | $ | 447 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | HUF | 97.944 | | 261 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 2 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | PLN | 6 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | THB | 69.976 | | 1.992 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 9.840 | AUD | 13.776 | 0 | (367) | (367) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 0 | HUF | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 62 | SGD | 85 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.052 | THB | 69.980 | 0 | (72) | (72) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 447 | CZK | 10.545 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 261 | HUF | 98.404 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.994 | THB | 69.976 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | | | | | | $ 1.560 | $ (14.335) | $ (12.775) | (0,11) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, G Retail EUR (Hedged) ausschüttend, Class R EUR (Hedged) thesaurierend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend, Class W EUR (Hedged) thesaurierend und Class W EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | € | 268 | $ | 288 | $ 8 | $ 0 | $ 8 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 343 | € | 324 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | € | 1.252.542 | $ | 1.317.590 | 8.119 | 0 | 8.119 | 0,07 |
| | 07.2022 | $ | 5.924 | € | 5.596 | 0 | (74) | (74) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.271.255 | | 1.206.448 | 0 | (7.644) | (7.644) | (0,07) |
| CBK | 07.2022 | € | 755 | $ | 806 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 4.896 | € | 4.560 | 0 | (129) | (129) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | € | 1.209.807 | $ | 1.272.730 | 7.937 | 0 | 7.937 | 0,07 |
| | 07.2022 | $ | 1.355.399 | € | 1.257.035 | 22 | (41.254) | (41.232) | (0,36) |
| | 08.2022 | | 1.271.491 | | 1.206.448 | 0 | (7.880) | (7.880) | (0,07) |
| SOG | 07.2022 | | 1.347.414 | | 1.253.632 | 0 | (36.804) | (36.804) | (0,33) |
| UAG | 07.2022 | | 1.140.095 | | 1.060.947 | 0 | (30.928) | (30.928) | (0,27) |
| | | | | | | $ 16.103 | $ (124.717) | $ (108.614) | (0,96) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) thesaurierend, Class W GBP (Hedged) thesaurierend und Class W GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | £ | 703 | $ | 884 | $ 31 | $ 0 | $ 31 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 145.829 | £ | 115.361 | 0 | (5.729) | (5.729) | (0,05) |
| BPS | 07.2022 | £ | 3.960 | $ | 4.848 | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 5.326 | £ | 4.260 | 0 | (152) | (152) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | £ | 262 | $ | 321 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 146.486 | £ | 116.158 | 0 | (5.418) | (5.418) | (0,05) |
| CBK | 07.2022 | | 1.041 | | 829 | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | £ | 2.802 | $ | 3.531 | 128 | 0 | 128 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.187 | £ | 967 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | | 323 | | 267 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | £ | 403 | $ | 495 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | | 112.355 | | 136.736 | 286 | 0 | 286 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 136.799 | £ | 112.355 | 0 | (284) | (284) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | | 145.165 | | 115.144 | 0 | (5.328) | (5.328) | (0,04) |
| | | | | | | $ 493 | $ (16.957) | $ (16.464) | (0,14) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Institutional NOK (Hedged) thesaurierend, Investor NOK (Hedged) thesaurierend, Class E NOK (Hedged) thesaurierend und Class W NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | $ | 140.315 | NOK | 1.324.359 | $ 0 | $ (6.267) | $ (6.267) | (0,05) |
| BPS | 07.2022 | NOK | 6.490 | $ | 656 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | | 1.062.418 | | 108.373 | 838 | 0 | 838 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 140.334 | NOK | 1.321.942 | 0 | (6.530) | (6.530) | (0,06) |
| | 08.2022 | | 108.373 | | 1.061.952 | 0 | (830) | (830) | (0,01) |
| CBK | 07.2022 | | 136.374 | | 1.285.137 | 0 | (6.296) | (6.296) | (0,06) |
| MBC | 07.2022 | | 1.737 | | 16.253 | 0 | (92) | (92) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | NOK | 156 | $ | 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1 | NOK | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | NOK | 432.570 | $ | 44.194 | 410 | 0 | 410 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 32 | NOK | 319 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 0 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 1.248 | $ (20.016) | $ (18.768) | (0,17) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional NZD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | NZD | 5.606 | $ | 3.564 | $ 78 | $ 0 | $ 78 | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | | 60.663 | | 37.808 | 91 | 0 | 91 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 37.797 | NZD | 60.663 | 0 | (88) | (88) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | NZD | 10.837 | $ | 6.943 | 205 | 0 | 205 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 41.265 | NZD | 63.616 | 0 | (1.712) | (1.712) | (0,01) |
| | 07.2022 | $ | 46.804 | NZD | 71.864 | 0 | (2.123) | (2.123) | (0,02) |
| JPM | 07.2022 | | 44.107 | | 67.370 | 0 | (2.219) | (2.219) | (0,02) |
| MBC | 07.2022 | NZD | 160 | $ | 99 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | NZD | 415 | $ | 267 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | | | | | | $ 384 | $ (6.142) | $ (5.758) | (0,05) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Institutional SEK (Hedged) thesaurierend, Administrative SEK (Hedged) thesaurierend, M Retail SEK (Hedged) thesaurierend und W Class SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | $ | 34 | SEK | 337 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | SEK | 7.311 | $ | 722 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 168 | SEK | 1.698 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | SEK | 354.078 | $ | 34.845 | 292 | 0 | 292 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 34.845 | SEK | 353.785 | 0 | (287) | (287) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | | 940 | | 9.265 | 0 | (36) | (36) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | | 16 | | 155 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | | 98 | | 996 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 39.012 | | 381.260 | 0 | (1.807) | (1.807) | (0,02) |
| SOG | 07.2022 | | 34.270 | | 336.441 | 0 | (1.438) | (1.438) | (0,01) |
| TOR | 07.2022 | | 37.097 | | 363.161 | 0 | (1.658) | (1.658) | (0,01) |
| | | | | | | $ 301 | $ (5.232) | $ (4.931) | (0,04) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | SGD | 25.561 | $ | 18.393 | $ 26 | $ 0 | $ 26 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 39.071 | SGD | 53.533 | 0 | (606) | (606) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 18.393 | | 25.561 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | SGD | 51.265 | $ | 36.899 | 63 | 0 | 63 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 41 | SGD | 57 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 36.899 | | 51.266 | 0 | (62) | (62) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | SGD | 1.481 | $ | 1.068 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 254 | SGD | 351 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 49 | | 68 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | | 1.008 | | 1.383 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 40.833 | | 55.805 | 0 | (734) | (734) | (0,01) |
| UAG | 07.2022 | | 42.321 | | 57.950 | 0 | (681) | (681) | (0,01) |
| | | | | | | $ 93 | $ (2.125) | $ (2.032) | (0,02) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **$ 7.709** | **0,07** |

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Ginnie Mae, TBA** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.07.2052 | $ 7.500 | $ (7.469) | (0,07) |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.07.2037 | 199.400 | (186.174) | (1,64) |
| 2,000 % fällig am 01.07.2052 (j) | 782.450 | (679.265) | (6,00) |
| 2,000 % fällig am 01.08.2052 | 636.338 | (551.824) | (4,87) |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 | 237.950 | (214.062) | (1,89) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (1.638.794)** | **(14,47)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 11.481.379** | **101,37** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (155.632)** | **(1,37)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 11.325.747** | **100,00** |

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

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

**^** **Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a)** **Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

**(b)** **Wertpapier per Emissionstermin.**

**(c)** **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

**(d)** **Nullkuponwertpapier.**

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

**(f)** **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

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

**(h)** **Mit dem Fonds verbunden.**

**(i)** **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(j)** **Zum 30. Juni 2022 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.**

**(k)** **Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeits-datum | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Citigroup, Inc. | 3,290 % | 17.03.2026 | 10.03.2022 | $ 33.100 | $ 32.040 | 0,28 |
| Citigroup, Inc. | 3,785 | 17.03.2033 | 11.03.2022 | 14.522 | 13.077 | 0,12 |
| Deutsche Bank AG | 3,729 | 14.01.2032 | 21.01.2021 | 2.005 | 1.505 | 0,01 |
| Oracle Corp. | 2,875 | 25.03.2031 | 08.11.2021 | 516 | 412 | 0,00 |
| Oracle Corp. | 3,950 | 25.03.2051 | 08.11.2021 | 109 | 74 | 0,00 |
| | | | | $ 50.252 | $ 47.108 | 0,41 |

**(l)** **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 241.692 als Sicherheiten verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von USD 283.835 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 157,230 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 11.487.839 | $ 4.297 | $ 11.492.136 |
| Investmentfonds | 608.635 | 523.562 | 0 | 1.132.197 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 755.166 | 0 | 755.166 |
| Finanzderivate[3] | (29.883 ) | (229.443) | 0 | (259.326) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (1.638.794) | 0 | (1.638.794) |
| **Summen** | **$ 578.752** | **$ 10.898.330** | **$ 4.297** | **$ 11.481.379** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 15.285.257 | $ 4.396 | $ 15.289.653 |
| Investmentfonds | 1.197.100 | 0 | 0 | 1.197.100 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 3.378 | 0 | 3.378 |
| Finanzderivate[3] | 31.388 | (30.588) | 0 | 800 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (1.368.631) | 0 | (1.368.631) |
| **Summen** | **$ 1.228.488** | **$ 13.889.416** | **$ 4.396** | **$ 15.122.300** |

(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 2022:**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | (5,000) % | 23.05.2022 | 19.05.2024 | € (10.400) | $ (10.797) | (0,10) |
| | (0,570) | 14.02.2022 | 15.08.2022 | (218.702) | (228.128) | (2,01) |
| JML | (0,950) | 13.04.2022 | 08.04.2024 | (613) | (640) | (0,01) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (239.565)** | **(2,12)** |

**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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ 207 | $ 400 | $ 607 |
| BOA | (9.713) | 9.280 | (433) |
| BPS | (8.390) | 10.130 | 1.740 |
| BRC | (12.874) | 11.460 | (1.414) |
| CBK | (11.299) | 10.880 | (419) |
| DUB | 3.963 | (5.490) | (1.527) |
| FAR | (197) | 0 | (197) |
| FBF | 48 | 0 | 48 |
| GLM | (38.313) | 39.610 | 1.297 |
| GST | (23) | (10) | (33) |
| HUS | (321) | 420 | 99 |
| IND | 1.617 | (1.460) | 157 |
| JPM | 1.715 | (1.740) | (25) |
| MBC | 35 733 | (31.940) | 3 793 |
| MYC | (80) | (270) | (350) |
| MYI | 22.739 | (21.940) | 799 |
| RYL | 399 | (160) | 239 |
| SAL | (355) | 130 | (225) |
| SCX | 3.941 | (2.740) | 1.201 |
| SOG | (42.818) | 44.220 | 1.402 |
| TOR | 94.924 | (101.150) | (6.226) |
| UAG | (33.194) | 30.350 | (2.844) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 61,99 | 83,24 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 38,32 | 24,75 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 1,15 | 0,92 |
| Investmentfonds | 10,00 | 8,53 |
| Pensionsgeschäfte | 6,67 | 0,02 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,15) | 0,27 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (2,21) | (0,29) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,07 | 0,03 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (14,47) | (9,75) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (2,12) | (8,31) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Argentinien | k. A. | 0,00 |
| Australien | 1,77 | 2,40 |
| Österreich | 0,07 | 0,08 |
| Brasilien | 0,02 | 0,02 |
| Kanada | 0,86 | 2,16 |
| Cayman-Inseln | 2,44 | 3,35 |
| China | 1,07 | 6,68 |
| Tschechische Republik | 0,00 | 0,00 |
| Dänemark | 3,48 | 3,91 |
| Finnland | 0,01 | 0,01 |
| Frankreich | 3,43 | 3,07 |
| Deutschland | 2,02 | 2,65 |
| Hongkong | 0,30 | 0,40 |
| Ungarn | 0,00 | 0,06 |
| Indien | 0,07 | 0,10 |
| Irland | 5,74 | 4,63 |
| Israel | 1,05 | 1,47 |
| Italien | 1,44 | 2,46 |
| Japan | 8,23 | 14,06 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,08 | 0,08 |
| Kasachstan | 0,01 | 0,01 |
| Kuwait | k. A. | 0,29 |
| Litauen | k. A. | 0,07 |
| Luxemburg | 0,68 | 0,75 |
| Malaysia | 0,76 | 1,60 |
| Mauritius | 0,05 | 0,04 |
| Mexiko | 0,12 | 0,12 |
| Multinational | 0,10 | 0,13 |
| Niederlande | 2,46 | 2,11 |
| Neuseeland | 0,21 | 0,20 |
| Norwegen | 0,27 | 0,14 |
| Peru | 1,21 | 1,07 |
| Portugal | 0,01 | 0,01 |
| Katar | 0,43 | 0,66 |
| Rumänien | 0,44 | 0,44 |
| Russland | k. A. | 0,08 |
| Saudi-Arabien | 0,17 | 0,47 |
| Serbien | 0,22 | 0,27 |
| Singapur | 1,63 | 0,97 |
| Slowenien | 0,19 | 0,38 |
| Südafrika | 0,04 | 0,08 |
| Südkorea | 0,96 | 0,95 |
| Spanien | 1,11 | 3,23 |
| Supranational | 0,21 | 0,11 |
| Schweden | 0,00 | 0,00 |
| Schweiz | 1,18 | 1,00 |
| Thailand | 0,61 | k. A. |
| Vereinigte Arabische Emirate | 0,20 | 0,35 |
| Großbritannien | 11,78 | 12,71 |
| USA | 42,22 | 31,58 |
| Kurzfristige Instrumente | 2,11 | 1,50 |
| Investmentfonds | 10,00 | 8,53 |
| Pensionsgeschäfte | 6,67 | 0,02 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,15) | 0,27 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | 0,00 | k. A. |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,04) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | 0,13 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,04) | k. A. |
| Zinsswaps — Basisswaps | 0,00 | 0,00 |
| Zinsswaps | (2,26) | (0,29) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoptionen | 0,03 | 0,01 |
| Optionen auf Wertpapiere | 0,08 | 0,03 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,01) | 0,00 |
| Devisenoptionen | k. A. | (0,01) |
| Zinsswapoptionen | (0,48) | (0,17) |
| Zinscaps | 0,00 | 0,00 |
| Optionen auf Wertpapiere | 0,00 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf | (0,01) | (0,02) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,00 | 0,00 |
| Cross-Currency Swaps | 0,00 | 0,00 |
| Zinsswaps | 0,03 | 0,01 |
| Total Return Swaps auf Wertpapiere | k. A. | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | 1,93 | (0,38) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (1,50) | 0,56 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (14,47) | (9,75) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (1,37) | (7,72) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **Aegon Bank NV** | | | | |
| 0,625 % fällig am 21.06.2024 | € | 2.800 | $ 2.835 | 0,13 |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 1,650 % fällig am 29.10.2024 | $ | 1.000 | 924 | 0,04 |
| 2,193 % fällig am 29.09.2023 | | 1.700 | 1.677 | 0,08 |
| **Alexandria Real Estate Equities, Inc.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 18.05.2032 | | 9.000 | 7.119 | 0,33 |
| 2,950 % fällig am 15.03.2034 | | 6.400 | 5.335 | 0,25 |
| **Asian Development Bank** | | | | |
| 1,500 % fällig am 04.05.2028 | CAD | 11.700 | 8.094 | 0,37 |
| 4,700 % fällig am 12.03.2024 | MXN | 79.400 | 3.593 | 0,17 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.08.2025 | $ | 1.000 | 952 | 0,04 |
| **Banco de Sabadell S.A.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 11.03.2027 | € | 2.700 | 2.587 | 0,12 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 1,849 % fällig am 25.03.2026 | $ | 400 | 360 | 0,02 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,652 % fällig am 24.08.2025 | € | 1.700 | 1.763 | 0,08 |
| 0,822 % fällig am 22.09.2026 | | 8.000 | 8.253 | 0,38 |
| 2,687 % fällig am 22.04.2032 | $ | 2.000 | 1.681 | 0,08 |
| **Bank of Ireland Group PLC** | | | | |
| 1,875 % fällig am 05.06.2026 | € | 2.400 | 2.388 | 0,11 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (f) | $ | 3.450 | 3.485 | 0,16 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 0,625 % fällig am 14.11.2023 | € | 2.300 | 2.402 | 0,11 |
| 2,375 % fällig am 06.10.2023 | £ | 400 | 485 | 0,02 |
| 3,125 % fällig am 17.01.2024 | | 1.200 | 1.438 | 0,07 |
| 4,375 % fällig am 12.01.2026 | $ | 2.900 | 2.875 | 0,13 |
| 7,125 % fällig am 15.06.2025 (d)(f) | £ | 1.100 | 1.285 | 0,06 |
| 8,000 % fällig am 15.06.2024 (d)(f) | $ | 2.100 | 2.068 | 0,10 |
| **BlueHub Loan Fund, Inc.** | | | | |
| 2,890 % fällig am 01.01.2027 | | 900 | 799 | 0,04 |
| 3,099 % fällig am 01.01.2030 | | 1.900 | 1.728 | 0,08 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 2,219 % fällig am 09.06.2026 | | 3.600 | 3.328 | 0,15 |
| 2,871 % fällig am 19.04.2032 | | 1.600 | 1.324 | 0,06 |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 18.09.2022 | | 200 | 200 | 0,01 |
| **Brookfield Finance, Inc.** | | | | |
| 2,724 % fällig am 15.04.2031 | | 3.350 | 2.835 | 0,13 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 0,625 % fällig am 21.01.2028 | € | 3.600 | 3.368 | 0,15 |
| 3,625 % fällig am 14.09.2028 (d)(f) | | 2.200 | 1.590 | 0,07 |
| **Caja Rural de Navarra SCC** | | | | |
| 0,875 % fällig am 08.05.2025 | | 2.000 | 2.043 | 0,09 |
| **Castellum AB** | | | | |
| 2,125 % fällig am 20.11.2023 | | 700 | 711 | 0,03 |
| **Castellum Helsinki Finance Holding Abp** | | | | |
| 0,875 % fällig am 17.09.2029 | | 3.500 | 2.494 | 0,11 |
| **CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund** | | | | |
| 0,900 % fällig am 12.10.2029 | | 7.200 | 5.964 | 0,27 |
| **Charles Schwab Corp.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 18.03.2024 | $ | 500 | 480 | 0,02 |
| **Community Preservation Corp.** | | | | |
| 2,867 % fällig am 01.02.2030 | | 3.300 | 2.941 | 0,14 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 3,649 % fällig am 06.04.2028 | | 4.100 | 3.898 | 0,18 |
| 3,758 % fällig am 06.04.2033 | | 1.600 | 1.446 | 0,07 |
| **Coventry Building Society** | | | | |
| 0,010 % fällig am 07.07.2028 | € | 600 | 555 | 0,03 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 27.01.2031 | | 2.700 | 1.877 | 0,09 |
| 1,625 % fällig am 23.04.2027 | | 1.200 | 1.004 | 0,05 |
| 1,750 % fällig am 14.01.2030 | | 5.200 | 3.854 | 0,18 |
| 2,750 % fällig am 22.01.2028 | £ | 1.000 | 939 | 0,04 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,250 % fällig am 05.01.2026 | € | 900 | 844 | 0,04 |
| 0,450 % fällig am 19.05.2025 | | 1.300 | 1.270 | 0,06 |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (f) | $ | 3.800 | 3.809 | 0,18 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 2,875 % fällig am 02.04.2032 | € | 8.100 | $ 7.134 | 0,33 |
| 3,750 % fällig am 26.03.2025 | $ | 250 | 242 | 0,01 |
| 3,869 % fällig am 12.01.2029 | | 2.000 | 1.799 | 0,08 |
| 4,194 % fällig am 01.04.2031 | | 1.800 | 1.595 | 0,07 |
| 4,550 % fällig am 17.04.2026 | | 2.200 | 2.154 | 0,10 |
| **CTP NV** | | | | |
| 0,500 % fällig am 21.06.2025 | € | 3.100 | 2.765 | 0,13 |
| 0,625 % fällig am 27.09.2026 | | 1.200 | 1.002 | 0,05 |
| 0,875 % fällig am 20.01.2026 | | 1.300 | 1.138 | 0,05 |
| 1,250 % fällig am 21.06.2029 | | 3.900 | 2.849 | 0,13 |
| 1,500 % fällig am 27.09.2031 | | 1.100 | 698 | 0,03 |
| **Derwent London PLC** | | | | |
| 1,875 % fällig am 17.11.2031 | £ | 5.000 | 4.938 | 0,23 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,050 % fällig am 20.11.2024 | € | 3.300 | 3.326 | 0,15 |
| 1,375 % fällig am 17.02.2032 | | 1.800 | 1.439 | 0,07 |
| 1,625 % fällig am 20.01.2027 | | 2.100 | 1.969 | 0,09 |
| 1,750 % fällig am 19.11.2030 | | 2.800 | 2.418 | 0,11 |
| 1,875 % fällig am 23.02.2028 | | 16.400 | 15.486 | 0,71 |
| 2,222 % fällig am 18.09.2024 | $ | 1.500 | 1.447 | 0,07 |
| 2,625 % fällig am 16.12.2024 | £ | 600 | 694 | 0,03 |
| 2,625 % fällig am 12.02.2026 | € | 300 | 302 | 0,01 |
| 3,300 % fällig am 16.11.2022 | $ | 1.900 | 1.900 | 0,09 |
| 3,547 % fällig am 18.09.2031 | | 500 | 419 | 0,02 |
| 4,100 % fällig am 13.01.2026 | | 4.200 | 4.127 | 0,19 |
| 4,625 % fällig am 30.10.2027 (d)(f) | € | 1.000 | 807 | 0,04 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 17.01.2025 | | 1.100 | 1.124 | 0,05 |
| **Digital Dutch Finco BV** | | | | |
| 0,625 % fällig am 15.07.2025 | | 2.100 | 2.024 | 0,09 |
| 1,000 % fällig am 15.01.2032 | | 3.750 | 2.799 | 0,13 |
| **Digital Euro Finco LLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 16.01.2026 | | 1.100 | 1.108 | 0,05 |
| **Digital Intrepid Holding BV** | | | | |
| 0,625 % fällig am 15.07.2031 | | 3.000 | 2.219 | 0,10 |
| **DNB Bank ASA** | | | | |
| 0,375 % fällig am 18.01.2028 | | 4.000 | 3.772 | 0,17 |
| **DNB Boligkreditt A/S** | | | | |
| 0,625 % fällig am 19.06.2025 | | 1.600 | 1.628 | 0,07 |
| 3,250 % fällig am 28.06.2023 | $ | 1.400 | 1.399 | 0,06 |
| **Doctors Co. An Interinsurance Exchange** | | | | |
| 4,500 % fällig am 18.01.2032 | | 600 | 527 | 0,02 |
| **EQT AB** | | | | |
| 2,375 % fällig am 06.04.2028 | € | 5.000 | 4.773 | 0,22 |
| **Equinix, Inc.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.05.2031 | $ | 5.500 | 4.462 | 0,21 |
| **Erste Group Bank AG** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.10.2027 (d)(f) | € | 600 | 496 | 0,02 |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.07.2027 | AUD | 5.000 | 2.913 | 0,13 |
| 2,700 % fällig am 12.01.2023 | | 3.600 | 2.476 | 0,11 |
| 3,300 % fällig am 03.02.2028 | | 1.000 | 656 | 0,03 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 0,010 % fällig am 30.04.2024 | € | 3.200 | 3.292 | 0,15 |
| 0,579 % fällig am 07.02.2025 | | 5.200 | 5.412 | 0,25 |
| 3,000 % fällig am 15.03.2024 | $ | 5.900 | 5.827 | 0,27 |
| **HAT Holdings LLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.06.2026 | | 10.940 | 9.437 | 0,43 |
| **Host Hotels & Resorts LP** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.12.2029 | | 5.700 | 4.830 | 0,22 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 04.12.2024 | € | 4.100 | 4.243 | 0,19 |
| 2,804 % fällig am 24.05.2032 | $ | 10.000 | 8.222 | 0,38 |
| 2,999 % fällig am 10.03.2026 | | 300 | 286 | 0,01 |
| 3,019 % fällig am 15.06.2027 | € | 5.300 | 5.476 | 0,25 |
| 3,033 % fällig am 22.11.2023 | $ | 2.000 | 1.991 | 0,09 |
| 3,973 % fällig am 22.05.2030 | | 200 | 184 | 0,01 |
| 4,300 % fällig am 08.03.2026 | | 1.600 | 1.586 | 0,07 |
| 5,875 % fällig am 28.09.2026 (d)(f) | £ | 590 | 653 | 0,03 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 2,125 % fällig am 23.05.2026 | € | 8.200 | 8.352 | 0,38 |
| 3,875 % fällig am 16.05.2027 (d)(f) | $ | 1.600 | 1.167 | 0,05 |
| 4,875 % fällig am 16.05.2029 (d)(f) | | 1.300 | 1.065 | 0,05 |
| 5,750 % fällig am 16.11.2026 (d)(f) | | 800 | 733 | 0,03 |
| **Inter-American Development Bank** | | | | |
| 2,500 % fällig am 14.04.2027 | AUD | 600 | 382 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung** | | | | |
| 2,250 % fällig am 17.01.2023 | CAD | 3.700 | $ 2.861 | 0,13 |
| **International Development Association** | | | | |
| 1,750 % fällig am 05.05.2037 | € | 4.000 | 3.831 | 0,18 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 0,750 % fällig am 04.12.2024 | | 1.400 | 1.404 | 0,06 |
| 5,875 % fällig am 01.09.2031 (d)(f) | | 700 | 572 | 0,03 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 2,595 % fällig am 24.02.2026 | $ | 3.900 | 3.711 | 0,17 |
| 3,797 % fällig am 23.07.2024 | | 3.500 | 3.489 | 0,16 |
| 4,565 % fällig am 14.06.2030 | | 5.100 | 5.011 | 0,23 |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 10.661 | 1.116 | 0,05 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 113.071 | 12.547 | 0,58 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **KBC Group NV** | | | | |
| 0,875 % fällig am 27.06.2023 | € | 400 | 416 | 0,02 |
| **Kilroy Realty LP** | | | | |
| 2,650 % fällig am 15.11.2033 | $ | 5.600 | 4.341 | 0,20 |
| 4,750 % fällig am 15.12.2028 | | 1.000 | 981 | 0,05 |
| **Kookmin Bank** | | | | |
| 0,052 % fällig am 15.07.2025 | € | 2.100 | 2.086 | 0,10 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 0,250 % fällig am 23.02.2026 | | 5.800 | 5.426 | 0,25 |
| 1,375 % fällig am 07.03.2024 | | 1.350 | 1.387 | 0,06 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 3,574 % fällig am 07.11.2028 | $ | 600 | 562 | 0,03 |
| 3,900 % fällig am 12.03.2024 | | 500 | 497 | 0,02 |
| 4,550 % fällig am 16.08.2028 | | 300 | 293 | 0,01 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 0,625 % fällig am 17.11.2025 | € | 3.500 | 3.268 | 0,15 |
| **Low Income Investment Fund** | | | | |
| 3,386 % fällig am 01.07.2026 | $ | 750 | 735 | 0,03 |
| 3,711 % fällig am 01.07.2029 | | 1.950 | 1.893 | 0,09 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | |
| 0,978 % fällig am 09.06.2024 | € | 2.200 | 2.258 | 0,10 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | |
| 0,956 % fällig am 16.10.2024 | | 4.200 | 4.256 | 0,20 |
| 2,721 % fällig am 11.09.2024 | $ | 200 | 200 | 0,01 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 1,700 % fällig am 13.02.2023 | | 2.000 | 1.984 | 0,09 |
| 3,766 % fällig am 08.03.2024 | | 1.500 | 1.496 | 0,07 |
| 4,302 % fällig am 08.03.2029 | | 300 | 287 | 0,01 |
| 4,363 % fällig am 01.08.2024 | | 1.100 | 1.102 | 0,05 |
| 5,750 % fällig am 20.06.2027 (d)(f) | £ | 200 | 218 | 0,01 |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 4,600 % fällig am 28.06.2031 (d)(f) | $ | 1.200 | 886 | 0,04 |
| **New Immo Holding S.A.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 26.11.2026 | € | 1.500 | 1.370 | 0,06 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 42.921 | 4.567 | 0,21 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 44.300 | 4.876 | 0,22 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 0,309 % fällig am 01.10.2022 | € | 1.300 | 1.361 | 0,06 |
| 0,375 % fällig am 17.01.2028 | | 1.400 | 1.228 | 0,06 |
| 1,000 % fällig am 01.07.2022 | DKK | 75.000 | 10.544 | 0,48 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 250.109 | 26.760 | 1,23 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 70.218 | 7.705 | 0,35 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 15.440 | 1.755 | 0,08 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **OneMain Finance Corp.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.01.2027 | $ | 3.400 | 2.725 | 0,13 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 24.985 | 2.759 | 0,13 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 20.425 | 2.334 | 0,11 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,010 % fällig am 05.10.2028 | € | 5.600 | 5.150 | 0,24 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 2,896 % fällig am 15.03.2032 | $ | 1.900 | $ 1.578 | 0,07 |
| 3,625 % fällig am 14.01.2026 | £ | 300 | 356 | 0,02 |
| 3,823 % fällig am 03.11.2028 | $ | 300 | 279 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 15.09.2025 | | 5.000 | 4.943 | 0,23 |
| **Santander UK PLC** | | | | |
| 1,626 % fällig am 12.02.2027 | £ | 700 | 849 | 0,04 |
| **SELP Finance SARL** | | | | |
| 0,875 % fällig am 27.05.2029 | € | 6.400 | 5.383 | 0,25 |
| **Shinhan Bank Co. Ltd.** | | | | |
| 0,250 % fällig am 16.10.2024 | | 3.100 | 3.123 | 0,14 |
| **Shriram Transport Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 24.10.2022 | $ | 700 | 692 | 0,03 |
| **Sirius Real Estate Ltd.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 22.06.2026 | € | 3.300 | 2.984 | 0,14 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 1,488 % fällig am 14.12.2026 | $ | 4.400 | 3.888 | 0,18 |
| 2,226 % fällig am 21.01.2026 | | 4.500 | 4.198 | 0,19 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 2,678 % fällig am 29.06.2032 | | 6.100 | 4.902 | 0,23 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,010 % fällig am 10.09.2025 | € | 3.900 | 3.853 | 0,18 |
| 0,409 % fällig am 07.11.2029 | | 1.300 | 1.186 | 0,05 |
| 0,550 % fällig am 06.11.2023 | | 1.650 | 1.709 | 0,08 |
| 2,014 % fällig am 07.11.2022 | $ | 5.200 | 5.189 | 0,24 |
| 2,440 % fällig am 18.06.2024 | | 1.000 | 982 | 0,05 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | |
| 0,465 % fällig am 30.05.2024 | € | 2.600 | 2.635 | 0,12 |
| **Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.** | | | | |
| 0,010 % fällig am 15.10.2027 | | 2.500 | 2.341 | 0,11 |
| **Tesco Property Finance PLC** | | | | |
| 5,411 % fällig am 13.07.2044 | £ | 369 | 454 | 0,02 |
| 5,801 % fällig am 13.10.2040 | | 189 | 242 | 0,01 |
| **UBS AG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (f) | $ | 1.300 | 1.300 | 0,06 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (f) | | 3.100 | 3.109 | 0,14 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 2,859 % fällig am 15.08.2023 | | 2.500 | 2.499 | 0,11 |
| 4,875 % fällig am 12.02.2027 (d)(f) | | 2.000 | 1.678 | 0,08 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 2,200 % fällig am 22.07.2027 | € | 700 | 669 | 0,03 |
| 3,127 % fällig am 03.06.2032 | $ | 4.500 | 3.515 | 0,16 |
| 7,500 % fällig am 03.06.2026 (d)(f) | € | 400 | 387 | 0,02 |
| **Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.** | | | | |
| 3,150 % fällig am 12.05.2025 | $ | 700 | 647 | 0,03 |
| **VIA Outlets BV** | | | | |
| 1,750 % fällig am 15.11.2028 | € | 5.200 | 4.542 | 0,21 |
| **Vonovia SE** | | | | |
| 0,750 % fällig am 01.09.2032 | | 4.900 | 3.500 | 0,16 |
| 2,375 % fällig am 25.03.2032 | | 2.200 | 1.895 | 0,09 |
| **Weyerhaeuser Co.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 15.03.2032 | $ | 367 | 425 | 0,02 |
| **Workspace Group PLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 11.03.2028 | £ | 2.200 | 2.200 | 0,10 |
| **ZF Finance GmbH** | | | | |
| 2,000 % fällig am 06.05.2027 | € | 4.400 | 3.559 | 0,16 |
| | | | 491.001 | 22,55 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **American Medical Systems Europe BV** | | | | |
| 0,750 % fällig am 08.03.2025 | | 3.800 | 3.810 | 0,17 |
| 1,375 % fällig am 08.03.2028 | | 3.700 | 3.539 | 0,16 |
| **Amgen, Inc.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 22.02.2029 | $ | 5.400 | 4.985 | 0,23 |
| **ASTM SpA** | | | | |
| 1,000 % fällig am 25.11.2026 | € | 5.000 | 4.594 | 0,21 |
| **Ball Corp.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.09.2031 | $ | 6.100 | 4.931 | 0,23 |
| **Boise Cascade Co.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.07.2030 | | 1.300 | 1.139 | 0,05 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 15.02.2031 | | 1.600 | 1.287 | 0,06 |
| 2,600 % fällig am 15.02.2033 | | 700 | 539 | 0,02 |
| 3,419 % fällig am 15.04.2033 | | 800 | 662 | 0,03 |
| 3,469 % fällig am 15.04.2034 | | 1.300 | 1.060 | 0,05 |
| **Campbell Soup Co.** | | | | |
| 3,650 % fällig am 15.03.2023 | $ | 58 | $ 58 | 0,00 |
| **Chanel Ceres PLC** | | | | |
| 0,500 % fällig am 31.07.2026 | € | 3.200 | 3.068 | 0,14 |
| **Conagra Brands, Inc.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 01.05.2024 | $ | 600 | 603 | 0,03 |
| **Continental Wind LLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 28.02.2033 | | 1.817 | 1.931 | 0,09 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 6,200 % fällig am 15.07.2030 | | 2.500 | 2.605 | 0,12 |
| **Elevance Health, Inc.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.09.2029 | | 2.100 | 1.894 | 0,09 |
| **Ford Motor Co.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.02.2032 | | 3.900 | 2.930 | 0,13 |
| **Infineon Technologies AG** | | | | |
| 2,000 % fällig am 24.06.2032 | € | 2.100 | 1.946 | 0,09 |
| **International Flavors & Fragrances, Inc.** | | | | |
| 0,697 % fällig am 15.09.2022 | $ | 1.700 | 1.692 | 0,08 |
| **Lendlease Europe Finance PLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 02.12.2033 | £ | 4.400 | 4.185 | 0,19 |
| **Liberty Utilities Finance GP** | | | | |
| 2,050 % fällig am 15.09.2030 | $ | 3.000 | 2.463 | 0,11 |
| **Macquarie University** | | | | |
| 3,500 % fällig am 07.09.2028 | AUD | 800 | 508 | 0,02 |
| **Marks & Spencer PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 19.05.2026 | £ | 3.850 | 4.116 | 0,19 |
| **Medtronic Global Holdings S.C.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 02.12.2022 (a) | € | 1.200 | 1.254 | 0,06 |
| **Natura Cosmeticos S.A.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 03.05.2028 | $ | 6.100 | 5.031 | 0,23 |
| **Nemak S.A.B. de C.V.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 20.07.2028 | € | 3.300 | 2.481 | 0,11 |
| **Nissan Motor Co. Ltd.** | | | | |
| 1,940 % fällig am 15.09.2023 | | 400 | 416 | 0,02 |
| 3,043 % fällig am 15.09.2023 | $ | 1.100 | 1.082 | 0,05 |
| 3,201 % fällig am 17.09.2028 | € | 1.100 | 1.025 | 0,05 |
| 3,522 % fällig am 17.09.2025 | $ | 1.700 | 1.611 | 0,07 |
| 4,810 % fällig am 17.09.2030 | | 900 | 800 | 0,04 |
| **Panasonic Holdings Corp.** | | | | |
| 2,536 % fällig am 19.07.2022 | | 4.613 | 4.613 | 0,21 |
| **Pearson Funding PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 04.06.2030 | £ | 2.000 | 2.307 | 0,11 |
| **Rede D'or Finance SARL** | | | | |
| 4,500 % fällig am 22.01.2030 | $ | 582 | 492 | 0,02 |
| **Renault S.A.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 04.10.2027 | € | 1.000 | 767 | 0,04 |
| **ReNew Power Pvt Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 05.03.2027 | $ | 3.200 | 2.932 | 0,13 |
| **Schaeffler AG** | | | | |
| 3,375 % fällig am 12.10.2028 | € | 1.000 | 850 | 0,04 |
| **Scottish Hydro Electric Transmission PLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 27.09.2035 | £ | 600 | 576 | 0,03 |
| **SEB S.A.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 16.06.2025 | € | 3.100 | 3.111 | 0,14 |
| **Southwest Airlines Co.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 04.05.2025 | $ | 600 | 612 | 0,03 |
| **Sunnova Energy Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.09.2026 | | 5.800 | 5.055 | 0,23 |
| **Suzano Austria GmbH** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.01.2032 | | 2.810 | 2.122 | 0,10 |
| **Tesco Corporate Treasury Services PLC** | | | | |
| 0,375 % fällig am 27.07.2029 | € | 3.400 | 2.754 | 0,13 |
| 2,750 % fällig am 27.04.2030 | £ | 1.400 | 1.487 | 0,07 |
| **Vmed O2 UK Financing PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 31.01.2029 | | 3.000 | 2.907 | 0,13 |
| **VMware, Inc.** | | | | |
| 4,650 % fällig am 15.05.2027 | $ | 1.000 | 996 | 0,05 |
| **Wabtec Transportation Netherlands BV** | | | | |
| 1,250 % fällig am 03.12.2027 | € | 4.800 | 4.110 | 0,19 |
| | | | 103.936 | 4,77 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **Anglian Water Services Financing PLC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 10.08.2025 | £ | 3.000 | 3.486 | 0,16 |
| **Azure Power Solar Energy Pvt Ltd.** | | | | |
| 5,650 % fällig am 24.12.2024 | $ | 1.400 | $ 1.327 | 0,06 |
| **British Telecommunications PLC** | | | | |
| 9,625 % fällig am 15.12.2030 | | 600 | 747 | 0,03 |
| **Clearway Energy Operating LLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.02.2031 | | 3.200 | 2.590 | 0,12 |
| 4,750 % fällig am 15.03.2028 | | 1.200 | 1.082 | 0,05 |
| **Electricite de France S.A.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 29.11.2033 | € | 4.900 | 3.873 | 0,18 |
| **Enel Finance International NV** | | | | |
| 0,000 % fällig am 17.06.2024 (a) | | 1.200 | 1.210 | 0,05 |
| 0,000 % fällig am 28.05.2026 (a) | | 1.200 | 1.127 | 0,05 |
| 0,375 % fällig am 28.05.2029 | | 700 | 599 | 0,03 |
| 0,875 % fällig am 28.09.2034 | | 800 | 582 | 0,03 |
| 1,000 % fällig am 20.10.2027 | £ | 1.800 | 1.905 | 0,09 |
| **Greenko Dutch BV** | | | | |
| 3,850 % fällig am 29.03.2026 | $ | 6.305 | 5.363 | 0,25 |
| **Greenko Solar Mauritius Ltd.** | | | | |
| 5,550 % fällig am 29.01.2025 | | 6.800 | 6.392 | 0,29 |
| **India Green Energy Holdings** | | | | |
| 5,375 % fällig am 29.04.2024 | | 2.800 | 2.620 | 0,12 |
| **India Green Power Holdings** | | | | |
| 4,000 % fällig am 22.02.2027 | | 1.500 | 1.176 | 0,05 |
| **Southern California Edison Co.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.06.2031 | | 6.000 | 5.044 | 0,23 |
| **Southern Power Co.** | | | | |
| 0,900 % fällig am 15.01.2026 | | 6.000 | 5.366 | 0,25 |
| | | | 44.489 | 2,04 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 639.426 | 29,36 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Chicago Transit Authority, Illinois Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | | |
| 6,200 % fällig am 01.12.2040 | | 100 | 115 | 0,01 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.03.2060 | | 1.295 | 1.216 | 0,06 |
| 3,500 % fällig am 01.01.2059 | | 748 | 726 | 0,03 |
| **Freddie Mac** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.05.2048 | | 6.056 | 5.928 | 0,27 |
| 4,000 % fällig am 01.06.2048 | | 4.265 | 4.278 | 0,20 |
| **Ginnie Mae** | | | | |
| 1,968 % fällig am 20.04.2067 | | 222 | 220 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 20.07.2046 - 20.05.2047 | | 29 | 29 | 0,00 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.02.2052 | | 12.679 | 11.058 | 0,51 |
| 2,500 % fällig am 01.12.2051 - 01.01.2052 | | 49.600 | 44.704 | 2,05 |
| 3,500 % fällig am 01.03.2047 | | 4.076 | 3.988 | 0,18 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2048 | | 3.806 | 3.812 | 0,17 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.07.2052 | | 35.200 | 32.786 | 1,51 |
| 3,500 % fällig am 01.07.2052 | | 181.500 | 174.440 | 8,01 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2052 | | 102.300 | 100.759 | 4,63 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2052 | | 8.100 | 8.115 | 0,37 |
| | | | 392.059 | 18,00 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | | |
| 1,625 % fällig am 15.11.2050 | | 14.800 | 10.416 | 0,48 |
| 1,875 % fällig am 15.02.2041 | | 39.800 | 31.231 | 1,43 |
| 2,875 % fällig am 15.05.2052 | | 6.900 | 6.519 | 0,30 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c)** | | | | |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028 | | 9.961 | 9.898 | 0,46 |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 | | 3.972 | 4.417 | 0,20 |
| 3,875 % fällig am 15.04.2029 (c) | | 703 | 850 | 0,04 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 2,875 % fällig am 30.04.2025 | | 4.200 | 4.183 | 0,19 |
| | | | 67.514 | 3,10 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | | |
| 1,416 % fällig am 25.10.2046 | | 86 | 64 | 0,00 |
| 1,814 % fällig am 25.10.2046 | | 1.108 | 639 | 0,03 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 3,687 % fällig am 25.09.2035 | $ | 178 $ | 86 | 0,00 |
| **Atlas Funding PLC** | | | | |
| 1,388 % fällig am 25.07.2058 | £ | 1.946 | 2.342 | 0,11 |
| **Atrium Hotel Portfolio Trust** | | | | |
| 2,254 % fällig am 15.12.2036 | $ | 5.000 | 4.868 | 0,22 |
| **Avon Finance PLC** | | | | |
| 1,690 % fällig am 20.09.2048 | £ | 1.719 | 2.077 | 0,10 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 2,954 % fällig am 25.11.2036 ^ | $ | 653 | 369 | 0,02 |
| **Bear Stearns Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 1,794 % fällig am 25.06.2047 | | 1.062 | 942 | 0,04 |
| **Brass PLC** | | | | |
| 0,871 % fällig am 16.11.2066 | £ | 471 | 571 | 0,03 |
| **Canada Square Funding PLC** | | | | |
| 1,550 % fällig am 17.10.2051 | | 598 | 725 | 0,03 |
| 1,550 % fällig am 17.06.2058 | | 2.285 | 2.721 | 0,13 |
| 1,720 % fällig am 17.06.2058 | | 4.590 | 5.501 | 0,25 |
| 2,020 % fällig am 17.12.2057 | | 1.726 | 2.072 | 0,10 |
| **Canterbury Finance PLC** | | | | |
| 1,953 % fällig am 16.05.2056 | | 1.567 | 1.907 | 0,09 |
| **Charter Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,540 % fällig am 16.01.2057 | | 734 | 890 | 0,04 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | | |
| 3,718 % fällig am 25.07.2037 | $ | 8 | 7 | 0,00 |
| **Citigroup Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 3,209 % fällig am 10.05.2049 | | 2.100 | 2.022 | 0,09 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 2,904 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 391 | 270 | 0,01 |
| **Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 3,590 % fällig am 10.11.2047 | | 2.000 | 1.973 | 0,09 |
| 3,732 % fällig am 10.08.2049 | | 1.000 | 972 | 0,05 |
| 4,228 % fällig am 10.05.2051 | | 1.700 | 1.686 | 0,08 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,246 % fällig am 25.11.2036 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,864 % fällig am 25.06.2036 | | 82 | 77 | 0,00 |
| 2,044 % fällig am 25.07.2046 ^ | | 477 | 414 | 0,02 |
| 2,104 % fällig am 25.08.2047 | | 1.076 | 921 | 0,04 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2034 | | 160 | 156 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 25.12.2036 | | 1.090 | 579 | 0,03 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,164 % fällig am 25.04.2046 | | 1.862 | 594 | 0,03 |
| 2,204 % fällig am 25.03.2035 ^ | | 362 | 303 | 0,01 |
| 2,304 % fällig am 25.03.2035 ^ | | 78 | 69 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | | 263 | 163 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 642 | 321 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 | | 631 | 365 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2047 | | 92 | 56 | 0,00 |
| **Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.09.2047 ^ | | 781 | 706 | 0,03 |
| 2,184 % fällig am 25.08.2036 | | 4.605 | 4.398 | 0,20 |
| **Dutch Property Finance BV** | | | | |
| 0,235 % fällig am 28.07.2058 | € | 2.939 | 3.047 | 0,14 |
| **EMF-UK PLC** | | | | |
| 2,570 % fällig am 13.03.2046 | £ | 256 | 310 | 0,01 |
| **Eurohome UK Mortgages PLC** | | | | |
| 1,739 % fällig am 15.06.2044 | | 33 | 40 | 0,00 |
| **EuroMASTR PLC** | | | | |
| 1,789 % fällig am 15.06.2040 | | 50 | 58 | 0,00 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 13.03.2045 | € | 127 | 132 | 0,01 |
| 1,749 % fällig am 15.12.2044 | £ | 11 | 14 | 0,00 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | |
| 1,795 % fällig am 16.09.2069 | | 923 | 1.120 | 0,05 |
| 2,065 % fällig am 16.06.2070 | | 2.246 | 2.718 | 0,13 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 6,250 % fällig am 25.11.2036 ^ | $ | 34 | 14 | 0,00 |
| **Friary PLC** | | | | |
| 1,358 % fällig am 21.11.2067 | £ | 180 | 219 | 0,01 |
| **Genesis Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.09.2059 | | 9.500 | 11.474 | 0,53 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,009 % fällig am 25.10.2035 ^ | $ | 26 | 25 | 0,00 |
| 3,049 % fällig am 25.11.2035 | | 58 | 57 | 0,00 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | | |
| 1,703 % fällig am 25.05.2053 | £ | 3.152 | 3.821 | 0,18 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Impac Secured Assets Trust** | | | | |
| 2,144 % fällig am 25.01.2037 | $ | 539 $ | 492 | 0,02 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,964 % fällig am 25.11.2036 | | 2.824 | 2.799 | 0,13 |
| 3,016 % fällig am 25.12.2034 | | 139 | 136 | 0,01 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,104 % fällig am 25.10.2036 | | 256 | 239 | 0,01 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | | |
| 2,499 % fällig am 25.08.2035 | | 129 | 127 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 | | 791 | 456 | 0,02 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 1,226 % fällig am 25.03.2047 | | 462 | 425 | 0,02 |
| **Ludgate Funding PLC** | | | | |
| 1,198 % fällig am 01.01.2061 | £ | 47 | 53 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust** | | | | |
| 2,211 % fällig am 25.10.2047 | $ | 10.810 | 3.985 | 0,18 |
| **Miravet SARL** | | | | |
| 0,494 % fällig am 26.05.2065 | € | 1.536 | 1.611 | 0,07 |
| **Mortimer BTL PLC** | | | | |
| 1,492 % fällig am 23.06.2053 | £ | 2.767 | 3.256 | 0,15 |
| **New Residential Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,500 % fällig am 25.12.2057 | $ | 1.110 | 1.086 | 0,05 |
| **Paragon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,651 % fällig am 15.05.2045 | £ | 490 | 592 | 0,03 |
| **Pepper Residential Securities Trust** | | | | |
| 2,193 % fällig am 16.09.2059 | AUD | 120 | 82 | 0,00 |
| **Polaris PLC** | | | | |
| 1,730 % fällig am 23.12.2058 | £ | 2.927 | 3.504 | 0,16 |
| **Real Estate Asset Liquidity Trust** | | | | |
| 3,072 % fällig am 12.08.2053 | CAD | 219 | 169 | 0,01 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 1,572 % fällig am 25.11.2037 | $ | 268 | 243 | 0,01 |
| 1,924 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 306 | 291 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 | | 408 | 353 | 0,02 |
| **Residential Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 2,040 % fällig am 20.06.2070 | £ | 1.480 | 1.792 | 0,08 |
| **RESIMAC Bastille Trust** | | | | |
| 1,733 % fällig am 05.09.2057 | $ | 140 | 140 | 0,01 |
| **RESIMAC Premier** | | | | |
| 2,170 % fällig am 07.02.2052 | | 1.564 | 1.563 | 0,07 |
| **Ripon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,351 % fällig am 28.08.2056 | £ | 17.430 | 20.959 | 0,96 |
| **RMAC PLC** | | | | |
| 1,571 % fällig am 12.06.2046 | | 868 | 1.048 | 0,05 |
| 1,841 % fällig am 12.06.2046 | | 477 | 580 | 0,03 |
| **RMAC Securities PLC** | | | | |
| 1,041 % fällig am 12.06.2044 | | 40 | 45 | 0,00 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | | |
| 2,978 % fällig am 20.07.2037 | $ | 211 | 176 | 0,01 |
| **Stratton Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2060 | £ | 3.744 | 4.511 | 0,21 |
| 1,652 % fällig am 12.03.2052 | | 2.436 | 2.923 | 0,13 |
| 1,674 % fällig am 25.09.2051 | | 3.170 | 3.829 | 0,18 |
| **Structured Asset Securities Corp.** | | | | |
| 1,904 % fällig am 25.01.2036 | $ | 149 | 144 | 0,01 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,914 % fällig am 25.10.2036 | | 308 | 271 | 0,01 |
| **TBW Mortgage-Backed Trust** | | | | |
| 5,965 % fällig am 25.07.2037 | | 2.484 | 941 | 0,04 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2045 | £ | 1.348 | 1.635 | 0,08 |
| 1,605 % fällig am 20.10.2051 | | 932 | 1.128 | 0,05 |
| **Towd Point Mortgage Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.10.2059 | $ | 5.067 | 4.992 | 0,23 |
| **Tower Bridge Funding PLC** | | | | |
| 2,160 % fällig am 20.09.2063 | £ | 2.208 | 2.687 | 0,12 |
| **Trinidad Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 1,404 % fällig am 24.01.2059 | | 228 | 275 | 0,01 |
| **Trinity Square PLC** | | | | |
| 1,300 % fällig am 15.07.2059 | | 2.176 | 2.625 | 0,12 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | |
| 1,602 % fällig am 12.03.2055 | | 3.400 | 4.018 | 0,18 |
| **Uropa Securities PLC** | | | | |
| 1,437 % fällig am 10.10.2040 | | 305 | 342 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 1,476 % fällig am 25.02.2046 | $ | 291 $ | 266 | 0,01 |
| 2,529 % fällig am 25.09.2033 | | 51 | 49 | 0,00 |
| 2,831 % fällig am 25.09.2036 | | 67 | 58 | 0,00 |
| 2,851 % fällig am 25.10.2035 | | 90 | 86 | 0,00 |
| 3,145 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 2.925 | 2.720 | 0,13 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,074 % fällig am 25.04.2035 | | 336 | 276 | 0,01 |
| | | | 144.853 | 6,65 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Accunia European CLO DAC** | | | | |
| 0,950 % fällig am 15.07.2030 | € | 448 | 463 | 0,02 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,524 % fällig am 25.12.2034 | $ | 113 | 104 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.08.2035 | | 1.600 | 1.563 | 0,07 |
| **Adagio CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.10.2031 | € | 2.400 | 2.460 | 0,11 |
| **Apidos CLO** | | | | |
| 2,073 % fällig am 20.04.2031 | $ | 5.900 | 5.798 | 0,27 |
| **Aqueduct European CLO DAC** | | | | |
| 0,640 % fällig am 20.07.2030 | € | 2.909 | 2.997 | 0,14 |
| **Ares European CLO DAC** | | | | |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | | 2.700 | 2.760 | 0,13 |
| 0,850 % fällig am 20.04.2032 | | 4.100 | 4.175 | 0,19 |
| **Argent Securities Trust** | | | | |
| 1,984 % fällig am 25.04.2036 | $ | 5.204 | 1.877 | 0,09 |
| **Atlas Senior Loan Fund Ltd.** | | | | |
| 2,194 % fällig am 16.01.2030 | | 3.792 | 3.753 | 0,17 |
| **Aurium CLO DAC** | | | | |
| 0,730 % fällig am 16.01.2031 | € | 4.800 | 4.930 | 0,23 |
| **Bain Capital Euro DAC** | | | | |
| 0,740 % fällig am 20.01.2032 | | 2.000 | 2.029 | 0,09 |
| **Bayview Financial Asset Trust** | | | | |
| 3,124 % fällig am 25.03.2037 | $ | 111 | 111 | 0,01 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,599 % fällig am 25.03.2035 | | 355 | 354 | 0,02 |
| **Benefit Street Partners CLO Ltd.** | | | | |
| 2,163 % fällig am 20.01.2031 | | 2.600 | 2.550 | 0,12 |
| **Black Diamond CLO DAC** | | | | |
| 0,980 % fällig am 15.05.2032 | € | 4.700 | 4.802 | 0,22 |
| **BlueMountain Fuji EUR CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.01.2031 | | 2.000 | 2.037 | 0,09 |
| 0,910 % fällig am 15.01.2033 | | 2.850 | 2.867 | 0,13 |
| **BNPP AM Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,820 % fällig am 22.07.2032 | | 4.800 | 4.871 | 0,22 |
| **Bridgepoint CLO DAC** | | | | |
| 1,210 % fällig am 15.01.2034 | | 3.400 | 3.493 | 0,16 |
| **Bumper UK Finance PLC** | | | | |
| 1,540 % fällig am 20.12.2028 | £ | 4 | 4 | 0,00 |
| **Cairn CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 20.10.2028 | € | 176 | 183 | 0,01 |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | | 1.300 | 1.325 | 0,06 |
| **Carlyle Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,700 % fällig am 15.01.2031 | | 2.200 | 2.247 | 0,10 |
| 0,890 % fällig am 15.08.2032 | | 3.000 | 3.043 | 0,14 |
| **Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.** | | | | |
| 2,014 % fällig am 17.04.2031 | $ | 3.290 | 3.219 | 0,15 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.11.2031 | € | 1.500 | 1.541 | 0,07 |
| 2,224 % fällig am 15.01.2030 | $ | 3.650 | 3.588 | 0,16 |
| **Catamaran CLO Ltd.** | | | | |
| 2,236 % fällig am 22.04.2030 | | 4.278 | 4.222 | 0,19 |
| **Cedar Funding CLO Ltd.** | | | | |
| 2,144 % fällig am 17.07.2031 | | 4.400 | 4.314 | 0,20 |
| **CIFC Funding Ltd.** | | | | |
| 2,224 % fällig am 16.11.2030 | | 4.700 | 4.635 | 0,21 |
| 2,244 % fällig am 17.10.2031 | | 3.200 | 3.146 | 0,14 |
| 2,285 % fällig am 27.04.2031 | | 2.300 | 2.257 | 0,10 |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,974 % fällig am 25.10.2037 | | 1.571 | 1.564 | 0,07 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.07.2037 | | 2.253 | 2.085 | 0,10 |
| 1,844 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 214 | 220 | 0,01 |
| 1,854 % fällig am 25.04.2047 | | 5.700 | 5.215 | 0,24 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 1,874 % fällig am 25.02.2036 | $ | 671 | $ 650 | 0,03 |
| 2,599 % fällig am 25.01.2036 | | 2.371 | 2.295 | 0,11 |
| **CVC Cordatus Loan Fund DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 27.01.2031 | € | 5.697 | 5.847 | 0,27 |
| **Dryden Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,860 % fällig am 15.05.2034 | | 1.250 | 1.264 | 0,06 |
| **Encore Credit Receivables Trust** | | | | |
| 2,314 % fällig am 25.07.2035 | $ | 527 | 514 | 0,02 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 2,689 % fällig am 25.06.2035 | | 160 | 156 | 0,01 |
| **Gallatin CLO Ltd.** | | | | |
| 2,148 % fällig am 21.01.2028 | | 337 | 334 | 0,02 |
| **Greenwood Park CLO Ltd.** | | | | |
| 2,054 % fällig am 15.04.2031 | | 2.300 | 2.251 | 0,10 |
| **Griffith Park CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 21.11.2031 | € | 1.000 | 1.024 | 0,05 |
| **Grosvenor Place CLO BV** | | | | |
| 0,720 % fällig am 30.10.2029 | | 352 | 367 | 0,02 |
| **GSAMP Trust** | | | | |
| 2,124 % fällig am 25.05.2046 | $ | 1.400 | 1.319 | 0,06 |
| 2,344 % fällig am 25.11.2035 | | 4.500 | 3.895 | 0,18 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | € | 96 | 100 | 0,00 |
| 0,640 % fällig am 15.10.2031 | | 3.200 | 3.268 | 0,15 |
| 0,650 % fällig am 26.06.2030 | | 3.168 | 3.255 | 0,15 |
| 0,680 % fällig am 20.10.2031 | | 1.200 | 1.224 | 0,06 |
| 0,760 % fällig am 15.07.2031 | | 3.300 | 3.322 | 0,15 |
| 0,850 % fällig am 15.01.2032 | | 4.700 | 4.783 | 0,22 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 2,299 % fällig am 25.02.2036 | $ | 983 | 956 | 0,04 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | |
| 1,844 % fällig am 25.04.2037 | | 282 | 224 | 0,01 |
| 3,574 % fällig am 25.03.2035 | | 1.295 | 1.131 | 0,05 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.01.2037 | | 1.592 | 1.273 | 0,06 |
| **IndyMac Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | |
| 2,464 % fällig am 25.03.2035 | | 2.266 | 2.178 | 0,10 |
| **Jubilee CLO DAC** | | | | |
| 0,519 % fällig am 15.12.2029 | € | 720 | 744 | 0,03 |
| **KKR CLO Ltd.** | | | | |
| 2,224 % fällig am 15.01.2031 | $ | 3.000 | 2.960 | 0,14 |
| **Laurelin DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 20.10.2031 | € | 1.500 | 1.537 | 0,07 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,224 % fällig am 25.01.2036 | $ | 739 | 682 | 0,03 |
| **Madison Park Euro Funding DAC** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.01.2032 | € | 3.200 | 3.239 | 0,15 |
| 0,800 % fällig am 15.07.2032 | | 5.200 | 5.270 | 0,24 |
| **Madison Park Funding Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 29.07.2030 | $ | 2.000 | 1.979 | 0,09 |
| **Man GLG Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,810 % fällig am 15.10.2032 | € | 5.200 | 5.332 | 0,24 |
| **Marathon CLO Ltd.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 21.11.2027 | $ | 48 | 48 | 0,00 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.08.2036 | | 12.736 | 5.078 | 0,23 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 1,864 % fällig am 25.02.2037 | | 659 | 226 | 0,01 |
| 2,344 % fällig am 25.05.2036 | | 287 | 283 | 0,01 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 1,694 % fällig am 25.10.2036 | | 848 | 430 | 0,02 |
| 1,724 % fällig am 25.11.2036 | | 6.190 | 3.303 | 0,15 |
| 1,874 % fällig am 25.07.2036 | | 66 | 56 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.12.2034 | | 478 | 412 | 0,02 |
| 2,299 % fällig am 25.09.2035 | | 3.300 | 3.155 | 0,15 |
| 2,584 % fällig am 25.09.2034 | | 789 | 762 | 0,04 |
| **Morgan Stanley Structured Trust** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.06.2037 | | 2.900 | 2.645 | 0,12 |
| **Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd.** | | | | |
| 2,103 % fällig am 20.04.2031 | | 2.500 | 2.438 | 0,11 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,359 % fällig am 25.06.2035 | | 284 | 284 | 0,01 |
| 2,389 % fällig am 25.02.2035 | | 2.720 | 2.605 | 0,12 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,254 % fällig am 25.02.2036 | | 4.400 | 4.097 | 0,19 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 1,724 % fällig am 25.01.2037 | $ | 2.570 | $ 960 | 0,04 |
| 2,164 % fällig am 25.05.2036 | | 1.700 | 1.595 | 0,07 |
| **OCP CLO Ltd.** | | | | |
| 2,183 % fällig am 20.07.2029 | | 3.066 | 3.032 | 0,14 |
| **OCP Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,880 % fällig am 22.09.2034 | € | 2.700 | 2.732 | 0,13 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.01.2037 | $ | 274 | 189 | 0,01 |
| 1,764 % fällig am 25.03.2037 | | 1.266 | 919 | 0,04 |
| 1,804 % fällig am 25.04.2037 | | 3.131 | 1.614 | 0,07 |
| **OZLM Ltd.** | | | | |
| 2,054 % fällig am 17.07.2029 | | 3.063 | 3.033 | 0,14 |
| 2,441 % fällig am 16.05.2030 | | 3.800 | 3.735 | 0,17 |
| 2,536 % fällig am 30.10.2030 | | 1.335 | 1.337 | 0,06 |
| **Palmer Square CLO Ltd.** | | | | |
| 2,144 % fällig am 16.07.2031 | | 3.500 | 3.423 | 0,16 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.10.2031 | € | 5.800 | 5.940 | 0,27 |
| 0,730 % fällig am 15.07.2031 | | 4.574 | 4.689 | 0,22 |
| **PCL Funding PLC** | | | | |
| 1,990 % fällig am 15.09.2024 | £ | 1.900 | 2.307 | 0,11 |
| **Pepper SPARKZ Trust** | | | | |
| 2,085 % fällig am 17.08.2028 | AUD | 1.112 | 763 | 0,04 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 5,762 % fällig am 25.08.2036 | $ | 708 | 321 | 0,01 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 2,284 % fällig am 25.12.2035 | | 4.997 | 4.843 | 0,22 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | | |
| 2,344 % fällig am 25.05.2035 | | 3.617 | 3.488 | 0,16 |
| **Sculptor European CLO DAC** | | | | |
| 0,790 % fällig am 14.01.2032 | € | 4.900 | 4.946 | 0,23 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 2,344 % fällig am 25.10.2035 | $ | 5.600 | 5.010 | 0,23 |
| **Segovia European CLO DAC** | | | | |
| 0,880 % fällig am 20.07.2032 | € | 2.700 | 2.744 | 0,13 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 2,029 % fällig am 25.12.2036 | $ | 1.500 | 1.447 | 0,07 |
| 2,124 % fällig am 25.11.2036 | | 1.049 | 990 | 0,05 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,149 % fällig am 25.07.2036 | | 1.311 | 1.235 | 0,06 |
| **Terwin Mortgage Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.11.2033 | | 5 | 5 | 0,00 |
| **TIAA CLO Ltd.** | | | | |
| 2,263 % fällig am 20.07.2031 | | 2.550 | 2.503 | 0,11 |
| **TICP CLO Ltd.** | | | | |
| 1,903 % fällig am 20.04.2028 | | 537 | 531 | 0,02 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | |
| 0,810 % fällig am 15.02.2034 | € | 5.000 | 5.052 | 0,23 |
| 0,920 % fällig am 15.07.2030 | | 566 | 584 | 0,03 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | |
| 1,924 % fällig am 15.04.2027 | $ | 146 | 144 | 0,01 |
| 2,163 % fällig am 20.01.2029 | | 3.191 | 3.160 | 0,15 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,969 % fällig am 25.01.2037 | | 3.220 | 3.089 | 0,14 |
| | | | 262.357 | 12,04 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Action Logement Services** | | | | |
| 0,500 % fällig am 30.10.2034 | € | 2.100 | 1.745 | 0,08 |
| **Adif Alta Velocidad** | | | | |
| 0,550 % fällig am 31.10.2031 | | 5.000 | 4.383 | 0,20 |
| **Auckland Council** | | | | |
| 0,250 % fällig am 17.11.2031 | | 5.000 | 4.317 | 0,20 |
| **Australia Government International Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 21.09.2026 | AUD | 5.800 | 3.551 | 0,16 |
| 1,000 % fällig am 21.12.2030 | | 2.600 | 1.448 | 0,07 |
| 1,250 % fällig am 21.05.2032 | | 1.200 | 662 | 0,03 |
| 1,750 % fällig am 21.06.2051 | | 2.600 | 1.137 | 0,05 |
| 4,500 % fällig am 21.04.2033 | | 4.300 | 3.172 | 0,15 |
| **Autonomous Community of Andalusia** | | | | |
| 0,500 % fällig am 30.04.2031 | € | 4.000 | 3.523 | 0,16 |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 4,220 % fällig am 26.04.2035 | | 200 | 226 | 0,01 |
| **Autonomous Community of Madrid** | | | | |
| 0,420 % fällig am 30.04.2031 | | 4.200 | 3.694 | 0,17 |
| **BNG Bank NV** | | | | |
| 0,250 % fällig am 12.01.2032 | € | 4.000 | $ 3.515 | 0,16 |
| 3,300 % fällig am 17.07.2028 | AUD | 3.000 | 1.938 | 0,09 |
| **Canada Government International Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.12.2051 | CAD | 3.500 | 2.113 | 0,10 |
| **Canadian Government Real Return Bond** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.12.2044 (c) | | 518 | 408 | 0,02 |
| **China Government Bond** | | | | |
| 2,680 % fällig am 21.05.2030 | CNY | 22.300 | 3.284 | 0,15 |
| 3,530 % fällig am 18.10.2051 | | 36.300 | 5.626 | 0,26 |
| 3,720 % fällig am 12.04.2051 | | 49.800 | 7.941 | 0,36 |
| 3,810 % fällig am 14.09.2050 | | 32.000 | 5.172 | 0,24 |
| **Communaute Francaise de Belgique** | | | | |
| 1,625 % fällig am 03.05.2032 | € | 10.300 | 10.127 | 0,47 |
| **CPPIB Capital, Inc.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 23.06.2028 | AUD | 2.300 | 1.337 | 0,06 |
| **Development Bank of Japan, Inc.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 02.10.2024 | $ | 3.900 | 3.786 | 0,17 |
| 2,500 % fällig am 18.10.2022 | | 2.600 | 2.600 | 0,12 |
| **Emirate of Abu Dhabi Government International Bond** | | | | |
| 2,500 % fällig am 11.10.2022 | | 300 | 300 | 0,01 |
| **France Government International Bond** | | | | |
| 0,750 % fällig am 25.05.2052 | € | 7.700 | 5.116 | 0,24 |
| **Hong Kong Government International Bond** | | | | |
| 2,375 % fällig am 02.02.2051 | $ | 2.400 | 1.705 | 0,08 |
| **Ile-de-France Mobilites** | | | | |
| 0,950 % fällig am 16.02.2032 | € | 300 | 280 | 0,01 |
| **Israel Government International Bond** | | | | |
| 0,000 % fällig am 22.07.2022 (a) | | 4.600 | 4.809 | 0,22 |
| 0,750 % fällig am 31.07.2022 | ILS | 11.900 | 3.398 | 0,16 |
| 1,250 % fällig am 30.11.2022 | | 4.900 | 1.400 | 0,06 |
| 2,000 % fällig am 31.03.2027 | | 7.800 | 2.191 | 0,10 |
| 3,375 % fällig am 15.01.2050 | $ | 1.100 | 892 | 0,04 |
| 3,800 % fällig am 13.05.2060 | | 1.700 | 1.421 | 0,07 |
| 4,125 % fällig am 17.01.2048 | | 200 | 185 | 0,01 |
| **Italy Government International Bond** | | | | |
| 6,875 % fällig am 27.09.2023 | | 2.100 | 2.181 | 0,10 |
| **Japan Finance Organization for Municipalities** | | | | |
| 0,010 % fällig am 02.02.2028 | € | 3.600 | 3.376 | 0,16 |
| 3,000 % fällig am 12.03.2024 | $ | 500 | 498 | 0,02 |
| 3,375 % fällig am 27.09.2023 | | 200 | 200 | 0,01 |
| **Japan Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 10.03.2028 (c) | ¥ | 770.640 | 5.962 | 0,27 |
| 0,100 % fällig am 20.06.2031 | | 22.400 | 163 | 0,01 |
| 0,200 % fällig am 20.06.2036 | | 170.000 | 1.189 | 0,05 |
| 0,500 % fällig am 20.09.2046 | | 327.000 | 2.123 | 0,10 |
| 0,500 % fällig am 20.03.2049 | | 2.380.000 | 14.902 | 0,68 |
| 0,700 % fällig am 20.12.2048 | | 722.000 | 4.781 | 0,22 |
| 0,700 % fällig am 20.06.2051 | | 1.502.000 | 9.711 | 0,45 |
| 1,200 % fällig am 20.09.2035 | | 168.000 | 1.342 | 0,06 |
| 1,400 % fällig am 20.09.2034 | | 15.400 | 126 | 0,01 |
| 1,600 % fällig am 20.03.2033 | | 210.000 | 1.746 | 0,08 |
| **Kommunalbanken A/S** | | | | |
| 1,900 % fällig am 19.01.2027 | AUD | 800 | 497 | 0,02 |
| **Korea Housing Finance Corp.** | | | | |
| 0,010 % fällig am 29.06.2026 | € | 1.300 | 1.263 | 0,06 |
| **Malaysia Government International Bond** | | | | |
| 4,065 % fällig am 15.06.2050 | MYR | 3.000 | 590 | 0,03 |
| **Malaysia Government Investment Issue** | | | | |
| 4,369 % fällig am 31.10.2028 | | 33.600 | 7.694 | 0,35 |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 5,000 % fällig am 27.04.2051 | $ | 500 | 417 | 0,02 |
| **Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap** | | | | |
| 0,875 % fällig am 21.03.2046 | € | 3.800 | 2.708 | 0,12 |
| **New Zealand Government International Bond** | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.05.2031 | NZD | 1.500 | 770 | 0,04 |
| **Northern Territory Treasury Corp.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 21.04.2031 | AUD | 1.100 | 629 | 0,03 |
| **Ontario Teachers' Finance Trust** | | | | |
| 0,900 % fällig am 20.05.2041 | € | 1.400 | 1.065 | 0,05 |
| 1,850 % fällig am 03.05.2032 | | 4.000 | 3.938 | 0,18 |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 2,780 % fällig am 01.12.2060 | $ | 1.500 | 932 | 0,04 |
| 5,350 % fällig am 12.08.2040 | PEN | 1.100 | 217 | 0,01 |
| 5,400 % fällig am 12.08.2034 | | 1.900 | 404 | 0,02 |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | | 14.200 | 3.416 | 0,16 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | PEN | 2.100 | $ 489 | 0,02 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 | | 21.400 | 5.311 | 0,24 |
| **Province of Ontario** | | | | |
| 1,550 % fällig am 01.11.2029 | CAD | 11.600 | 7.689 | 0,35 |
| **Province of Quebec** | | | | |
| 2,450 % fällig am 01.03.2023 | | 2.000 | 1.547 | 0,07 |
| 3,500 % fällig am 01.12.2022 | | 500 | 389 | 0,02 |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 5,103 % fällig am 23.04.2048 | $ | 1.300 | 1.365 | 0,06 |
| **Regie Autonome des Transports Parisiens** | | | | |
| 0,875 % fällig am 25.05.2027 | € | 300 | 302 | 0,01 |
| **Region Wallonne Belgium** | | | | |
| 1,375 % fällig am 06.04.2032 | | 6.000 | 5.751 | 0,26 |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.08.2031 (a) | | 53.800 | 50.006 | 2,30 |
| **Romania Government International Bond** | | | | |
| 1,375 % fällig am 02.12.2029 | | 1.170 | 886 | 0,04 |
| 1,750 % fällig am 13.07.2030 | | 1.600 | 1.196 | 0,05 |
| 2,000 % fällig am 28.01.2032 | | 200 | 143 | 0,01 |
| 2,000 % fällig am 14.04.2033 | | 400 | 272 | 0,01 |
| 2,124 % fällig am 16.07.2031 | | 100 | 74 | 0,00 |
| 2,125 % fällig am 07.03.2028 | | 3.100 | 2.675 | 0,12 |
| 2,625 % fällig am 02.12.2040 | | 500 | 305 | 0,01 |
| 2,750 % fällig am 14.04.2041 | | 600 | 368 | 0,02 |
| 2,875 % fällig am 13.04.2042 | | 2.000 | 1.227 | 0,06 |
| 3,750 % fällig am 07.02.2034 | | 2.100 | 1.650 | 0,08 |
| **Serbia Government International Bond** | | | | |
| 1,000 % fällig am 23.09.2028 | | 6.500 | 4.964 | 0,23 |
| **Singapore Government International Bond** | | | | |
| 1,625 % fällig am 01.07.2031 | SGD | 26.200 | 16.862 | 0,77 |
| 2,875 % fällig am 01.09.2030 | | 25.500 | 18.237 | 0,84 |
| **SNCF Reseau** | | | | |
| 1,875 % fällig am 30.03.2034 | € | 3.800 | 3.769 | 0,17 |
| **Societe Du Grand Paris EPIC** | | | | |
| 0,700 % fällig am 15.10.2060 | | 4.400 | 2.313 | 0,11 |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 4,850 % fällig am 30.09.2029 | $ | 400 | 343 | 0,02 |
| **Spain Government International Bond** | | | | |
| 1,000 % fällig am 30.07.2042 | € | 3.200 | 2.387 | 0,11 |
| 1,450 % fällig am 31.10.2071 | | 500 | 293 | 0,01 |
| 3,450 % fällig am 30.07.2066 | | 9.600 | 10.453 | 0,48 |
| **Svensk Exportkredit AB** | | | | |
| 2,000 % fällig am 30.06.2027 | | 5.500 | 5.790 | 0,27 |
| **Thailand Government International Bond** | | | | |
| 1,585 % fällig am 17.12.2035 | THB | 528.100 | $ 12.106 | 0,56 |
| 3,300 % fällig am 17.06.2038 | | 49.200 | 1.340 | 0,06 |
| **Tokyo Metropolitan Government** | | | | |
| 2,625 % fällig am 29.05.2024 | $ | 400 | 394 | 0,02 |
| **Treasury Corp. of Victoria** | | | | |
| 4,250 % fällig am 20.12.2032 | AUD | 1.700 | 1.164 | 0,05 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 0,875 % fällig am 31.07.2033 | £ | 9.000 | 9.344 | 0,43 |
| 1,500 % fällig am 31.07.2053 | | 7.500 | 7.062 | 0,32 |
| | | | 348.708 | 16,01 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | | |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 10,250 % | | 750 | 134 | 0,01 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | | |
| 51,049 % fällig am 30.09.2022 (a)(b) | ARS | 8.200 | 28 | 0,00 |
| **ISRAEL TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,020) % fällig am 07.12.2022 (a)(b) | ILS | 15.500 | 4.414 | 0,20 |
| (0,005) % fällig am 03.08.2022 (a)(b) | | 8.300 | 2.370 | 0,11 |
| 0,000 % fällig am 02.11.2022 (a)(b) | | 7.800 | 2.223 | 0,10 |
| 0,000 % fällig am 07.12.2022 (a)(b) | | 4.500 | 1.282 | 0,06 |
| 0,010 % fällig am 02.11.2022 (a)(b) | | 40.200 | 11.456 | 0,53 |
| 0,014 % fällig am 02.11.2022 (a)(b) | | 2.400 | 684 | 0,03 |
| 0,016 % fällig am 04.01.2023 (a)(b) | | 25.000 | 7.104 | 0,33 |
| 0,022 % fällig am 04.01.2023 (a)(b) | | 3.700 | 1.051 | 0,05 |
| 0,023 % fällig am 07.12.2022 (a)(b) | | 12.300 | 3.503 | 0,16 |
| 0,035 % fällig am 07.12.2022 (a)(b) | | 9.000 | 2.563 | 0,12 |
| 0,860 % fällig am 03.05.2023 (a)(b) | ILS | 21.800 | $ 6.157 | 0,28 |
| 1,159 % fällig am 02.03.2023 (a)(b) | | 18.500 | 5.237 | 0,24 |
| | | | 48.044 | 2,21 |
| **JAPAN TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,204) % fällig am 26.09.2022 (a)(b) | ¥ | 4.348.000 | 32.016 | 1,47 |
| (0,184) % fällig am 26.09.2022 (a)(b) | | 6.480.000 | 47.714 | 2,19 |
| (0,170) % fällig am 26.09.2022 (a)(b) | | 3.372.000 | 24.829 | 1,14 |
| (0,122) % fällig am 19.07.2022 (a)(b) | | 830.000 | 6.110 | 0,28 |
| (0,122) % fällig am 15.08.2022 (a)(b) | | 4.890.000 | 36.001 | 1,65 |
| (0,106) % fällig am 29.08.2022 (a)(b) | | 4.130.000 | 30.408 | 1,40 |
| (0,105) % fällig am 29.08.2022 (a)(b) | | 1.370.000 | 10.087 | 0,46 |
| (0,098) % fällig am 11.07.2022 (a)(b) | | 6.960.000 | 51.233 | 2,35 |
| (0,095) % fällig am 05.09.2022 (a)(b) | | 3.390.000 | 24.960 | 1,15 |
| (0,094) % fällig am 12.09.2022 (a)(b) | | 7.080.000 | 52.130 | 2,40 |
| (0,082) % fällig am 04.07.2022 (a)(b) | | 2.910.000 | 21.420 | 0,98 |
| | | | 336.908 | 15,47 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 384.980 | 17,68 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **$ 2.240.146** | **102,86** |
| | | **AKTIEN** | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Global Investment Grade Credit ESG Fund (e)** | | 580.000 | 5.707 | 0,26 |
| **Summe Investmentfonds** | | | **$ 5.707** | **0,26** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 1,480 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 185.800 | U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2025 | $ (189.367) | $185.800 | $ 185.808 | 8,53 |
| FICC | 0,400 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 3.185 | U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | (3.249) | 3.185 | 3.185 | 0,15 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (192.616)** | **$ 188.985** | **$ 188.993** | **8,68** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month SOFR June Futures | Long | 09/2023 | 188 | $ (290) | (0,01) |
| Australia Government 3-Year Note September Futures | Short | 09/2022 | 73 | (4) | 0,00 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2022 | 347 | (106) | (0,01) |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2022 | 160 | 529 | 0,02 |
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09/2022 | 1.114 | 1.431 | 0,07 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09/2022 | 83 | (364) | (0,02) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2022 | 543 | 1.848 | 0,08 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Short | 09/2022 | 15 | 111 | 0,01 |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2022 | 276 | 1.212 | 0,06 |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2022 | 35 | 279 | 0,01 |

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 462 | $ (401) | (0,02) |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 2.356 | 797 | 0,04 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 991 | (1.653) | (0,08) |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2022 | 849 | (613) | (0,03) |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 18 | 27 | 0,00 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09.2022 | 164 | (749) | (0,03) |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09.2022 | 414 | 2.152 | 0,10 |
| | | | | $ 4.206 | 0,19 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CME Kaufoptionen mit Ausübungskurs von @ USD 98,000 auf 3-Month SOFR December Futures | $ 98,000 | 15.12.2023 | 47 | $ (38) | $ (38) | 0,00 |
| Call - CME Verkaufoptionen mit Ausübungskurs von @ USD 96,500 auf 3-Month SOFR December Futures | 96,500 | 15.12.2023 | 47 | (44) | (5) | 0,00 |
| | | | | $ (82) | $ (96) | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ 4.110** | **0,19** |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| General Motors Co. | 5,000 % | 20.12.2026 | $ 1.800 | $ (127) | (0,01) |
| Valeo S.A. | 1,000 | 20.06.2026 | € 4.500 | (278) | (0,01) |
| | | | | $ (405) | (0,02) |

## ZINSSWAPS - BASISSWAPS

| Zahlung variabler Zinssatz-index | Erhalt variabler Zinssatzindex | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month USD-LIBOR | 1-Month USD-LIBOR + 0,073 % | 27.04.2023 | $ 13.700 | $ 2 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR | 1-Month USD-LIBOR + 0,070 % | 07.03.2024 | 6.300 | (1) | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR[3] | 1-Month USD-LIBOR + 0,088 % | 06.09.2024 | 46.500 | 9 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR[3] | 1-Month USD-LIBOR + 0,105 % | 27.09.2024 | 14.200 | 5 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR[3] | 1-Month USD-LIBOR + 0,102 % | 04.10.2024 | 13.400 | 7 | 0,00 |
| | | | | $ 22 | 0,00 |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,010 % | 07.02.2023 | £ 52.050 | $ (998) | (0,05) |
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 | 21.09.2024 | 29.800 | 137 | 0,01 |
| Zahlung[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 | 21.09.2027 | 3.000 | (96) | 0,00 |
| Zahlung[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2032 | 35.000 | (894) | (0,04) |
| Zahlung[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2052 | 11.700 | (34) | 0,00 |
| Zahlung[3] | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 5,750 | 15.03.2024 | INR 15.275.100 | 339 | 0,02 |
| Erhalt | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 5,750 | 16.03.2027 | 3.275.100 | (608) | (0,03) |
| Erhalt | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 6,250 | 16.03.2032 | 316.000 | (74) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 15.12.2028 | ¥ 180.000 | (22) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 17.03.2031 | 1.100.000 | (228) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,035 | 29.11.2029 | 1.500.000 | (367) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,050 | 15.12.2031 | 2.370.000 | (155) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,200 | 19.06.2029 | 1.060.000 | (293) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,400 | 19.06.2039 | 430.000 | 221 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,800 | 15.06.2052 | 620.000 | 273 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 1,250 | 16.03.2024 | SGD 126.220 | 680 | 0,03 |
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 1,250 | 15.09.2031 | 440 | (9) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 2,250 | 15.06.2032 | 2.160 | (29) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 2,500 | 15.06.2032 | 1.400 | (21) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 2,750 | 15.06.2027 | 11.500 | 31 | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 3,000 | 15.06.2027 | 35.700 | 327 | 0,02 |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,684 | 30.04.2025 | $ 900 | 2 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,696 | 30.04.2025 | 900 | 2 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,710 | 30.04.2025 | 1.000 | 1 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,714 | 30.04.2025 | 1.900 | 3 | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 0,250 | 15.12.2023 | 28.500 | (982) | (0,05) |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 0,500 % | 15.06.2024 | $ | 24.000 | $ (832) | (0,04) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 | 15.06.2029 | | 28.500 | (1.320) | (0,06) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,250 | 15.12.2028 | | 16.500 | (1.448) | (0,07) |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,250 | 15.06.2032 | | 2.400 | 309 | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,250 | 15.06.2032 | | 43.200 | (3.986) | (0,17) |
| Erhalt(3) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,320 | 21.12.2023 | | 817.200 | 13.518 | 0,62 |
| Zahlung(3) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,430 | 31.03.2024 | | 41.500 | (1.151) | (0,05) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,500 | 15.12.2031 | | 3.900 | 484 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,500 | 15.12.2031 | | 40.000 | (5.075) | (0,21) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,500 | 15.06.2052 | | 13.400 | (2.703) | (0,12) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,618 | 09.02.2029 | | 6.900 | (431) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,695 | 15.11.2031 | | 42.700 | (3.759) | (0,17) |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2027 | | 115.000 | (199) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2032 | | 26.800 | (84) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.12.2051 | | 3.000 | (799) | (0,04) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2052 | | 11.400 | (70) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,817 | 05.04.2032 | | 10.400 | (784) | (0,04) |
| Erhalt(3) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,850 | 21.04.2024 | | 194.800 | 210 | 0,01 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,175 | 21.04.2029 | | 10.500 | (331) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,370 | 21.06.2027 | | 15.000 | (223) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,400 | 21.06.2024 | | 44.300 | (419) | (0,02) |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,703 | 22.06.2052 | | 3.900 | (48) | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,792 | 23.06.2052 | | 2.300 | (70) | 0,00 |
| Zahlung(3) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,886 | 15.05.2032 | | 95.700 | 1.034 | 0,05 |
| Erhalt(3) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,965 | 30.11.2026 | | 244.000 | (1.401) | (0,06) |
| Zahlung(3) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,004 | 30.06.2024 | | 16.000 | (33) | 0,00 |
| Zahlung(3) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,005 | 15.05.2032 | | 11.500 | 187 | 0,01 |
| Erhalt(3) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,059 | 30.11.2026 | | 26.500 | (227) | (0,01) |
| Zahlung(3) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,486 | 30.06.2024 | | 25.400 | 152 | 0,01 |
| Zahlung(3) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,527 | 30.06.2024 | | 27.000 | 181 | 0,01 |
| Zahlung(3) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,531 | 30.06.2024 | | 29.800 | 201 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,000 | 16.06.2026 | CAD | 20.500 | (893) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,250 | 16.06.2031 | | 34.000 | (3.137) | (0,14) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,500 | 17.06.2025 | | 300 | (11) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,500 | 17.06.2030 | | 22.500 | (3.172) | (0,15) |
| Zahlung(3) | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,000 | 14.11.2023 | | 26.800 | (342) | (0,02) |
| Zahlung(3) | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,060 | 28.10.2023 | | 88.600 | (855) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,500 | 28.01.2052 | | 2.500 | (371) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 3,028 | 25.03.2052 | | 2.500 | (183) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,283 | 14.02.2027 | CHF | 4.200 | (152) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,294 | 10.02.2027 | | 32.300 | (1.071) | (0,05) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,295 | 17.02.2027 | | 4.900 | (174) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,300 | 15.02.2027 | | 7.700 | (271) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,343 | 16.05.2027 | | 6.300 | (245) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,368 | 15.06.2027 | | 35.800 | (1.338) | (0,06) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,500 | 15.09.2026 | | 34.700 | (2.295) | (0,11) |
| Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,500 | 16.03.2027 | CNY | 145.600 | (137) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 0,908 | 16.12.2030 | KRW | 2.700.000 | (367) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,500 | 17.03.2031 | | 1.000.000 | (113) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 3,000 | 15.06.2032 | | 16.838.200 | (406) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 3,250 | 15.06.2032 | | 2.242.900 | (13) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month NZD-BBR | 0,528 | 17.03.2024 | NZD | 950 | (34) | 0,00 |
| Zahlung(3) | 3-Month NZD-BBR | 3,000 | 01.11.2023 | | 54.500 | (429) | (0,02) |
| Zahlung(3) | 3-Month NZD-BBR | 3,000 | 15.12.2023 | | 53.500 | (408) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month NZD-BBR | 3,750 | 15.06.2027 | | 35.300 | 71 | 0,00 |
| Zahlung(3) | 3-Month NZD-BBR | 4,000 | 14.06.2024 | | 93.500 | (62) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month SEK-STIBOR | 1,000 | 19.06.2029 | SEK | 11.700 | (171) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,250 | 16.06.2023 | $ | 24.900 | (730) | (0,03) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,400 | 30.03.2026 | | 49.400 | (4.078) | (0,19) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,500 | 15.12.2023 | | 54.500 | (2.131) | (0,10) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,500 | 16.06.2028 | | 5.300 | (471) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,750 | 16.12.2022 | | 12.800 | (254) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,750 | 16.12.2022 | | 3.800 | (76) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,750 | 30.03.2031 | | 28.800 | 4.860 | 0,22 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,249 | 31.08.2024 | | 8.800 | 332 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 15.12.2026 | | 21.750 | 1.907 | 0,09 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 09.06.2041 | | 300 | 77 | 0,00 |
| Erhalt(3) | 3-Month USD-LIBOR | 1,270 | 04.11.2023 | | 215.600 | 2.577 | 0,12 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,400 | 19.07.2031 | | 6.200 | 837 | 0,04 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 15.12.2028 | | 20.200 | (2.051) | (0,09) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,518 | 20.01.2029 | | 12.300 | (1.038) | (0,05) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,545 | 20.01.2029 | | 8.200 | (677) | (0,03) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,630 | 20.01.2029 | | 10.300 | (795) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,630 | 26.01.2029 | | 2.300 | (178) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 | 15.12.2031 | | 4.800 | 621 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,950 | 04.10.2031 | | 1.260 | 183 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 15.12.2051 | | 29.000 | (7.658) | (0,35) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,250 | 20.06.2023 | ZAR | 11.400 | 2 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 1,250 | 17.06.2030 | AUD | 4.800 | 763 | 0,03 |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 1,750 | 16.03.2027 | | 3.000 | (174) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 1,750 | 16.06.2031 | | 6.450 | 793 | 0,04 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,913 % | 30.01.2029 | CZK 7.400 | $ (60) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 17.03.2036 | € 900 | 223 | 0,01 |
| Erhalt(3) | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,054 | 27.05.2050 | 600 | 239 | 0,01 |
| Erhalt(3) | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,064 | 17.11.2052 | 1.300 | 593 | 0,03 |
| Zahlung(3) | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2027 | 17.600 | (717) | (0,03) |
| Zahlung(3) | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | 120.930 | (1.035) | (0,05) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 15.09.2036 | 2.400 | (636) | (0,03) |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,450 | 15.12.2035 | 200 | 65 | 0,00 |
| Zahlung(3) | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2024 | 9.900 | 117 | 0,01 |
| Erhalt(3) | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2052 | 2.300 | 493 | 0,02 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 12.04.2027 | 6.000 | (276) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 11.05.2027 | 4.300 | (198) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,700 | 11.04.2027 | 3.300 | (145) | (0,01) |
| Zahlung(3) | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 30.03.2024 | 130.139 | (651) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 13.05.2027 | 7.200 | (233) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.05.2027 | 3.500 | (114) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 4,870 | 07.07.2025 | MXN 20.400 | (119) | (0,01) |
| Zahlung | UKRPI | 3,700 | 15.04.2031 | £ 5.500 | (947) | (0,04) |
| Zahlung | UKRPI | 3,740 | 15.03.2031 | 2.700 | (415) | (0,02) |
| | | | | | $ (39.665) | (1,82) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (40.048)** | **(1,84)** |

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

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

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

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

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

## OPTIONSKAUF

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn betrag(1) | Kosten | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,180 % | 11.01.2024 | 8.600 | $ 246 | $ 620 | 0,03 |

### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag(1) | Kosten | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Put - OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052 | € 97,000 | 23.05.2025 | 2.200 | $ 166 | $ 763 | 0,03 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag(1) | Aufgeld | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,150 % | 01.12.2023 | 6.200 | $ (19) | $ (24) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,650 | 01.12.2023 | 6.200 | (19) | (21) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,310 | 11.01.2024 | 76.400 | (247) | (640) | (0,03) |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,310 | 19.08.2022 | 10.900 | (93) | (28) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,010 | 19.08.2022 | 10.900 | (93) | (102) | (0,01) |
| BPS | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 11.04.2023 | 9.400 | (10) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 11.04.2023 | 9.400 | (29) | (35) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 28.04.2023 | 6.400 | (11) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 28.04.2023 | 6.400 | (11) | (22) | 0,00 |
| | Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,451 | 23.05.2025 | 2.200 | (166) | (760) | (0,04) |
| CBK | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 01.09.2022 | 12.900 | (108) | (75) | (0,01) |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 01.09.2022 | 12.900 | (108) | (129) | (0,01) |
| GLM | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,870 | 02.11.2022 | 215.600 | (429) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,270 | 02.11.2022 | 215.600 | (429) | (4.943) | (0,23) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,920 | 13.10.2023 | 5.600 | (35) | (39) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,920 | 13.10.2023 | 5.600 | (35) | (31) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,018 | 20.10.2023 | 2.500 | (16) | (19) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,018 | 20.10.2023 | 2.500 | (16) | (13) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,140 | 23.10.2023 | 2.500 | (18) | (21) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,140 | 23.10.2023 | 2.500 | (18) | (12) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,190 | 23.10.2023 | 2.500 | (17) | (21) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,190 | 23.10.2023 | 2.500 | (17) | (12) | 0,00 |

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,225 % | 23.10.2023 | 2.600 | $ (18) | $ (23) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,225 | 23.10.2023 | 2.600 | (18) | (12) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,841 | 27.10.2023 | 3.000 | (21) | (20) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,841 | 27.10.2023 | 3.000 | (21) | (18) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,088 | 03.11.2023 | 5.400 | (39) | (44) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,088 | 03.11.2023 | 5.400 | (39) | (27) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,910 | 10.11.2023 | 3.000 | (20) | (22) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,910 | 10.11.2023 | 3.000 | (20) | (17) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 17.11.2023 | 5.100 | (19) | (21) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 17.11.2023 | 5.100 | (19) | (16) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,150 | 20.11.2023 | 4.600 | (16) | (18) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,650 | 20.11.2023 | 4.600 | (16) | (15) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 07.12.2023 | 5.200 | (16) | (23) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 07.12.2023 | 5.200 | (16) | (16) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,697 | 02.04.2024 | 9.300 | (73) | (67) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,697 | 02.04.2024 | 9.300 | (73) | (61) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,721 | 08.04.2024 | 2.800 | (21) | (21) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,721 | 08.04.2024 | 2.800 | (21) | (18) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 05.04.2023 | 18.200 | (34) | (10) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 05.04.2023 | 18.200 | (34) | (67) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 11.04.2023 | 31.800 | (62) | (18) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 11.04.2023 | 31.800 | (62) | (119) | (0,01) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 24.04.2023 | 5.800 | (6) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 24.04.2023 | 5.800 | (16) | (20) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 26.04.2023 | 6.800 | (12) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 26.04.2023 | 6.800 | (12) | (23) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 15.05.2023 | 9.300 | (16) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 15.05.2023 | 9.300 | (16) | (37) | 0,00 |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,370 | 18.08.2022 | 9.000 | (61) | (29) | 0,00 |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,070 | 18.08.2022 | 9.000 | (61) | (57) | 0,00 |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 06.09.2022 | 14.000 | (88) | (80) | (0,01) |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 06.09.2022 | 14.000 | (88) | (116) | (0,01) |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 | 07.09.2022 | 2.400 | (15) | (16) | 0,00 |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,100 | 07.09.2022 | 2.400 | (15) | (18) | 0,00 |
| JPM | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 0,820 | 16.12.2024 | 20.100 | (142) | (58) | 0,00 |
| MYC | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,993 | 11.10.2023 | 9.600 | (65) | (70) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,993 | 11.10.2023 | 9.600 | (65) | (51) | 0,00 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,150 | 12.07.2022 | 10.700 | (83) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | $ (3.383) | $ (8.221) | (0,37) |

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

## ZINSCAPS

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[2] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYC | Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor [1] | 1-Year USD-LIBOR | 0,000 % | 07.10.2022 | 11.500 | $ (12) | $ 0 | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor [1] | 1-Year USD-LIBOR | 0,000 | 08.10.2022 | 6.000 | (6) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (18) | $ 0 | 0,00 |

(1) Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SAL | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | $ 98,234 | 07.09.2022 | 8.900 | $ (50) | $ (39) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 100,234 | 07.09.2022 | 8.900 | (40) | (71) | (0,01) |
| | | | | | $ (90) | $ (110) | (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 | Nenn-betrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | South Korea Government International Bond | (1,000) % | 20.06.2023 | $ 1.500 | $ (37) | $ 23 | $ (14) | 0,00 |
| BRC | China Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 600 | (11) | 5 | (6) | 0,00 |
| | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 1.900 | (48) | 30 | (18) | 0,00 |
| GST | China Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 1.300 | (25) | 12 | (13) | 0,00 |
| HUS | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 600 | (15) | 9 | (6) | 0,00 |
| JPM | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 900 | (22) | 14 | (8) | 0,00 |
| | | | | | $ (158) | $ 93 | $ (65) | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | Italy Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2025 | $ 1.700 | $ (41) | $ 51 | $ 10 | 0,00 |
| CBK | Italy Government International Bond | 1,000 | 20.06.2025 | 1.100 | (27) | 33 | 6 | 0,00 |
| GST | Abu Dhabi Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 200 | 6 | (3) | 3 | 0,00 |
| | | | | | $ (62) | $ 81 | $ 19 | 0,00 |

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

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

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

## CROSS-CURRENCY SWAPS

| Kontrahent | Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,290 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 04.01.2031 | AUD 14.600 | $ 11.000 | $ 72 | $ (48) | $ 24 | 0,00 |
| CBK | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,420 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 31.07.2029 | 5.100 | 3.519 | (2 ) | 2 | 0 | 0,00 |
| GLM | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,423 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 01.08.2029 | 5.000 | 3.450 | (10 ) | 2 | (8) | 0,00 |
| MYC | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,298 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 14.10.2030 | 10.100 | 7.256 | 44 | (32) | 12 | 0,00 |
| | | | | | | $ 104 | $ (76) | $ 28 | 0,00 |

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Erhalt | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,250 % | 16.03.2032 | MYR 68.000 | $ 226 | $ 835 | $ 1.061 | 0,05 |
| | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 4,000 | 15.06.2027 | 27.100 | (72) | 122 | 50 | 0,00 |
| | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 4,250 | 15.06.2027 | 9.600 | 25 | 19 | 44 | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,000 | 16.03.2032 | THB 50.200 | 8 | (116) | (108) | (0,01) |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,000 | 15.06.2032 | 122.300 | (14) | (268) | (282) | (0,01) |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,750 | 15.06.2032 | 104.900 | (36) | (2) | (38) | 0,00 |
| BPS | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,000 | 15.06.2032 | 1.800 | (1) | (3) | (4) | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,250 | 15.06.2032 | 47.400 | 7 | 37 | 44 | 0,00 |
| CBK | Erhalt | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,500 | 16.03.2032 | MYR 10.700 | 6 | 108 | 114 | 0,01 |
| GLM | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,718 | 19.06.2029 | KRW 523.700 | 0 | (43) | (43) | 0,00 |
| | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,785 | 20.03.2029 | 3.569.000 | 0 | (274) | (274) | (0,01) |
| | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 4,000 | 15.06.2027 | MYR 43.700 | (73) | 153 | 80 | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,000 | 15.06.2032 | THB 53.000 | (3) | (119) | (122) | (0,01) |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,250 | 15.06.2032 | 10.300 | 2 | 8 | 10 | 0,00 |
| JPM | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,000 | 15.06.2032 | 113.200 | (12) | (249) | (261) | (0,01) |
| MBC | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,000 | 15.06.2032 | 30.900 | (8) | (63) | (71) | 0,00 |
| SCX | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,785 | 20.03.2029 | KRW 760.000 | 23 | (81) | (58) | 0,00 |
| | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,795 | 20.03.2029 | 554.000 | 0 | (42) | (42) | 0,00 |
| | Erhalt | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,500 | 16.03.2032 | MYR 5.400 | (17) | 74 | 57 | 0,00 |
| | | | | | | $ 61 | $ 96 | $ 157 | 0,01 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | $ | 1.073 | NZD | 1.707 | $ 0 | $ (12) | $ (12) | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | CAD | 808 | $ | 642 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 132.917 | | 168.059 | 6.638 | 0 | 6.638 | 0,31 |
| | 07.2022 | ¥ | 2.910.000 | | 23.917 | 2.497 | 0 | 2.497 | 0,12 |
| | 07.2022 | PEN | 5.662 | | 1.409 | 0 | (78) | (78) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 63.009 | DKK | 442.989 | 0 | (733) | (733) | (0,03) |
| | 07.2022 | | 1.274 | £ | 1.043 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.301 | PEN | 5.258 | 79 | 0 | 79 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.517 | ZAR | 38.617 | 0 | (162) | (162) | (0,01) |
| | 08.2022 | DKK | 442.090 | $ | 63.009 | 747 | 0 | 747 | 0,03 |
| | 08.2022 | $ | 45 | IDR | 656.540 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | ¥ | 3.390.000 | $ | 26.244 | 1.187 | 0 | 1.187 | 0,05 |
| | 09.2022 | PEN | 17.837 | | 4.618 | 0 | (46) | (46) | 0,00 |
| | 05.2023 | CNH | 89.246 | | 13.796 | 459 | 0 | 459 | 0,02 |
| BPS | 07.2022 | BRL | 27.853 | | 5.402 | 76 | 0 | 76 | 0,00 |
| | 07.2022 | CAD | 777 | | 618 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK | 14.195 | | 2.018 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 9.827 | | 10.345 | 71 | 0 | 71 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 319.800 | | 2.462 | 108 | 0 | 108 | 0,01 |
| | 07.2022 | MXN | 14.042 | | 699 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | NZD | 788 | | 493 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | PLN | 51 | | 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 5.273 | CHF | 5.054 | 7 | (1) | 6 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 16.988 | DKK | 119.490 | 5 | (195) | (190) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 21.452 | € | 20.239 | 0 | (294) | (294) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 4.877 | £ | 3.911 | 0 | (128) | (128) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 75.944 | ¥ | 10.247.700 | 13 | (526) | (513) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 671 | MXN | 14.042 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.258 | NZD | 2.007 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 153 | ZAR | 2.397 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 5.360 | BRL | 27.853 | 0 | (79) | (79) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 152 | THB | 5.315 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | ¥ | 3.248.000 | $ | 24.310 | 290 | 0 | 290 | 0,01 |
| | 09.2022 | $ | 688 | MXN | 14.042 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 03.2023 | ILS | 18.352 | $ | 5.422 | 91 | 0 | 91 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | ¥ | 6.960.000 | | 57.135 | 5.887 | 0 | 5.887 | 0,27 |
| | 07.2022 | NOK | 212.453 | | 21.671 | 168 | 0 | 168 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 1.249 | £ | 1.021 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 45.932 | ¥ | 6.230.705 | 0 | (69) | (69) | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 6.220.586 | $ | 45.932 | 67 | 0 | 67 | 0,00 |
| | 08.2022 | SGD | 7.547 | | 5.464 | 41 | 0 | 41 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 21.671 | NOK | 212.360 | 0 | (166) | (166) | (0,01) |
| | 09.2022 | ¥ | 3.832.000 | $ | 28.679 | 340 | 0 | 340 | 0,02 |
| | 09.2022 | $ | 11.967 | MYR | 52.576 | 0 | (45) | (45) | 0,00 |
| | 11.2022 | ILS | 2.400 | $ | 752 | 60 | 0 | 60 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | DKK | 77.060 | | 12.480 | 1.647 | 0 | 1.647 | 0,08 |
| | 07.2022 | NZD | 827 | | 516 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 5.239 | € | 4.889 | 0 | (127) | (127) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 1.469 | PEN | 5.662 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 08.2022 | ILS | 12.765 | $ | 3.967 | 317 | 0 | 317 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 1.238 | CLP | 1.090.301 | 0 | (82) | (82) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 651 | KRW | 832.987 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 09.2022 | PEN | 22.395 | $ | 5.808 | 0 | (49) | (49) | 0,00 |
| | 11.2022 | ILS | 4.960 | | 1.573 | 142 | 0 | 142 | 0,01 |
| | 12.2022 | | 38.297 | | 12.219 | 1.160 | 0 | 1.160 | 0,05 |
| | 12.2022 | $ | 1.106 | PEN | 4.639 | 97 | 0 | 97 | 0,00 |
| | 01.2023 | ILS | 28.695 | $ | 9.086 | 782 | 0 | 782 | 0,04 |
| | 03.2023 | PEN | 6.056 | | 1.567 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 04.2023 | | 5.662 | | 1.434 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 05.2023 | CNH | 9.805 | | 1.516 | 51 | 0 | 51 | 0,00 |
| | 05.2023 | ILS | 21.615 | | 6.394 | 91 | 0 | 91 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | $ | 5.606 | BRL | 27.853 | 0 | (280) | (280) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 2.258 | MXN | 46.110 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 08.2022 | THB | 132.590 | $ | 3.815 | 60 | 0 | 60 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 4.237 | CNH | 28.402 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 2.775 | SGD | 3.848 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 423 | MYR | 1.851 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 11.2022 | ILS | 47.996 | $ | 15.538 | 1.715 | 0 | 1.715 | 0,08 |
| | 03.2023 | CNH | 18.398 | | 2.849 | 102 | 0 | 102 | 0,00 |
| HUS | 07.2022 | $ | 341 | DKK | 2.060 | 0 | (51) | (51) | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | CZK | 1.806 | $ | 77 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 113.477 | | 5.580 | 0 | (35) | (35) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 4.151 | CLP | 3.460.996 | 0 | (465) | (465) | (0,02) |
| | 08.2022 | CNH | 23.101 | $ | 3.434 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 102.228.973 | | 6.894 | 67 | 0 | 67 | 0,00 |
| | 08.2022 | ILS | 7.556 | | 2.363 | 203 | 0 | 203 | 0,01 |
| | 08.2022 | ¥ | 4.890.000 | | 38.019 | 1.931 | 0 | 1.931 | 0,09 |
| | 08.2022 | KRW | 166.791 | | 131 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | SGD | 60.570 | | 44.064 | 539 | 0 | 539 | 0,02 |
| | 08.2022 | $ | 2.074 | CNH | 13.918 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 3.429 | IDR | 49.974.956 | 0 | (92) | (92) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 652 | PEN | 2.509 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 10.983 | SGD | 15.234 | 0 | (36) | (36) | 0,00 |
| | 12.2022 | ILS | 3.001 | $ | 973 | 106 | 0 | 106 | 0,01 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MBC | 07.2022 | AUD | 3.367 | | 2.388 | $ 73 | $ 0 | $ 73 | 0,00 |
| | 07.2022 | CAD | 3.021 | | 2.380 | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 547.724 | | 590.663 | 18.046 | 0 | 18.046 | 0,83 |
| | 07.2022 | £ | 442 | | 542 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 830.000 | | 6.731 | 616 | 0 | 616 | 0,03 |
| | 07.2022 | NZD | 2.816 | | 1.837 | 86 | 0 | 86 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.456 | AUD | 2.114 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.120 | CAD | 1.455 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.825 | DKK | 12.230 | 0 | (106) | (106) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 556.744 | € | 529.247 | 9 | (3.453) | (3.444) | (0,16) |
| | 07.2022 | | 33.435 | ¥ | 4.471.100 | 0 | (524) | (524) | (0,02) |
| | 08.2022 | AUD | 2.114 | $ | 1.456 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 75.920 | | 11.306 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 524.063 | | 552.316 | 3.423 | 0 | 3.423 | 0,16 |
| | 08.2022 | $ | 3.269 | IDR | 47.927.307 | 0 | (68) | (68) | 0,00 |
| | 09.2022 | ¥ | 14.200.000 | $ | 106.111 | 974 | 0 | 974 | 0,05 |
| | 05.2023 | CNH | 63.213 | | 9.419 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | DKK | 575.565 | | 85.459 | 4.545 | 0 | 4.545 | 0,21 |
| | 07.2022 | € | 242 | | 254 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 1.142 | | 1.380 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 240.200 | | 1.840 | 72 | 0 | 72 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 12.790 | DKK | 89.993 | 0 | (139) | (139) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 360 | £ | 297 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 9.191 | ¥ | 1.251.382 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNY | 335 | $ | 50 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 89.811 | | 12.790 | 142 | 0 | 142 | 0,01 |
| | 08.2022 | ¥ | 1.249.356 | | 9.191 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 08.2022 | KRW | 215.876 | | 169 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | THB | 323.214 | | 9.381 | 226 | 0 | 226 | 0,01 |
| | 09.2022 | $ | 1.232 | MYR | 5.405 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| RBC | 07.2022 | | 5.469 | CAD | 7.031 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 7.031 | $ | 5.469 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 5.500.000 | | 43.493 | 2.863 | 0 | 2.863 | 0,13 |
| | 09.2022 | $ | 3.816 | MXN | 78.519 | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | | 1.181 | £ | 971 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | ILS | 8.831 | $ | 2.620 | 97 | 0 | 97 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2.157 | £ | 1.756 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 9.058 | ¥ | 1.231.142 | 15 | (11) | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 118.487 | $ | 17.688 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNY | 537 | | 80 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 971.065 | | 7.144 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 08.2022 | KRW | 867.699 | | 673 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 09.2022 | MYR | 164.415 | | 39.044 | 1.765 | 0 | 1.765 | 0,08 |
| | 09.2022 | $ | 14.570 | MYR | 64.402 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 3.142 | ZAR | 48.576 | 0 | (198) | (198) | (0,01) |
| | 03.2023 | CNH | 27.028 | $ | 4.187 | 151 | 0 | 151 | 0,01 |
| TOR | 07.2022 | AUD | 263 | | 191 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 07.2022 | CAD | 29.935 | | 23.437 | 231 | 0 | 231 | 0,01 |
| | 07.2022 | ¥ | 20.483.531 | | 161.379 | 10.604 | 0 | 10.604 | 0,49 |
| | 07.2022 | $ | 16.505 | CAD | 21.233 | 3 | (47) | (44) | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 21.234 | $ | 16.505 | 47 | (3) | 44 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | $ | 22.538 | NOK | 212.521 | 0 | (1.027) | (1.027) | (0,05) |
| | 09.2022 | MXN | 94.537 | $ | 4.744 | 114 | 0 | 114 | 0,01 |
| | | | | | | $ 72.284 | $ (9.550) | $ 62.734 | 2,88 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Class Z AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | AUD | 58.466 | $ | 40.646 | $ 441 | $ 0 | $ 441 | 0,02 |
| | 07.2022 | $ | 186 | AUD | 259 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 40.656 | | 58.466 | 0 | (443) | (443) | (0,02) |
| BOA | 07.2022 | AUD | 68.731 | $ | 47.722 | 459 | 0 | 459 | 0,02 |
| | 07.2022 | $ | 60.797 | AUD | 84.457 | 0 | (2.720) | (2.720) | (0,13) |
| | 08.2022 | | 47.872 | | 68.933 | 0 | (461) | (461) | (0,02) |
| BPS | 07.2022 | AUD | 1.448 | $ | 1.012 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 159 | AUD | 231 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | | 793 | | 1.127 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | AUD | 23.031 | $ | 15.845 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 15.849 | AUD | 23.031 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | | 71.112 | | 99.003 | 0 | (3.032) | (3.032) | (0,14) |
| SCX | 07.2022 | AUD | 59.878 | $ | 41.177 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 41.187 | AUD | 59.878 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | AUD | 44.615 | $ | 30.704 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 623 | AUD | 874 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 30.712 | | 44.615 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | | 63.027 | | 88.237 | 0 | (2.350) | (2.350) | (0,11) |
| | | | | | | $ 951 | $ (9.094) | $ (8.143) | (0,38) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | CHF 287 | $ 298 | $ 0 | $ (2) | $ (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 13.658 | CHF 13.054 | 2 | (25) | (23) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | 373 | 359 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | 13.602 | 13.019 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | 5 | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | CHF 17 | $ 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 14 | CHF 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | CHF 316 | $ 328 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 13.308 | CHF 12.732 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | | | | $ 5 | $ (41) | $ (36) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional EUR (Currency Exposure) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | AUD 143 | $ 99 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK 140 | 20 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | SGD 1 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 11 | AUD 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 280 | CAD 355 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07.2022 | 20 | DKK 140 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | 1.890 | € 1.769 | 0 | (41) | (41) | 0,00 |
| | 07.2022 | 45 | £ 35 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | 1 | HUF 229 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 122 | ¥ 15.658 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07.2022 | 32 | SEK 314 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | 0 | SGD 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 23 | THB 775 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | 99 | AUD 143 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | 20 | DKK 140 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 1 | SGD 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | ILS 50 | $ 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | PEN 17 | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 1 | CAD 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 9 | CNY 58 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 1 | CZK 24 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 9 | € 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 381 | £ 304 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07.2022 | 38 | IDR 557.684 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | 2 | ¥ 214 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 10 | KRW 12.612 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 2 | MXN 47 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 15 | ILS 50 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 5 | PEN 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11.2022 | PEN 3 | $ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GSC | 07.2022 | CLP 4.219 | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | COP 34.442 | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | CZK 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | MYR 119 | 27 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | PLN 70 | 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | SGD 23 | 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 42 | CHF 40 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 5 | CLP 4.219 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | 66 | CNY 439 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 9 | COP 34.442 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | 9 | CZK 217 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 3 | € 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 5 | HUF 2.034 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 0 | IDR 73 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 2 | ILS 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 100 | KRW 124.414 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07.2022 | 27 | MYR 119 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 8 | NOK 72 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 5 | PEN 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 5 | CLP 4.219 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 8 | COP 34.442 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 27 | MYR 119 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 1 | PEN 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 16 | PLN 70 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 17 | SGD 23 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | CZK 241 | $ 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | HUF 2.261 | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN 461 | 23 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | THB 862 | 25 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 121 | AUD 169 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07.2022 | 5 | CHF 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 700 | CNY 4.679 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | 231 | € 215 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07.2022 | 1 | £ 1 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07.2022 | $ 14 | ILS 45 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | 1.078 | ¥ 140.353 | 0 | (45) | (45) | (0,01) |
| | 07.2022 | 21 | MXN 414 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 1 | NOK 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 13 | NZD 20 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | 16 | PLN 70 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | 6 | RON 30 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 4 | SEK 35 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 18 | SGD 24 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 3 | THB 87 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 10 | CZK 242 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 6 | HUF 2.271 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 23 | MXN 461 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 25 | THB 862 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 1 | $ (138) | $ (137) | (0,01) |

Zum 30. Juni 2022 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 Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | € 2.801 | $ 2.963 | $ 34 | $ 0 | $ 34 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 8.979 | € 8.364 | 0 | (235) | (235) | (0,01) |
| BPS | 07.2022 | € 299.468 | $ 314.980 | 1.903 | 0 | 1.903 | 0,09 |
| | 07.2022 | $ 14.300 | € 13.575 | 0 | (108) | (108) | (0,01) |
| | 08.2022 | 308.647 | 292.913 | 0 | (1.856) | (1.856) | (0,08) |
| CBK | 07.2022 | € 132 | $ 141 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 4.862 | € 4.528 | 0 | (128) | (128) | (0,01) |
| MBC | 07.2022 | € 293.663 | $ 308.935 | 1.928 | (1) | 1.927 | 0,09 |
| | 07.2022 | $ 319.769 | € 296.555 | 0 | (9.737) | (9.737) | (0,45) |
| | 08.2022 | 308.705 | 292.913 | 0 | (1.913) | (1.913) | (0,09) |
| SCX | 07.2022 | 267.010 | 249.261 | 0 | (6.420) | (6.420) | (0,29) |
| UAG | 07.2022 | 319.686 | 297.493 | 0 | (8.673) | (8.673) | (0,40) |
| | | | | $ 3.868 | $ (29.071) | $ (25.203) | (1,16) |

Zum 30. Juni 2022 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 Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | £ 28 | $ 35 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 39.500 | £ 31.241 | 0 | (1.560) | (1.560) | (0,07) |
| BPS | 07.2022 | £ 640 | $ 784 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 959 | £ 768 | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | £ 809 | $ 995 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 37.715 | £ 29.899 | 0 | (1.404) | (1.404) | (0,06) |
| CBK | 07.2022 | 389 | 310 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | £ 34 | $ 43 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 10 | £ 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | 14 | 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | £ 295 | $ 363 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | $ 38.561 | £ 30.587 | 0 | (1.415) | (1.415) | (0,07) |
| | | | | $ 25 | $ (4.419) | $ (4.394) | (0,20) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | $ 130.480 | NOK 1.231.537 | $ 0 | $ (5.827) | $ (5.827) | (0,26) |
| BPS | 07.2022 | NOK 27.739 | $ 2.804 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | $ 28.724 | NOK 270.577 | 0 | (1.337) | (1.337) | (0,06) |
| CBK | 07.2022 | 127.414 | 1.200.699 | 0 | (5.882) | (5.882) | (0,27) |
| GLM | 07.2022 | 47 | 445 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | 69.313 | 648.391 | 0 | (3.685) | (3.685) | (0,17) |
| MYI | 07.2022 | 1.790 | 17.824 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | NOK 25.746 | $ 2.622 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 5.927 | NOK 56.871 | 3 | (174) | (171) | (0,01) |
| SCX | 07.2022 | 1.390 | 13.804 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | 178.508 | 1.671.279 | 0 | (9.345) | (9.345) | (0,43) |
| | | | | $ 40 | $ (26.256) | $ (26.216) | (1,20) |

Zum 30. Juni 2022 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | NZD | 448 | $ | 285 | $ 6 | $ 0 | $ 6 | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | | 22.791 | | 14.204 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 16.067 | NZD | 24.713 | 0 | (701 ) | (701) | (0,03) |
| | 08.2022 | | 14.200 | | 22.791 | 0 | (33 ) | (33) | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | | 179 | | 274 | 0 | (8 ) | (8) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | | 16.095 | | 24.713 | 0 | (730 ) | (730) | (0,03) |
| SCX | 07.2022 | | 13.352 | | 20.514 | 0 | (597) | (597) | (0,03) |
| | | | | | | $ 40 | $ (2.069) | $ (2.029) | (0,09) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | $ | 1 | SEK | 8 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | SEK | 3.408 | $ | 332 | 1 | (1 ) | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 17.530 | SEK | 171.081 | 0 | (835 ) | (835 ) | (0,04) |
| BRC | 07.2022 | SEK | 164.376 | $ | 16.176 | 136 | 0 | 136 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 16.176 | SEK | 164.240 | 0 | (134 ) | (134 ) | (0,01) |
| CBK | 07.2022 | | 16.325 | | 159.597 | 0 | (750 ) | (750 ) | (0,03) |
| MBC | 07.2022 | SEK | 117 | $ | 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 169 | SEK | 1.713 | 0 | (2 ) | (2 ) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | SEK | 1 | $ | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 30 | | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 18.026 | SEK | 176.154 | 0 | (836 ) | (836 ) | (0,04) |
| | | | | | | $ 137 | $ (2.558 ) | $ (2.421 ) | (0,11) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **$ (12.654 )** | **(0,58)** |

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae, TBA** | | | |
| 3,500 % fällig am 18.07.2037 | $ 200 | $ (199) | (0,01) |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.07.2037 | 29.000 | (27.076) | (1,24) |
| 2,000 % fällig am 01.08.2052 | 139.250 | (120.756) | (5,55) |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 | 107.500 | (96.708) | (4,44) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (244.739)** | **(11,24)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 2.141.507** | **98,33** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ 36.367** | **1,67** |
| **Nettovermögen** | | **$ 2.177.874** | **100,00** |

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

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

**^** **Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a)** **Nullkuponwertpapier.**

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

**(c)** **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

**(d)** **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 45.079 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 26.210 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 2.240.146 | $ 0 | $ 2.240.146 |
| Investmentfonds | 5.707 | 0 | 0 | 5.707 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 188.985 | 0 | 188.985 |
| Finanzderivate[3] | 7.087 | (55.679) | 0 | (48.592) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (244.739) | 0 | (244.739) |
| **Summen** | **$ 12.794** | **$ 2.128.713** | **$ 0** | **$ 2.141.507** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 2.374.485 | $ 0 | $ 2.374.485 |
| Investmentfonds | 6.595 | 0 | 0 | 6.595 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 38.254 | 0 | 38.254 |
| Finanzderivate[3] | 3.264 | 14.315 | 0 | 17.579 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (197.580) | 0 | (197.580) |
| **Summen** | **$ 9.859** | **$ 2.229.474** | **$ 0** | **$ 2.239.333** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ 8 | $ 0 | $ 8 |
| BOA | (800) | 510 | (290) |
| BPS | (617) | 870 | 253 |
| BRC | 3.533 | (4.060) | (527) |
| CBK | (2.858) | 2.910 | 52 |
| GLM | (4.957) | 5.300 | 343 |
| GSC | (6) | 0 | (6) |
| GST | (10) | 20 | 10 |
| HUS | (57) | 0 | (57) |
| JPM | 1.889 | (2.040) | (151) |
| MBC | 1.846 | (1.780) | (66) |
| MYC | (109) | (290) | (399) |
| MYI | 4.852 | (4.680) | 172 |
| RBC | 2.893 | (2.990) | (97) |
| RYL | (157) | 0 | (157) |
| SAL | (110) | 0 | (110) |
| SCX | (6.060) | 5.360 | (700) |
| TOR | 62 | (810) | (748) |
| UAG | (11.996) | 11.190 | (806) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 58,83 | 70,78 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 42,59 | 31,15 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 1,44 | 1,18 |
| Investmentfonds | 0,26 | 0,29 |
| Pensionsgeschäfte | 8,68 | 1,66 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,19 | 0,20 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (1,84) | (0,29) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (0,58) | 0,85 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (11,24) | (8,58) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 29,36 | 34,64 |
| Kommunalanleihen und Wechsel | 0,01 | 0,01 |
| US-Regierungsbehörden | 18,00 | 8,33 |
| US-Schatzobligationen | 3,10 | 3,74 |
| Non-Agency-MBS | 6,65 | 5,77 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 12,04 | 9,18 |
| Staatsemissionen | 16,01 | 28,50 |
| Vorzugswertpapiere | 0,01 | 0,01 |
| Kurzfristige Instrumente | 17,68 | 12,93 |
| Investmentfonds | 0,26 | 0,29 |
| Pensionsgeschäfte | 8,68 | 1,66 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,19 | 0,20 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | 0,00 | k. A. |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,02) | 0,00 |
| Zinsswaps — Basisswaps | 0,00 | 0,00 |
| Zinsswaps | (1,82) | (0,29) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoptionen | 0,03 | 0,01 |
| Optionen auf Wertpapiere | 0,03 | 0,01 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Devisenoptionen | k. A. | 0,00 |
| Zinsswapoptionen | (0,37) | (0,12) |
| Zinscaps | 0,00 | 0,00 |
| Optionen auf Wertpapiere | (0,01) | k. A. |
| 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 | 0,00 |
| Cross-Currency Swaps | 0,00 | 0,00 |
| Zinsswaps | 0,01 | 0,01 |
| Devisenterminkontrakte | 2,88 | (0,26) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (3,15) | 1,21 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (11,24) | (8,58) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 1,67 | 2,76 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Pepper SPARKZ Trust** | | | | |
| 2,085 % fällig am 17.08.2028 | AUD | 764 | $ 525 | 0,07 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Pepper Residential Securities Trust** | | | | |
| 2,193 % fällig am 16.09.2059 | | 408 | 280 | 0,04 |
| **RESIMAC Bastille Trust** | | | | |
| 1,733 % fällig am 05.09.2057 | $ | 301 | 301 | 0,04 |
| | | | 581 | 0,08 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Australia Government International Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 21.09.2026 | AUD | 12.200 | 7.470 | 1,02 |
| 1,000 % fällig am 21.12.2030 | | 1.100 | 613 | 0,08 |
| 1,000 % fällig am 21.11.2031 | | 1.200 | 653 | 0,09 |
| 1,250 % fällig am 21.05.2032 | | 900 | 496 | 0,07 |
| 1,750 % fällig am 21.06.2051 | | 1.850 | 809 | 0,11 |
| 2,500 % fällig am 21.05.2030 | | 800 | 509 | 0,07 |
| 4,500 % fällig am 21.04.2033 | | 3.100 | 2.287 | 0,31 |
| **Treasury Corp. of Victoria** | | | | |
| 4,250 % fällig am 20.12.2032 | | 1.700 | 1.164 | 0,16 |
| | | | 14.001 | 1,91 |
| Summe Australien | | | 15.107 | 2,06 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Bradesco S.A.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 27.01.2023 | $ | 1.500 | 1.494 | 0,20 |
| **KANADA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028 | € | 1.600 | 1.550 | 0,21 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Real Estate Asset Liquidity Trust** | | | | |
| 3,072 % fällig am 12.08.2053 | CAD | 549 | 422 | 0,06 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Canada Government International Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.12.2051 | | 6.800 | 4.106 | 0,56 |
| 2,750 % fällig am 01.12.2048 | | 400 | 287 | 0,04 |
| **Canadian Government Real Return Bond** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.12.2044 (e) | | 907 | 714 | 0,10 |
| **Ontario Teachers' Finance Trust** | | | | |
| 0,900 % fällig am 20.05.2041 | € | 700 | 533 | 0,07 |
| 1,850 % fällig am 03.05.2032 | | 3.300 | 3.248 | 0,44 |
| **Province of Ontario** | | | | |
| 0,010 % fällig am 25.11.2030 | | 2.300 | 1.995 | 0,27 |
| | | | 10.883 | 1,48 |
| Summe Kanada | | | 12.855 | 1,75 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Apidos CLO** | | | | |
| 2,073 % fällig am 20.04.2031 | $ | 2.400 | 2.359 | 0,32 |
| **BlueMountain CLO Ltd.** | | | | |
| 2,124 % fällig am 15.07.2031 | | 2.000 | 1.961 | 0,27 |
| **Catamaran CLO Ltd.** | | | | |
| 2,236 % fällig am 22.04.2030 | | 2.587 | 2.553 | 0,35 |
| **CBAM CLO Ltd.** | | | | |
| 2,064 % fällig am 17.04.2031 | | 2.000 | 1.964 | 0,27 |
| **LCM LP** | | | | |
| 2,103 % fällig am 20.10.2027 | | 871 | 866 | 0,12 |
| **Marathon CLO Ltd.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 21.11.2027 | | 151 | 151 | 0,02 |
| **Regatta Funding Ltd.** | | | | |
| 2,294 % fällig am 17.10.2030 | | 1.100 | 1.087 | 0,15 |
| **TIAA CLO Ltd.** | | | | |
| 2,263 % fällig am 20.07.2031 | | 2.200 | 2.160 | 0,29 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | |
| 1,924 % fällig am 15.04.2027 | $ | 365 | $ 361 | 0,05 |
| 2,113 % fällig am 20.07.2030 | | 2.500 | 2.470 | 0,34 |
| **Voya CLO Ltd.** | | | | |
| 2,254 % fällig am 15.10.2030 | | 1.793 | 1.770 | 0,24 |
| | | | 17.702 | 2,42 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 26.01.2026 | | 600 | 546 | 0,07 |
| **S.A. Global Sukuk Ltd.** | | | | |
| 2,694 % fällig am 17.06.2031 | | 600 | 529 | 0,07 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 08.08.2025 | | 500 | 420 | 0,06 |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028 | | 900 | 695 | 0,09 |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,595 % fällig am 19.01.2028 | | 200 | 190 | 0,03 |
| **U.S. Capital Funding Ltd.** | | | | |
| 2,036 % fällig am 01.08.2034 | | 285 | 281 | 0,04 |
| | | | 2.661 | 0,36 |
| Summe Cayman Inseln | | | 20.363 | 2,78 |
| **CHINA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **China Development Bank** | | | | |
| 3,390 % fällig am 10.07.2027 | CNY | 7.200 | 1.099 | 0,15 |
| 4,040 % fällig am 10.04.2027 | | 24.600 | 3.861 | 0,53 |
| 4,240 % fällig am 24.08.2027 | | 152.200 | 24.143 | 3,29 |
| 4,880 % fällig am 09.02.2028 | | 40.800 | 6.692 | 0,91 |
| **China Government Bond** | | | | |
| 3,010 % fällig am 13.05.2028 | | 13.300 | 2.013 | 0,27 |
| 3,530 % fällig am 18.10.2051 | | 29.100 | 4.510 | 0,61 |
| 3,720 % fällig am 12.04.2051 | | 14.500 | 2.312 | 0,32 |
| 3,810 % fällig am 14.09.2050 | | 24.300 | 3.928 | 0,54 |
| Summe China | | | 48.558 | 6,62 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 39.984 | 4.230 | 0,58 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 2.093 | 230 | 0,03 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 51.648 | 5.572 | 0,76 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 6.139 | 710 | 0,10 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 61.261 | 6.640 | 0,90 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 23.430 | 2.610 | 0,36 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2036 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 13.968 | 1.543 | 0,21 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2053 | | 19.374 | 2.307 | 0,31 |
| 2,500 % fällig am 01.04.2036 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.04.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| Summe Dänemark | | | 23.842 | 3,25 |
| **FINNLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Nordea Bank Abp** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.03.2029 (f)(h) | $ | 600 | 443 | 0,06 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Finnvera Oyj** | | | | |
| 0,625 % fällig am 22.09.2022 | € | 600 | $ 629 | 0,09 |
| Summe Finnland | | | 1.072 | 0,15 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 1,675 % fällig am 30.06.2027 | $ | 1.300 | 1.147 | 0,16 |
| 2,159 % fällig am 15.09.2029 | | 1.300 | 1.089 | 0,15 |
| 2,591 % fällig am 20.01.2028 | | 1.200 | 1.080 | 0,15 |
| 3,132 % fällig am 20.01.2033 | | 1.400 | 1.173 | 0,16 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 2,045 % fällig am 19.10.2027 | | 600 | 530 | 0,07 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 1,488 % fällig am 14.12.2026 | | 700 | 618 | 0,08 |
| 2,797 % fällig am 19.01.2028 | | 700 | 626 | 0,09 |
| 3,337 % fällig am 21.01.2033 | | 2.100 | 1.721 | 0,23 |
| 4,677 % fällig am 15.06.2027 | | 1.700 | 1.691 | 0,23 |
| | | | 9.675 | 1,32 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **France Government International Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 25.05.2072 (k) | € | 900 | 414 | 0,06 |
| 0,750 % fällig am 25.05.2052 (k) | | 8.600 | 5.713 | 0,78 |
| 2,000 % fällig am 25.05.2048 (k) | | 11.500 | 10.999 | 1,50 |
| 2,250 % fällig am 25.10.2022 | | 5.300 | 5.585 | 0,76 |
| 3,250 % fällig am 25.05.2045 (k) | | 200 | 239 | 0,03 |
| **SNCF Reseau** | | | | |
| 0,750 % fällig am 25.05.2036 | | 3.100 | 2.591 | 0,35 |
| | | | 25.541 | 3,48 |
| Summe Frankreich | | | 35.216 | 4,80 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,050 % fällig am 20.11.2024 | | 4.900 | 4.938 | 0,67 |
| 1,000 % fällig am 19.11.2025 | | 200 | 197 | 0,03 |
| 1,375 % fällig am 03.09.2026 | | 3.400 | 3.307 | 0,45 |
| 1,375 % fällig am 17.02.2032 | | 1.500 | 1.199 | 0,16 |
| 1,625 % fällig am 20.01.2027 | | 3.300 | 3.094 | 0,42 |
| 1,750 % fällig am 19.11.2030 | | 1.000 | 863 | 0,12 |
| 3,729 % fällig am 14.01.2032 (j) | $ | 300 | 226 | 0,03 |
| 3,961 % fällig am 26.11.2025 | | 900 | 871 | 0,12 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK)** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2025 (b) | € | 1.300 | 1.188 | 0,16 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** | | | | |
| 5,000 % fällig am 19.03.2024 | AUD | 100 | 71 | 0,01 |
| **Landwirtschaftliche Rentenbank** | | | | |
| 4,250 % fällig am 24.01.2023 | | 1.500 | 1.040 | 0,14 |
| 5,375 % fällig am 23.04.2024 | NZD | 1.100 | 699 | 0,10 |
| **Vonovia SE** | | | | |
| 1,375 % fällig am 28.01.2026 | € | 1.300 | 1.261 | 0,17 |
| Summe Deutschland | | | 18.954 | 2,58 |
| **GUERNSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.09.2022 | $ | 400 | 400 | 0,05 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Poly Real Estate Finance Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 05.02.2023 | | 600 | 599 | 0,08 |
| **Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.** | | | | |
| 3,074 % fällig am 25.05.2023 | | 600 | 596 | 0,08 |
| Summe Hongkong | | | 1.195 | 0,16 |
| **IRLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Accunia European CLO DAC** | | | | |
| 0,950 % fällig am 15.07.2030 | € | 718 | 741 | 0,10 |
| **Armada Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.07.2031 | | 800 | 815 | 0,11 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Aurium CLO DAC** | | | | |
| 0,730 % fällig am 16.01.2031 | € | 2.100 $ | 2.157 | 0,29 |
| **Black Diamond CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 03.10.2029 | | 237 | 248 | 0,03 |
| 0,980 % fällig am 15.05.2032 | | 2.400 | 2.452 | 0,33 |
| **BNPP AM Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,820 % fällig am 22.07.2032 | | 2.200 | 2.233 | 0,30 |
| **Cairn CLO DAC** | | | | |
| 0,600 % fällig am 30.04.2031 | | 1.599 | 1.650 | 0,22 |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | | 850 | 866 | 0,12 |
| **Carlyle Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,700 % fällig am 15.01.2031 | | 1.500 | 1.532 | 0,21 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,960 % fällig am 16.01.2033 | | 1.900 | 1.932 | 0,26 |
| **Dryden Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.04.2033 | | 1.200 | 1.217 | 0,17 |
| 0,860 % fällig am 15.05.2034 | | 1.200 | 1.214 | 0,17 |
| **GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC** | | | | |
| 0,900 % fällig am 20.01.2032 | | 2.000 | 2.032 | 0,28 |
| **Griffith Park CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 21.11.2031 | | 1.000 | 1.024 | 0,14 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | | 461 | 480 | 0,07 |
| 0,680 % fällig am 20.10.2031 | | 1.000 | 1.020 | 0,14 |
| 0,760 % fällig am 15.07.2031 | | 2.100 | 2.114 | 0,29 |
| 0,850 % fällig am 15.01.2032 | | 2.100 | 2.137 | 0,29 |
| **Jubilee CLO DAC** | | | | |
| 0,391 % fällig am 12.07.2028 | | 200 | 209 | 0,03 |
| 0,519 % fällig am 15.12.2029 | | 360 | 372 | 0,05 |
| 0,600 % fällig am 15.04.2030 | | 1.200 | 1.237 | 0,17 |
| 0,650 % fällig am 15.04.2031 | | 800 | 809 | 0,11 |
| **Laurelin DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 20.10.2031 | | 2.100 | 2.151 | 0,29 |
| **Madison Park Euro Funding DAC** | | | | |
| 0,800 % fällig am 15.07.2032 | | 2.200 | 2.230 | 0,30 |
| **Oak Hill European Credit Partners DAC** | | | | |
| 0,740 % fällig am 20.10.2031 | | 2.200 | 2.239 | 0,31 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.10.2031 | | 2.550 | 2.611 | 0,36 |
| **Sculptor European CLO DAC** | | | | |
| 0,790 % fällig am 14.01.2032 | | 2.100 | 2.120 | 0,29 |
| **Segovia European CLO DAC** | | | | |
| 0,880 % fällig am 20.07.2032 | | 2.000 | 2.032 | 0,28 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | |
| 0,810 % fällig am 15.02.2034 | | 2.200 | 2.223 | 0,30 |
| | | | 44.097 | 6,01 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 1,150 % fällig am 29.10.2023 | $ | 600 | 572 | 0,08 |
| 1,650 % fällig am 29.10.2024 | | 500 | 462 | 0,06 |
| 1,750 % fällig am 29.10.2024 | | 500 | 462 | 0,06 |
| **AIB Group PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 12.10.2023 | | 400 | 400 | 0,06 |
| **Bank of Ireland Group PLC** | | | | |
| 1,875 % fällig am 05.06.2026 | € | 900 | 896 | 0,12 |
| | | | 2.792 | 0,38 |
| Summe Irland | | | 46.889 | 6,39 |
| **ISRAEL** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Israel Government International Bond** | | | | |
| 0,750 % fällig am 31.07.2022 | ILS | 6.400 | 1.827 | 0,25 |
| 2,000 % fällig am 31.03.2027 | | 7.600 | 2.135 | 0,29 |
| 3,800 % fällig am 13.05.2060 | $ | 1.900 | 1.588 | 0,22 |
| 4,125 % fällig am 17.01.2048 | | 500 | 462 | 0,06 |
| Summe Israel | | | 6.012 | 0,82 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AMCO - Asset Management Co. SpA** | | | | |
| 1,500 % fällig am 17.07.2023 | € | 2.000 | 2.099 | 0,28 |
| **Atlantia SpA** | | | | |
| 1,875 % fällig am 12.02.2028 | | 600 | 490 | 0,07 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 0,875 % fällig am 08.10.2027 | € | 200 $ | 198 | 0,03 |
| 2,000 % fällig am 29.01.2024 | | 2.200 | 2.320 | 0,32 |
| 2,625 % fällig am 28.04.2025 | | 100 | 93 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 10.07.2022 (k) | | 700 | 730 | 0,10 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 7,500 % fällig am 03.06.2026 (f)(h) | | 1.000 | 968 | 0,13 |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | $ | 2.800 | 2.900 | 0,39 |
| | | | 9.798 | 1,33 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Italy Government International Bond** | | | | |
| 6,000 % fällig am 04.08.2028 (k) | £ | 100 | 136 | 0,02 |
| Summe Italien | | | 9.934 | 1,35 |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | |
| 2,721 % fällig am 11.09.2024 | $ | 1.500 | 1.498 | 0,20 |
| 3,922 % fällig am 11.09.2024 | | 1.000 | 998 | 0,14 |
| **Nissan Motor Co. Ltd.** | | | | |
| 3,522 % fällig am 17.09.2025 | | 200 | 190 | 0,03 |
| 4,345 % fällig am 17.09.2027 | | 1.400 | 1.286 | 0,18 |
| 4,810 % fällig am 17.09.2030 | | 1.000 | 889 | 0,12 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,409 % fällig am 07.11.2029 | € | 1.800 | 1.643 | 0,22 |
| 2,014 % fällig am 07.11.2022 | $ | 6.000 | 5.987 | 0,82 |
| **Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.** | | | | |
| 0,010 % fällig am 15.10.2027 | € | 2.000 | 1.873 | 0,25 |
| | | | 14.364 | 1,96 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Japan Finance Organization for Municipalities** | | | | |
| 3,375 % fällig am 27.09.2023 | $ | 1.800 | 1.803 | 0,25 |
| **Japan Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 10.03.2028 (e) | ¥ | 791.190 | 6.121 | 0,84 |
| 0,100 % fällig am 20.06.2031 | | 1.215.300 | 8.824 | 1,20 |
| 0,500 % fällig am 20.03.2049 | | 976.000 | 6.111 | 0,83 |
| 0,700 % fällig am 20.12.2048 | | 1.168.000 | 7.734 | 1,05 |
| 0,700 % fällig am 20.09.2051 | | 670.000 | 4.328 | 0,59 |
| 1,400 % fällig am 20.09.2034 | | 2.840.000 | 23.218 | 3,17 |
| **Tokyo Metropolitan Government** | | | | |
| 0,750 % fällig am 16.07.2025 | $ | 800 | 736 | 0,10 |
| 2,625 % fällig am 29.05.2024 | | 400 | 394 | 0,05 |
| | | | 59.269 | 8,08 |
| Summe Japan | | | 73.633 | 10,04 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.07.2043 | £ | 200 | 238 | 0,03 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 16.07.2026 (c) | € | 700 | 595 | 0,08 |
| 0,375 % fällig am 15.04.2027 | | 100 | 82 | 0,01 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 12.05.2026 | | 2.100 | 1.956 | 0,27 |
| **Cromwell Ereit Lux Finco SARL** | | | | |
| 2,125 % fällig am 19.11.2025 | | 500 | 428 | 0,06 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 0,625 % fällig am 17.11.2025 | | 1.400 | 1.307 | 0,18 |
| | | | 4.368 | 0,60 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Miravet SARL** | | | | |
| 0,494 % fällig am 26.05.2065 | | 1.051 | 1.102 | 0,15 |
| Summe Luxemburg | | | 5.470 | 0,75 |
| **MALAYSIA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Petronas Capital Ltd.** | | | | |
| 2,480 % fällig am 28.01.2032 | $ | 400 | 341 | 0,05 |
| 3,500 % fällig am 21.04.2030 | | 400 | 377 | 0,05 |
| 4,550 % fällig am 21.04.2050 | $ | 300 $ | 287 | 0,04 |
| 4,800 % fällig am 21.04.2060 | | 300 | 294 | 0,04 |
| | | | 1.299 | 0,18 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Malaysia Government International Bond** | | | | |
| 4,065 % fällig am 15.06.2050 | MYR | 5.100 | 1.004 | 0,14 |
| **Malaysia Government Investment Issue** | | | | |
| 4,369 % fällig am 31.10.2028 | | 26.100 | 5.976 | 0,81 |
| | | | 6.980 | 0,95 |
| Summe Malaysia | | | 8.279 | 1,13 |
| **MEXIKO** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.03.2115 | € | 400 | 297 | 0,04 |
| **MULTINATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Preferred Term Securities Ltd.** | | | | |
| 2,430 % fällig am 23.06.2035 | $ | 1.109 | 1.050 | 0,14 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 3,649 % fällig am 06.04.2028 | | 1.500 | 1.426 | 0,20 |
| 3,758 % fällig am 06.04.2033 | | 600 | 542 | 0,07 |
| **CTP NV** | | | | |
| 0,625 % fällig am 27.09.2026 | € | 600 | 501 | 0,07 |
| 0,875 % fällig am 20.01.2026 | | 900 | 788 | 0,11 |
| 1,500 % fällig am 27.09.2031 | | 600 | 381 | 0,05 |
| **Enel Finance International NV** | | | | |
| 1,875 % fällig am 12.07.2028 | $ | 800 | 672 | 0,09 |
| 2,650 % fällig am 10.09.2024 | | 1.100 | 1.066 | 0,15 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 1,250 % fällig am 16.02.2027 | € | 1.900 | 1.848 | 0,25 |
| 2,125 % fällig am 23.05.2026 | | 400 | 407 | 0,06 |
| 5,750 % fällig am 16.11.2026 (f)(h) | $ | 1.100 | 1.007 | 0,14 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 0,125 % fällig am 13.09.2023 | € | 2.300 | 2.350 | 0,32 |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | |
| 6,500 % (f) | | 371 | 378 | 0,05 |
| **Volkswagen Financial Services NV** | | | | |
| 1,125 % fällig am 18.09.2023 | £ | 200 | 235 | 0,03 |
| **Volkswagen International Finance NV** | | | | |
| 1,125 % fällig am 02.10.2023 | € | 1.800 | 1.864 | 0,25 |
| 1,144 % fällig am 16.11.2024 | | 2.800 | 2.991 | 0,41 |
| | | | 16.456 | 2,25 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Jubilee Place BV** | | | | |
| 0,552 % fällig am 17.10.2057 | | 1.299 | 1.340 | 0,18 |
| Summe Niederlande | | | 17.796 | 2,43 |
| **NEUSEELAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **New Zealand Government International Bond** | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.05.2031 | NZD | 1.300 | 668 | 0,09 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Kommunalbanken A/S** | | | | |
| 1,900 % fällig am 19.01.2027 | AUD | 1.600 | 994 | 0,14 |
| **Norway Government International Bond** | | | | |
| 1,750 % fällig am 13.03.2025 | NOK | 6.300 | 618 | 0,08 |
| Summe Norwegen | | | 1.612 | 0,22 |
| **PERU** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco de Credito del Peru S.A.** | | | | |
| 4,650 % fällig am 17.09.2024 | PEN | 2.400 | 585 | 0,08 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,350 % fällig am 12.08.2040 | PEN | 1.900 | $375 | 0,05 |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | | 11.400 | 2.742 | 0,37 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 2.000 | 466 | 0,06 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 | | 17.400 | 4.318 | 0,59 |
| 6,950 % fällig am 12.08.2031 | | 2.200 | 550 | 0,08 |
| | | | 8.451 | 1,15 |
| Summe Peru | | | 9.036 | 1,23 |
| **PORTUGAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Espirito Santo S.A.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 21.01.2019 ^ | € | 400 | 73 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2018 ^ | | 700 | 128 | 0,02 |
| **EDP - Energias de Portugal S.A.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 27.11.2023 | | 800 | 839 | 0,11 |
| Summe Portugal | | | 1.040 | 0,14 |
| **KATAR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Qatar Energy** | | | | |
| 2,250 % fällig am 12.07.2031 | $ | 400 | 342 | 0,05 |
| 3,125 % fällig am 12.07.2041 | | 700 | 551 | 0,08 |
| 3,300 % fällig am 12.07.2051 | | 700 | 542 | 0,07 |
| Summe Katar | | | 1.435 | 0,20 |
| **RUMÄNIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Romania Government International Bond** | | | | |
| 1,375 % fällig am 02.12.2029 | € | 630 | 477 | 0,06 |
| 1,750 % fällig am 13.07.2030 | | 1.000 | 747 | 0,10 |
| 2,000 % fällig am 28.01.2032 | | 600 | 430 | 0,06 |
| 2,000 % fällig am 14.04.2033 | | 700 | 476 | 0,06 |
| 2,124 % fällig am 16.07.2031 | | 400 | 297 | 0,04 |
| 2,625 % fällig am 02.12.2040 | | 600 | 366 | 0,05 |
| 2,875 % fällig am 13.04.2042 | | 800 | 491 | 0,07 |
| 3,750 % fällig am 07.02.2034 | | 800 | 629 | 0,09 |
| Summe Rumänien | | | 3.913 | 0,53 |
| **SAUDI-ARABIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Saudi Arabian Oil Co.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 24.11.2050 | $ | 500 | 364 | 0,05 |
| 3,500 % fällig am 24.11.2070 | | 900 | 640 | 0,09 |
| Summe Saudi-Arabien | | | 1.004 | 0,14 |
| **SERBIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Serbia Government International Bond** | | | | |
| 1,000 % fällig am 23.09.2028 | € | 1.700 | 1.298 | 0,18 |
| 2,050 % fällig am 23.09.2036 | | 900 | 557 | 0,07 |
| Summe Serbien | | | 1.855 | 0,25 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 18.09.2022 | $ | 200 | 200 | 0,03 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Singapore Government International Bond** | | | | |
| 1,625 % fällig am 01.07.2031 | SGD | 9.200 | 5.921 | 0,81 |
| 2,875 % fällig am 01.09.2030 | | 9.300 | 6.651 | 0,90 |
| | | | 12.572 | 1,71 |
| Summe Singapur | | | 12.772 | 1,74 |
| **SLOWENIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Nova Kreditna Banka Maribor d.d.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 27.01.2025 | € | 700 | 691 | 0,09 |
| **Nova Ljubljanska Banka d.d.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 05.02.2030 | | 1.000 | 920 | 0,13 |
| Summe Slowenien | | | 1.611 | 0,22 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 4,850 % fällig am 30.09.2029 | $ | 300 | $257 | 0,04 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **South Korea Government International Bond** | | | | |
| 2,125 % fällig am 10.06.2027 | KRW | 2.095.000 | 1.506 | 0,21 |
| 2,375 % fällig am 10.12.2027 | | 2.480.000 | 1.792 | 0,24 |
| 2,375 % fällig am 10.12.2028 | | 10.348.00 | | |
| | | 0 | 7.406 | 1,01 |
| 2,625 % fällig am 10.06.2028 | | 4.190.000 | 3.056 | 0,42 |
| 5,500 % fällig am 10.03.2028 | | 2.480.000 | 2.093 | 0,28 |
| Summe Südkorea | | | 15.853 | 2,16 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **BBVA Consumer Auto** | | | | |
| 0,270 % fällig am 20.07.2031 | € | 786 | 810 | 0,11 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (f)(h) | | 1.000 | 1.007 | 0,14 |
| **Banco de Sabadell S.A.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 10.05.2024 | | 100 | 101 | 0,01 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 1,849 % fällig am 25.03.2026 | $ | 200 | 180 | 0,02 |
| 3,848 % fällig am 12.04.2023 | | 400 | 400 | 0,05 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 24.10.2023 | € | 900 | 936 | 0,13 |
| 3,625 % fällig am 14.09.2028 (f)(h) | | 1.800 | 1.301 | 0,18 |
| | | | 3.925 | 0,53 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 4,220 % fällig am 26.04.2035 | | 400 | 452 | 0,06 |
| **Spain Government International Bond** | | | | |
| 1,450 % fällig am 31.10.2071 (k) | | 2.200 | 1.289 | 0,18 |
| 1,900 % fällig am 31.10.2052 | | 300 | 236 | 0,03 |
| 3,450 % fällig am 30.07.2066 (k) | | 4.200 | 4.573 | 0,62 |
| 5,250 % fällig am 06.04.2029 | £ | 500 | 690 | 0,10 |
| | | | 7.240 | 0,99 |
| Summe Spanien | | | 11.975 | 1,63 |
| **SUPRANATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung** | | | | |
| 0,500 % fällig am 21.12.2023 | AUD | 3.100 | 2.034 | 0,28 |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | |
| 0,500 % fällig am 21.07.2023 | | 1.200 | 800 | 0,11 |
| **Inter-American Development Bank** | | | | |
| 2,500 % fällig am 14.04.2027 | | 1.300 | 829 | 0,11 |
| Summe Supranational | | | 3.663 | 0,50 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **EQT AB** | | | | |
| 2,375 % fällig am 06.04.2028 | € | 700 | 668 | 0,09 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 3,625 % fällig am 09.09.2024 | $ | 500 | 491 | 0,07 |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (h) | | 700 | 702 | 0,10 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 2,945 % fällig am 14.12.2023 | | 3.400 | 3.398 | 0,46 |
| 3,800 % fällig am 09.06.2023 | | 1.800 | 1.784 | 0,24 |
| 3,869 % fällig am 12.01.2029 | | 1.150 | 1.034 | 0,14 |
| 4,282 % fällig am 09.01.2028 | | 450 | 421 | 0,06 |
| 4,550 % fällig am 17.04.2026 | | 750 | 734 | 0,10 |
| 6,250 % fällig am 18.12.2024 (f)(h) | | 200 | 183 | 0,03 |
| 6,375 % fällig am 21.08.2026 (f)(h) | $ | 200 | $166 | 0,02 |
| 7,500 % fällig am 11.12.2023 (f)(h) | | 1.000 | 955 | 0,13 |
| **UBS AG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (h) | | 900 | 900 | 0,12 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (h) | | 4.250 | 4.263 | 0,58 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 4,488 % fällig am 12.05.2026 | | 400 | 399 | 0,05 |
| 4,751 % fällig am 12.05.2028 | | 400 | 396 | 0,05 |
| 4,875 % fällig am 12.02.2027 (f)(h) | | 400 | 336 | 0,05 |
| Summe Schweiz | | | 16.162 | 2,20 |
| **THAILAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Thailand Government International Bond** | | | | |
| 1,585 % fällig am 17.12.2035 | THB | 199.700 | 4.578 | 0,63 |
| 3,300 % fällig am 17.06.2038 | | 26.400 | 719 | 0,10 |
| 3,650 % fällig am 20.06.2031 | | 3.100 | 93 | 0,01 |
| Summe Thailand | | | 5.390 | 0,74 |
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Emirate of Abu Dhabi Government International Bond** | | | | |
| 3,875 % fällig am 16.04.2050 | $ | 300 | 267 | 0,04 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Bumper UK Finance PLC** | | | | |
| 1,540 % fällig am 20.12.2028 | £ | 6 | 8 | 0,00 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (h) | $ | 4.790 | 4.838 | 0,66 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 06.10.2023 | £ | 1.800 | 2.181 | 0,30 |
| 4,375 % fällig am 12.01.2026 | $ | 200 | 198 | 0,03 |
| 8,000 % fällig am 15.06.2024 (f)(h) | | 2.200 | 2.167 | 0,29 |
| **FCE Bank PLC** | | | | |
| 1,615 % fällig am 11.05.2023 | € | 400 | 414 | 0,06 |
| **GSK Consumer Healthcare Capital UK PLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 24.03.2025 | $ | 1.200 | 1.170 | 0,16 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 2,251 % fällig am 22.11.2027 | | 2.300 | 2.051 | 0,28 |
| 2,455 % fällig am 18.05.2024 | | 1.000 | 992 | 0,13 |
| 2,804 % fällig am 24.05.2032 | | 2.200 | 1.809 | 0,25 |
| 2,999 % fällig am 10.03.2026 | | 500 | 477 | 0,06 |
| 3,950 % fällig am 18.05.2024 | | 400 | 398 | 0,05 |
| 4,041 % fällig am 13.03.2028 | | 300 | 285 | 0,04 |
| 4,583 % fällig am 19.06.2029 | | 1.300 | 1.254 | 0,17 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 3,900 % fällig am 12.03.2024 | | 1.100 | 1.094 | 0,15 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 3,766 % fällig am 08.03.2024 | | 4.300 | 4.290 | 0,58 |
| 5,875 % fällig am 20.12.2024 (f)(h) | £ | 500 | 577 | 0,08 |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 22.03.2023 | € | 2.100 | 2.216 | 0,30 |
| 3,875 % fällig am 12.09.2023 | $ | 500 | 499 | 0,07 |
| 5,125 % fällig am 12.05.2027 (f)(h) | £ | 400 | 412 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 29.12.2025 (f)(h) | $ | 1.300 | 1.206 | 0,16 |
| 8,000 % fällig am 10.08.2025 (f)(h) | | 200 | 198 | 0,03 |
| **NatWest Markets PLC** | | | | |
| 1,000 % fällig am 28.05.2024 | € | 1.000 | 1.024 | 0,14 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 3,373 % fällig am 05.01.2024 | $ | 3.900 | 3.883 | 0,53 |
| 4,796 % fällig am 15.11.2024 | | 1.700 | 1.701 | 0,23 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 1,822 % fällig am 23.11.2025 | | 1.800 | 1.668 | 0,23 |
| 2,678 % fällig am 29.06.2032 | | 2.700 | 2.170 | 0,30 |
| **Tesco Property Finance PLC** | | | | |
| 5,744 % fällig am 13.04.2040 | £ | 884 | 1.133 | 0,15 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **TP ICAP Finance PLC** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 18.11.2028 | £ | 700 | $ | 701 | 0,10 |
| | | | | 41.006 | 5,59 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | | |
| **Avon Finance PLC** | | | | | |
| 1,690 % fällig am 20.09.2048 | | 1.420 | | 1.716 | 0,23 |
| **Business Mortgage Finance PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.08.2040 | € | 2 | | 3 | 0,00 |
| **Canada Square Funding PLC** | | | | | |
| 1,550 % fällig am 17.10.2051 | £ | 1.032 | | 1.253 | 0,17 |
| 1,550 % fällig am 17.06.2058 | | 1.428 | | 1.701 | 0,23 |
| **Eurosail PLC** | | | | | |
| 2,540 % fällig am 13.06.2045 | | 660 | | 795 | 0,11 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | | |
| 1,775 % fällig am 16.12.2069 | | 802 | | 970 | 0,13 |
| **Genesis Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.09.2059 | | 3.100 | | 3.744 | 0,51 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,703 % fällig am 25.05.2053 | | 1.365 | | 1.654 | 0,23 |
| **Mansard Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,529 % fällig am 15.12.2049 | | 571 | | 679 | 0,09 |
| **Newgate Funding PLC** | | | | | |
| 0,319 % fällig am 15.12.2050 | € | 496 | | 509 | 0,07 |
| **Polaris PLC** | | | | | |
| 1,730 % fällig am 23.12.2058 | £ | 1.605 | | 1.922 | 0,26 |
| **Ripon Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,351 % fällig am 28.08.2056 | | 7.030 | | 8.453 | 1,15 |
| **RMAC PLC** | | | | | |
| 1,571 % fällig am 12.06.2046 | | 983 | | 1.187 | 0,16 |
| 1,841 % fällig am 12.06.2046 | | 1.133 | | 1.377 | 0,19 |
| **Stratton Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2060 | | 2.858 | | 3.444 | 0,47 |
| 1,652 % fällig am 12.03.2052 | | 1.446 | | 1.735 | 0,24 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2045 | | 3.072 | | 3.725 | 0,51 |
| 1,605 % fällig am 20.10.2051 | | 1.471 | | 1.781 | 0,24 |
| **Trinity Square PLC** | | | | | |
| 1,300 % fällig am 15.07.2059 | | 1.370 | | 1.653 | 0,23 |
| | | | | 38.301 | 5,22 |
| | | **AKTIEN** | | | |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | | | |
| **Nationwide Building Society** | | | | | |
| 10,250 % | | 2.470 | | 439 | 0,06 |
| | | **PARI (000S)** | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | | |
| 0,625 % fällig am 22.10.2050 | £ | 2.700 | | 2.000 | 0,27 |
| 1,500 % fällig am 31.07.2053 (k) | | 1.600 | | 1.506 | 0,21 |
| 1,750 % fällig am 22.01.2049 (k) | | 2.200 | | 2.233 | 0,30 |
| 3,250 % fällig am 22.01.2044 | | 1.700 | | 2.264 | 0,31 |
| 4,250 % fällig am 07.12.2040 (k) | | 1.700 | | 2.550 | 0,35 |
| | | | | 10.553 | 1,44 |
| Summe Großbritannien | | | | 90.307 | 12,31 |
| **USA** | | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **Amortizing Residential Collateral Trust** | | | | | |
| 2,324 % fällig am 25.10.2031 | $ | 2 | | 2 | 0,00 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | | |
| 2,324 % fällig am 25.06.2034 | | 99 | | 95 | 0,01 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | | |
| 2,239 % fällig am 25.02.2036 | | 2.895 | | 3.327 | 0,45 |
| 2,624 % fällig am 25.10.2037 | | 28 | | 28 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.12.2036 | | 1.862 | | 1.073 | 0,15 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | | |
| 2,304 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 11 | | 8 | 0,00 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.06.2037 | | 1.346 | | 1.239 | 0,17 |
| 1,764 % fällig am 25.07.2037 | | 396 | | 366 | 0,05 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | | |
| 2,244 % fällig am 25.01.2032 | $ | 2 | | 2 | 0,00 |
| **Home Equity Mortgage Trust** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 264 | | 247 | 0,03 |
| **IndyMac Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | | |
| 2,464 % fällig am 25.03.2035 | | 2.203 | | 2.118 | 0,29 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.05.2036 | | 1.176 | | 718 | 0,10 |
| **Massachusetts Educational Financing Authority** | | | | | |
| 2,134 % fällig am 25.04.2038 | | 120 | | 120 | 0,02 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.08.2036 | | 5.241 | | 2.090 | 0,29 |
| 1,864 % fällig am 25.10.2036 | | 2.075 | | 1.891 | 0,26 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.09.2037 | | 7 | | 4 | 0,00 |
| 1,864 % fällig am 25.02.2037 | | 3.169 | | 1.086 | 0,15 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | | |
| 1,724 % fällig am 25.11.2036 | | 1.197 | | 758 | 0,10 |
| 1,874 % fällig am 25.07.2036 | | 106 | | 90 | 0,01 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 3,677 % fällig am 20.06.2031 | | 289 | | 255 | 0,04 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.01.2037 | | 606 | | 419 | 0,06 |
| 1,764 % fällig am 25.02.2037 | | 2.208 | | 1.529 | 0,21 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | | |
| 2,284 % fällig am 25.11.2035 | | 119 | | 118 | 0,02 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | | |
| 1,744 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 14 | | 4 | 0,00 |
| **SLC Student Loan Trust** | | | | | |
| 2,399 % fällig am 25.11.2042 | | 621 | | 615 | 0,08 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | | |
| 2,029 % fällig am 25.12.2036 | | 3.000 | | 2.894 | 0,39 |
| 2,124 % fällig am 25.11.2036 | | 2.361 | | 2.226 | 0,30 |
| 2,329 % fällig am 25.11.2035 | | 376 | | 372 | 0,05 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,562 % fällig am 25.04.2035 | | 44 | | 43 | 0,01 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | | | |
| 1,969 % fällig am 25.01.2037 | | 2.537 | | 2.433 | 0,33 |
| | | | | 26.170 | 3,57 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **AbbVie, Inc.** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.11.2023 | € | 100 | | 104 | 0,01 |
| **American Tower Corp.** | | | | | |
| 2,950 % fällig am 15.01.2025 | $ | 1.400 | | 1.353 | 0,18 |
| 3,800 % fällig am 15.08.2029 | | 800 | | 735 | 0,10 |
| **AT&T, Inc.** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 02.03.2025 (f) | € | 500 | | 458 | 0,06 |
| **Bank of America Corp.** | | | | | |
| 1,949 % fällig am 27.10.2026 | | 1.000 | | 1.013 | 0,14 |
| 2,551 % fällig am 04.02.2028 | $ | 700 | | 637 | 0,09 |
| 2,972 % fällig am 04.02.2033 | | 700 | | 597 | 0,08 |
| 3,384 % fällig am 02.04.2026 | | 600 | | 582 | 0,08 |
| 4,376 % fällig am 27.04.2028 | | 400 | | 394 | 0,05 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** | | | | | |
| 2,839 % fällig am 15.12.2023 | | 900 | | 895 | 0,12 |
| 4,375 % fällig am 15.12.2028 | | 900 | | 877 | 0,12 |
| **Boeing Co.** | | | | | |
| 1,167 % fällig am 04.02.2023 | | 300 | | 297 | 0,04 |
| 1,433 % fällig am 04.02.2024 | | 1.300 | | 1.243 | 0,17 |
| 1,950 % fällig am 01.02.2024 | | 100 | | 97 | 0,01 |
| 2,750 % fällig am 01.02.2026 | | 2.100 | | 1.953 | 0,27 |
| 3,250 % fällig am 01.02.2028 | | 400 | | 358 | 0,05 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | | |
| 2,450 % fällig am 15.02.2031 | | 600 | | 483 | 0,07 |
| 2,600 % fällig am 15.02.2033 | | 300 | | 231 | 0,03 |
| 3,187 % fällig am 15.11.2036 | | 25 | | 19 | 0,00 |
| 4,150 % fällig am 15.11.2030 | | 202 | | 185 | 0,03 |
| 4,926 % fällig am 15.05.2037 | | 272 | | 244 | 0,03 |
| **Charles Schwab Corp.** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 18.03.2024 | | 300 | | 288 | 0,04 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.03.2042 | | 1.000 | | 695 | 0,10 |
| 5,125 % fällig am 01.07.2049 | | 700 | | 581 | 0,08 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | | |
| 3,290 % fällig am 17.03.2026 (j) | $ | 2.200 | | 2.130 | 0,29 |
| **Corebridge Financial, Inc.** | | | | | |
| 3,650 % fällig am 05.04.2027 | | 600 | | 565 | 0,08 |
| **Dell International LLC** | | | | | |
| 5,450 % fällig am 15.06.2023 | | 80 | | 81 | 0,01 |
| **Discover Bank** | | | | | |
| 3,350 % fällig am 06.02.2023 | | 500 | | 500 | 0,07 |
| **Doctors Co. An Interinsurance Exchange** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 18.01.2032 | | 200 | | 176 | 0,02 |
| **Equitable Holdings, Inc.** | | | | | |
| 3,900 % fällig am 20.04.2023 | | 65 | | 65 | 0,01 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | | |
| 0,092 % fällig am 07.12.2022 | € | 200 | | 208 | 0,03 |
| 2,748 % fällig am 14.06.2024 | £ | 600 | | 674 | 0,09 |
| 2,900 % fällig am 16.02.2028 | $ | 100 | | 81 | 0,01 |
| 3,375 % fällig am 13.11.2025 | | 800 | | 723 | 0,10 |
| 4,687 % fällig am 09.06.2025 | | 600 | | 568 | 0,08 |
| **GA Global Funding Trust** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 06.01.2027 | | 600 | | 537 | 0,07 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | | |
| 0,250 % fällig am 26.01.2028 | € | 1.000 | | 877 | 0,12 |
| 0,579 % fällig am 07.02.2025 | | 1.000 | | 1.041 | 0,14 |
| 1,250 % fällig am 07.02.2029 | | 1.100 | | 991 | 0,14 |
| 1,375 % fällig am 15.05.2024 | | 1.400 | | 1.454 | 0,20 |
| 3,000 % fällig am 15.03.2024 | $ | 1.000 | | 988 | 0,14 |
| **Hyatt Hotels Corp.** | | | | | |
| 1,300 % fällig am 01.10.2023 | | 500 | | 484 | 0,07 |
| **International Flavors & Fragrances, Inc.** | | | | | |
| 0,697 % fällig am 15.09.2022 | | 1.400 | | 1.393 | 0,19 |
| **JetBlue Pass-Through Trust** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.05.2034 | | 902 | | 841 | 0,11 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | | |
| 2,595 % fällig am 24.02.2026 | | 1.800 | | 1.713 | 0,23 |
| 4,323 % fällig am 26.04.2028 | | 1.100 | | 1.083 | 0,15 |
| **Kilroy Realty LP** | | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.12.2024 | | 200 | | 195 | 0,03 |
| **Lehman Brothers Holdings, Inc.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 16.11.2009 ^ | | 700 | | 3 | 0,00 |
| 5,625 % fällig am 24.01.2013 ^ | | 600 | | 3 | 0,00 |
| 6,200 % fällig am 26.09.2014 ^ | | 1.400 | | 6 | 0,00 |
| 7,875 % fällig am 08.05.2018 ^ | £ | 1.800 | | 14 | 0,00 |
| **Morgan Stanley** | | | | | |
| 2,630 % fällig am 18.02.2026 | $ | 1.300 | | 1.242 | 0,17 |
| 2,950 % fällig am 07.05.2032 | € | 700 | | 694 | 0,09 |
| **ONEOK, Inc.** | | | | | |
| 4,550 % fällig am 15.07.2028 | $ | 300 | | 290 | 0,04 |
| **Oracle Corp.** | | | | | |
| 2,300 % fällig am 25.03.2028 (j) | | 2.400 | | 2.067 | 0,28 |
| 2,875 % fällig am 25.03.2031 (j) | | 600 | | 495 | 0,07 |
| 3,950 % fällig am 25.03.2051 (j) | | 100 | | 74 | 0,01 |
| 4,100 % fällig am 25.03.2061 (j) | | 700 | | 497 | 0,07 |
| **Organon & Co.** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 30.04.2028 | | 400 | | 355 | 0,05 |
| 5,125 % fällig am 30.04.2031 | | 500 | | 433 | 0,06 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | | | |
| 2,100 % fällig am 01.08.2027 | | 100 | | 84 | 0,01 |
| 2,950 % fällig am 01.03.2026 ^ | | 100 | | 91 | 0,01 |
| 3,150 % fällig am 01.01.2026 | | 100 | | 92 | 0,01 |
| 3,450 % fällig am 01.07.2025 | | 100 | | 94 | 0,01 |
| 3,950 % fällig am 01.12.2047 ^ | | 100 | | 69 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 15.03.2046 ^ | | 300 | | 220 | 0,03 |
| 4,300 % fällig am 15.03.2045 ^ | | 100 | | 73 | 0,01 |
| 4,550 % fällig am 01.07.2030 | | 200 | | 178 | 0,02 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | | | |
| 3,950 % fällig am 10.03.2025 | | 1.500 | | 1.478 | 0,20 |
| **Santander Holdings USA, Inc.** | | | | | |
| 3,400 % fällig am 18.01.2023 | | 900 | | 899 | 0,12 |
| **Southern California Edison Co.** | | | | | |
| 0,700 % fällig am 03.04.2023 | | 500 | | 489 | 0,07 |
| 2,153 % fällig am 03.04.2023 | | 200 | | 200 | 0,03 |
| 2,343 % fällig am 01.04.2024 | | 500 | | 495 | 0,07 |
| **Southwest Airlines Co.** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 04.05.2025 | | 600 | | 612 | 0,08 |
| **Sprint Spectrum Co. LLC** | | | | | |
| 4,738 % fällig am 20.09.2029 | | 344 | | 344 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Walt Disney Co.** | | | |
| 3,500 % fällig am 13.05.2040 | $ 800 | $ 683 | 0,09 |
| 3,600 % fällig am 13.01.2051 | 900 | 753 | 0,10 |
| **WEA Finance LLC** | | | |
| 3,750 % fällig am 17.09.2024 | 600 | 579 | 0,08 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | |
| 3,526 % fällig am 24.03.2028 | 700 | 664 | 0,09 |
| 3,908 % fällig am 25.04.2026 | 800 | 788 | 0,11 |
| | | 46.745 | 6,37 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | |
| **CenturyLink, Inc.** | | | |
| 3,916 % fällig am 15.03.2027 (b) | 828 | 762 | 0,10 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021** | | | |
| 2,158 % fällig am 01.06.2026 | 900 | 838 | 0,11 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 2,925 % fällig am 25.09.2035 ^ | 15 | 14 | 0,00 |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | |
| 1,416 % fällig am 25.10.2046 | 928 | 691 | 0,09 |
| 1,814 % fällig am 25.05.2046 ^ | 217 | 182 | 0,03 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | |
| 1,932 % fällig am 20.02.2047 | 791 | 739 | 0,10 |
| 3,461 % fällig am 20.01.2047 ^ | 39 | 37 | 0,01 |
| 12,358 % fällig am 20.10.2046 ^ | 94 | 79 | 0,01 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 2,535 % fällig am 25.10.2033 | 8 | 8 | 0,00 |
| 2,846 % fällig am 25.05.2034 | 21 | 18 | 0,00 |
| 3,160 % fällig am 25.08.2033 | 5 | 5 | 0,00 |
| 3,278 % fällig am 25.05.2047 ^ | 149 | 140 | 0,02 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | |
| 2,890 % fällig am 25.11.2035 ^ | 133 | 110 | 0,02 |
| 2,954 % fällig am 25.11.2036 ^ | 399 | 225 | 0,03 |
| 3,074 % fällig am 25.09.2035 ^ | 267 | 177 | 0,02 |
| **Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust** | | | |
| 2,999 % fällig am 26.12.2046 ^ | 434 | 361 | 0,05 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | |
| 3,718 % fällig am 25.07.2037 | 45 | 40 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,396 % fällig am 25.09.2037 ^ | 260 | 237 | 0,03 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | |
| 3,790 % fällig am 25.09.2035 | 19 | 18 | 0,00 |
| 4,255 % fällig am 25.08.2035 ^ | 324 | 306 | 0,04 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,266 % fällig am 25.09.2035 ^ | 357 | 320 | 0,04 |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,224 % fällig am 25.02.2037 | 2.057 | 1.790 | 0,24 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | |
| 1,792 % fällig am 20.02.2047 ^ | 815 | 634 | 0,09 |
| 1,822 % fällig am 20.07.2046 ^ | 202 | 156 | 0,02 |
| 1,974 % fällig am 25.05.2037 ^ | 67 | 26 | 0,00 |
| 2,334 % fällig am 25.11.2035 | 64 | 57 | 0,01 |
| 2,526 % fällig am 20.10.2035 | 1.268 | 945 | 0,13 |
| 3,051 % fällig am 25.11.2035 | 25 | 23 | 0,00 |
| 3,163 % fällig am 25.02.2037 ^ | 134 | 125 | 0,02 |
| 3,164 % fällig am 25.11.2035 | 145 | 123 | 0,02 |
| 5,250 % fällig am 25.06.2035 ^ | 20 | 17 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 | 2.034 | 1.202 | 0,16 |
| 6,250 % fällig am 25.08.2037 ^ | 57 | 36 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.06.2036 ^ | 160 | 92 | 0,01 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 2,084 % fällig am 25.05.2035 | 23 | 19 | 0,00 |
| 2,264 % fällig am 25.03.2035 | 100 | 87 | 0,01 |
| 2,284 % fällig am 25.02.2035 | 59 | 55 | 0,01 |
| 2,384 % fällig am 25.09.2034 | 5 | 5 | 0,00 |
| 2,711 % fällig am 25.11.2034 | 5 | 5 | 0,00 |
| 3,571 % fällig am 25.08.2034 ^ | 1 | 1 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 | 983 | 573 | 0,08 |
| **Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust** | | | |
| 1,964 % fällig am 25.06.2035 | 126 | 124 | 0,02 |
| **Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,864 % fällig am 25.08.2036 ^ | 436 | 414 | 0,06 |
| **Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,724 % fällig am 25.10.2036 ^ | $ 4 | $ 4 | 0,00 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,132 % fällig am 19.08.2045 | 51 | 45 | 0,01 |
| 2,252 % fällig am 19.07.2045 ^ | 4 | 0 | 0,00 |
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 3,213 % fällig am 25.08.2035 | 14 | 10 | 0,00 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | |
| 2,164 % fällig am 25.11.2045 | 16 | 14 | 0,00 |
| **GS Mortgage Securities Trust** | | | |
| 2,039 % fällig am 10.11.2045 (a) | 1.814 | 1 | 0,00 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,880 % fällig am 25.03.2033 | 5 | 5 | 0,00 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,326 % fällig am 19.12.2036 ^ | 121 | 111 | 0,02 |
| 2,476 % fällig am 19.10.2035 | 402 | 249 | 0,03 |
| **Impac CMB Trust** | | | |
| 2,624 % fällig am 25.07.2033 | 1 | 1 | 0,00 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,864 % fällig am 25.03.2036 | 517 | 444 | 0,06 |
| 3,016 % fällig am 25.12.2034 | 9 | 9 | 0,00 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,104 % fällig am 25.10.2036 | 284 | 266 | 0,04 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2036 ^ | 2 | 1 | 0,00 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | |
| 2,203 % fällig am 25.11.2033 | 5 | 5 | 0,00 |
| 2,811 % fällig am 25.02.2036 ^ | 101 | 79 | 0,01 |
| 3,043 % fällig am 27.07.2037 | 191 | 179 | 0,03 |
| **MASTR Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,024 % fällig am 25.03.2036 ^ | 88 | 8 | 0,00 |
| **Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 1,764 % fällig am 15.12.2030 | 13 | 12 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust** | | | |
| 1,844 % fällig am 25.03.2037 | 6.254 | 1.953 | 0,27 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | |
| 1,572 % fällig am 25.11.2037 | 768 | 696 | 0,10 |
| 1,774 % fällig am 25.02.2047 | 169 | 71 | 0,01 |
| 1,924 % fällig am 25.06.2037 ^ | 329 | 313 | 0,04 |
| 1,944 % fällig am 25.03.2047 | 787 | 724 | 0,10 |
| 1,984 % fällig am 25.07.2036 ^ | 1.136 | 540 | 0,07 |
| 1,984 % fällig am 25.06.2046 | 796 | 202 | 0,03 |
| 2,424 % fällig am 25.10.2045 | 68 | 61 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 | 408 | 353 | 0,05 |
| **Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust** | | | |
| 3,027 % fällig am 25.09.2035 ^ | 39 | 28 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.03.2032 | 0 | 0 | 0,00 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | |
| 2,295 % fällig am 20.07.2033 | 21 | 20 | 0,00 |
| 2,978 % fällig am 20.07.2037 | 502 | 420 | 0,06 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,513 % fällig am 25.04.2034 | 19 | 19 | 0,00 |
| 2,543 % fällig am 25.02.2034 | 14 | 14 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | |
| 1,944 % fällig am 25.01.2037 | 1.215 | 1.094 | 0,15 |
| 2,004 % fällig am 25.07.2046 ^ | 355 | 276 | 0,04 |
| 2,044 % fällig am 25.05.2036 | 141 | 114 | 0,02 |
| 2,064 % fällig am 25.05.2036 | 681 | 582 | 0,08 |
| 2,175 % fällig am 19.07.2034 | 7 | 7 | 0,00 |
| 2,295 % fällig am 19.03.2034 | 3 | 3 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp.** | | | |
| 1,904 % fällig am 25.01.2036 | 174 | 168 | 0,02 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,914 % fällig am 25.10.2036 | 493 | 433 | 0,06 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | |
| 4,783 % fällig am 25.06.2047 ^ | 93 | 81 | 0,01 |
| **Wachovia Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,984 % fällig am 25.01.2037 | 1.585 | 730 | 0,10 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 1,473 % fällig am 27.02.2034 | 8 | 8 | 0,00 |
| 1,476 % fällig am 25.02.2046 | 212 | 193 | 0,03 |
| 2,244 % fällig am 25.01.2045 | 16 | 16 | 0,00 |
| 2,462 % fällig am 25.03.2034 | 2 | 2 | 0,00 |
| 2,831 % fällig am 25.09.2036 | 151 | 131 | 0,02 |
| 3,201 % fällig am 25.05.2037 ^ | 407 | 379 | 0,05 |
| 3,222 % fällig am 25.06.2037 ^ | 110 | 101 | 0,01 |
| 3,325 % fällig am 25.02.2037 ^ | 720 | 685 | 0,09 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 1,416 % fällig am 25.07.2046 ^ | $ 82 | $ 53 | 0,01 |
| | | 22.129 | 3,02 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae** | | | |
| 1,067 % fällig am 25.03.2036 | 3 | 3 | 0,00 |
| 1,465 % fällig am 01.10.2034 | 1 | 1 | 0,00 |
| 1,524 % fällig am 01.09.2044 | 46 | 47 | 0,01 |
| 1,628 % fällig am 01.12.2034 | 11 | 12 | 0,00 |
| 1,744 % fällig am 25.03.2034 | 4 | 4 | 0,00 |
| 1,774 % fällig am 25.08.2034 | 7 | 7 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.06.2036 | 22 | 22 | 0,00 |
| 2,124 % fällig am 25.10.2040 | 44 | 44 | 0,01 |
| 2,430 % fällig am 01.11.2034 | 53 | 55 | 0,01 |
| 2,944 % fällig am 25.07.2039 | 575 | 549 | 0,07 |
| 3,000 % fällig am 01.03.2060 | 935 | 878 | 0,12 |
| 3,500 % fällig am 01.01.2059 | 1.976 | 1.920 | 0,26 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2043 - 25.07.2044 | 96 | 102 | 0,01 |
| 7,000 % fällig am 01.08.2037 | 31 | 31 | 0,00 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 1,150 % fällig am 15.01.2038 | 360 | 358 | 0,05 |
| 1,295 % fällig am 15.01.2038 (a) | 360 | 20 | 0,00 |
| 1,524 % fällig am 25.02.2045 | 54 | 55 | 0,01 |
| 1,676 % fällig am 25.10.2044 | 145 | 149 | 0,02 |
| 1,924 % fällig am 15.12.2037 - 15.07.2040 | 157 | 158 | 0,02 |
| 2,021 % fällig am 01.09.2035 | 2 | 2 | 0,00 |
| 2,624 % fällig am 25.05.2043 | 21 | 21 | 0,00 |
| **Ginnie Mae** | | | |
| 1,750 % fällig am 20.11.2022 | 0 | 0 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 20.07.2046 - 20.05.2047 | 29 | 29 | 0,00 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.02.2052 | 4.756 | 4.148 | 0,57 |
| 2,500 % fällig am 01.02.2051 - 01.01.2052 | 2.925 | 2.637 | 0,36 |
| 3,000 % fällig am 01.04.2043 - 01.06.2051 | 3.100 | 2.897 | 0,40 |
| 3,500 % fällig am 01.10.2034 - 01.07.2050 | 1.672 | 1.635 | 0,22 |
| 4,000 % fällig am 01.06.2050 | 782 | 776 | 0,11 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.07.2052 | 4.000 | 3.727 | 0,51 |
| 3,500 % fällig am 01.07.2037 - 01.08.2052 | 55.500 | 53.336 | 7,27 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2052 | 32.600 | 32.101 | 4,38 |
| | | 105.724 | 14,41 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | |
| 1,625 % fällig am 15.11.2050 | 600 | 422 | 0,06 |
| 2,875 % fällig am 15.05.2052 | 2.600 | 2.457 | 0,33 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)** | | | |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028 | 6.211 | 6.172 | 0,84 |
| 1,750 % fällig am 15.01.2028 | 552 | 586 | 0,08 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2027 | 717 | 778 | 0,11 |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 | 4.847 | 5.391 | 0,74 |
| 3,875 % fällig am 15.04.2029 | 1.582 | 1.912 | 0,26 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.12.2023 | 300 | 288 | 0,04 |
| | | 18.006 | 2,46 |
| Summe USA | | 220.374 | 30,04 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | |
| 51,049 % fällig am 30.09.2022 (c)(d) | ARS 8.700 | 29 | 0,00 |
| **ISRAEL TREASURY BILLS** | | | |
| (0,050) % fällig am 07.10.2022 (c)(d) | ILS 300 | 86 | 0,01 |
| 0,000 % fällig am 07.12.2022 (c)(d) | 700 | 199 | 0,03 |
| 0,010 % fällig am 04.01.2023 (c)(d) | 3.800 | 1.080 | 0,15 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 0,020 % fällig am 07.12.2022 (c)(d) | ILS | 6.600 | $ 1.880 | 0,25 |
| 0,022 % fällig am 04.01.2023 (c)(d) | | 7.200 | 2.046 | 0,28 |
| 1,184 % fällig am 02.03.2023 (c)(d) | | 25.600 | 7.247 | 0,99 |
| | | | 12.538 | 1,71 |
| **JAPAN TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,150) % fällig am 20.09.2022 (c)(d) | ¥ | 740.800 | 5.455 | 0,75 |
| (0,136) % fällig am 20.09.2022 (c)(d) | | 309.200 | 2.277 | 0,31 |
| (0,120) % fällig am 12.09.2022 (c)(d) | ¥ | 291.000 | $ 2.142 | 0,29 |
| | | | 9.874 | 1,35 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 22.441 | 3,06 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **$ 770.957** | **105,09** |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **AKTIEN** | | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)** | 3.861.091 | 38.410 | 5,23 |
| **PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (g)** | 402.852 | $ 5.479 | 0,75 |
| | | 43.889 | 5,98 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (g)** | 4.450 | 452 | 0,06 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$ 44.341** | **6,04** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 494 | U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | $ (504) | $ 494 | $ 494 | 0,07 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (504)** | **$ 494** | **$ 494** | **0,07** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month SOFR June Futures | Long | 09.2023 | 71 | $ (110) | (0,01) |
| Australia Government 3-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 56 | (3) | 0,00 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 133 | (41) | (0,01) |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 130 | 430 | 0,06 |
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09.2022 | 372 | 776 | 0,11 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Long | 09.2022 | 67 | (194) | (0,03) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 100 | 449 | 0,06 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 15 | (213) | (0,03) |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 245 | 1.076 | 0,15 |
| Euro-Schatz September Futures | Long | 09.2022 | 236 | (86) | (0,01) |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 14 | 115 | 0,02 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 420 | 108 | 0,02 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 430 | 250 | 0,03 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 148 | (128) | (0,02) |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2022 | 339 | (189) | (0,03) |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2022 | 6 | 27 | 0,00 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09.2022 | 57 | 284 | 0,04 |
| | | | | $ 2.551 | 0,35 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CME Kaufoptionen mit Ausübungskurs von @ USD 98,000 auf 3-Month SOFR December Futures | $ 98,000 | 15.12.2023 | 13 | $ (11) | $ (11) | 0,00 |
| Call - CME Verkaufoptionen mit Ausübungskurs von @ USD 96,500 auf 3-Month SOFR December Futures | 96,500 | 15.12.2023 | 13 | (12) | (16) | (0,01) |
| | | | | $ (23) | $ (27) | (0,01) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ 2.524** | **0,34** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| British Telecommunications PLC | 1,000 % | 20.06.2028 | € 700 | $ (23) | 0,00 |
| Enbridge, Inc. | 1,000 | 20.12.2022 | $ 300 | (2) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.12.2024 | 100 | (3) | 0,00 |
| General Motors Co. | 5,000 | 20.12.2026 | 500 | (52) | (0,01) |
| Jaguar Land Rover Automotive PLC | 5,000 | 20.06.2026 | € 500 | (105) | (0,01) |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.06.2024 | 900 | 21 | 0,00 |
| Shell International Finance BV | 1,000 | 20.12.2026 | 900 | (15) | 0,00 |
| Stellantis NV | 5,000 | 20.12.2026 | 500 | (46) | (0,01) |
| Tesco PLC | 1,000 | 20.06.2025 | 1.500 | (34) | (0,01) |
| | | | | $ (259) | (0,04) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[2]

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-34 5-Year Index | (5,000) % | 20.06.2025 | $ 91 | $ 8 | 0,00 |
| CDX.HY-35 5-Year Index | (5,000) | 20.12.2025 | 1.881 | 183 | 0,03 |
| CDX.HY-36 5-Year Index | (5,000) | 20.06.2026 | 3.663 | 372 | 0,05 |
| CDX.IG-33 10-Year Index | (1,000) | 20.12.2029 | 9.400 | 235 | 0,03 |
| CDX.IG-35 10-Year Index | (1,000) | 20.12.2030 | 18.500 | 428 | 0,06 |
| CDX.IG-37 10-Year Index | (1,000) | 20.12.2031 | 16.500 | 364 | 0,05 |
| CDX.IG-38 10-Year Index | (1,000) | 20.06.2032 | 40.200 | 505 | 0,07 |
| | | | | $ 2.095 | 0,29 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-38 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2027 | $ 30.400 | $ (432) | (0,06) |
| iTraxx Crossover 37 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2027 | € 4.800 | (286) | (0,04) |
| iTraxx Europe Main 36 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 2.000 | (14) | 0,00 |
| iTraxx Europe Main 37 10-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 2.600 | (34) | (0,01) |
| | | | | $ (766) | (0,11) |

## ZINSSWAPS - BASISSWAPS

| Zahlung variabler Zinssatzindex | Erhalt variabler Zinssatzindex | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month USD-LIBOR | 1-Month USD-LIBOR + 0,070 % | 07.03.2024 | $ 7.400 | $ (1) | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR[4] | 1-Month USD-LIBOR + 0,102 % | 04.10.2024 | 15.000 | 8 | 0,00 |
| | | | | $ 7 | 0,00 |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,010 % | 07.02.2023 | £ 34.350 | $ (613) | (0,08) |
| Zahlung[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 | 21.09.2024 | 2.800 | (36) | (0,01) |
| Zahlung[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 | 21.09.2027 | 7.100 | (247) | (0,03) |
| Zahlung[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2032 | 11.600 | (301) | (0,04) |
| Zahlung[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2052 | 3.700 | (5) | 0,00 |
| Zahlung[4] | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 5,750 | 15.03.2024 | INR 5.611.800 | 126 | 0,02 |
| Erhalt | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 5,750 | 16.03.2027 | 1.198.700 | (207) | (0,03) |
| Erhalt | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 6,250 | 16.03.2032 | 116.100 | (38) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 15.12.2023 | ¥ 2.430.000 | (42) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 15.12.2026 | 1.340.000 | (89) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 15.12.2028 | 10.000 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 17.03.2031 | 610.000 | (135) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,050 | 15.12.2031 | 1.101.000 | (61) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,400 | 19.06.2039 | 540.000 | 333 | 0,05 |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,400 | 15.12.2051 | 80.000 | (83) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,450 | 15.12.2051 | 200.000 | (61) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 1,250 | 16.03.2024 | SGD 45.460 | 247 | 0,03 |
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 1,250 | 15.09.2031 | 300 | (5) | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 1,250 | 15.09.2031 | 200 | 19 | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 2,250 | 15.06.2032 | 750 | (14) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 2,500 | 15.06.2032 | 1.700 | (26) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 2,750 | 15.06.2027 | 6.400 | 13 | 0,00 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 3,000 % | 15.06.2027 | SGD | 8.300 | $ 79 | 0,01 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 0,500 | 15.06.2024 | $ | 7.100 | (238) | (0,03) |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 | 15.06.2027 | | 16.900 | 769 | 0,10 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 | 15.06.2029 | | 37.300 | (1.736) | (0,24) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,250 | 15.12.2028 | | 5.600 | (495) | (0,07) |
| Erhalt(4) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,320 | 21.12.2023 | | 249.900 | 3.908 | 0,53 |
| Zahlung(4) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,430 | 31.03.2024 | | 100 | (3) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,500 | 15.06.2052 | | 2.100 | (437) | (0,06) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,618 | 09.02.2029 | | 2.700 | (169) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,695 | 15.11.2031 | | 16.600 | (1.461) | (0,20) |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2027 | | 73.700 | 267 | 0,04 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2032 | | 13.700 | (116) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2052 | | 9.200 | (46) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,817 | 05.04.2032 | | 3.400 | (256) | (0,03) |
| Erhalt(4) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,850 | 21.04.2024 | | 59.400 | 69 | 0,01 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,888 | 22.03.2029 | | 4.300 | (206) | (0,03) |
| Erhalt(4) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,117 | 31.03.2024 | | 17.600 | 272 | 0,04 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,175 | 21.04.2029 | | 4.000 | (126) | (0,02) |
| Erhalt(4) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,209 | 31.03.2024 | | 14.000 | 195 | 0,03 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,370 | 21.06.2027 | | 5.700 | (85) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,400 | 21.06.2024 | | 16.800 | (159) | (0,02) |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,703 | 22.06.2052 | | 1.400 | (17) | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,792 | 23.06.2052 | | 900 | (27) | 0,00 |
| Zahlung(4) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,886 | 15.05.2032 | | 39.000 | 418 | 0,06 |
| Zahlung(4) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,965 | 30.06.2024 | | 15.900 | (43) | (0,01) |
| Erhalt(4) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,965 | 30.11.2026 | | 53.700 | (308) | (0,04) |
| Zahlung(4) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,968 | 30.06.2024 | | 22.600 | (60) | (0,01) |
| Zahlung(4) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,004 | 30.06.2024 | | 10.100 | (21) | 0,00 |
| Zahlung(4) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,005 | 15.05.2032 | | 3.600 | 58 | 0,01 |
| Zahlung(4) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,026 | 30.06.2024 | | 17.400 | (30) | 0,00 |
| Erhalt(4) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,059 | 30.11.2026 | | 8.000 | (69) | (0,01) |
| Zahlung(4) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,486 | 30.06.2024 | | 8.300 | 50 | 0,01 |
| Zahlung(4) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,527 | 30.06.2024 | | 7.900 | 53 | 0,01 |
| Zahlung(4) | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,531 | 30.06.2024 | | 7.200 | 49 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,220 | 03.03.2025 | CAD | 6.900 | (327) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,250 | 16.06.2031 | | 5.500 | (180) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,500 | 17.06.2025 | | 9.600 | (433) | (0,06) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,500 | 17.06.2030 | | 9.200 | (850) | (0,12) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,500 | 16.06.2051 | | 250 | (37) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,585 | 19.07.2031 | | 7.100 | (663) | (0,09) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,713 | 02.10.2029 | | 2.100 | (177) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,900 | 18.12.2029 | | 24.500 | (2.186) | (0,30) |
| Zahlung(4) | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,000 | 14.11.2023 | | 11.300 | (144) | (0,02) |
| Zahlung(4) | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,060 | 28.10.2023 | | 24.600 | (303) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,283 | 14.02.2027 | CHF | 900 | (33) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,294 | 10.02.2027 | | 8.500 | (282) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,295 | 17.02.2027 | | 1.800 | (64) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,300 | 15.02.2027 | | 3.000 | (106) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,343 | 16.05.2027 | | 1.900 | (74) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,368 | 15.06.2027 | | 12.100 | (455) | (0,06) |
| Zahlung | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,500 | 15.09.2026 | | 23.700 | (1.555) | (0,21) |
| Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,500 | 16.03.2027 | CNY | 61.000 | (57) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 3,000 | 15.06.2032 | KRW | 2.883.300 | (59) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 3,250 | 15.06.2032 | | 885.300 | (5) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month NZD-BBR | 0,528 | 17.03.2024 | NZD | 650 | (20) | 0,00 |
| Zahlung(4) | 3-Month NZD-BBR | 3,000 | 01.11.2023 | | 22.600 | (178) | (0,02) |
| Zahlung(4) | 3-Month NZD-BBR | 3,000 | 15.12.2023 | | 24.900 | (192) | (0,03) |
| Zahlung | 3-Month NZD-BBR | 3,750 | 15.06.2027 | | 9.400 | 32 | 0,00 |
| Zahlung(4) | 3-Month NZD-BBR | 4,000 | 14.06.2024 | | 32.500 | 12 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month SEK-STIBOR | 0,500 | 19.06.2024 | SEK | 56.200 | (282) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,250 | 16.06.2023 | $ | 14.200 | 408 | 0,06 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,400 | 30.03.2026 | | 2.600 | 186 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,400 | 15.01.2028 | | 24.600 | (2.029) | (0,28) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,750 | 30.03.2031 | | 7.055 | 685 | 0,09 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,750 | 16.06.2031 | | 24.010 | 2.468 | 0,34 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,249 | 31.08.2024 | | 11.650 | 687 | 0,09 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 15.12.2026 | | 32.600 | 2.852 | 0,39 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 15.12.2026 | | 35.400 | 3.080 | 0,42 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 09.06.2041 | | 200 | 29 | 0,00 |
| Erhalt(4) | 3-Month USD-LIBOR | 1,270 | 04.11.2023 | | 93.600 | 1.119 | 0,15 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,298 | 25.08.2024 | | 10.200 | 606 | 0,08 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,305 | 21.08.2023 | | 12.550 | 517 | 0,07 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 15.12.2028 | | 19.300 | (2.025) | (0,28) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,518 | 20.01.2029 | | 1.500 | (127) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,630 | 20.01.2029 | | 4.400 | (340) | (0,05) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,250 | 20.06.2023 | ZAR | 16.700 | (57) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 1,250 | 17.06.2030 | AUD | 5.100 | 565 | 0,08 |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 1,750 | 16.03.2027 | | 6.600 | (383) | (0,05) |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,913 | 30.01.2029 | CZK | 24.300 | (201) | (0,03) |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 17.03.2036 | € | 1.400 | 302 | 0,04 |
| Erhalt(4) | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,054 | 27.05.2050 | | 450 | 93 | 0,01 |
| Erhalt(4) | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,064 | 17.11.2052 | | 1.000 | 265 | 0,04 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 % | 21.09.2027 | € | 65.800 | $ (2.977) | (0,41) |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | | 95.450 | (6.775) | (0,92) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 15.09.2036 | | 2.300 | (610) | (0,08) |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,450 | 15.12.2035 | | 1.300 | 308 | 0,04 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2024 | | 62.200 | (502) | (0,07) |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2052 | | 9.100 | 1.972 | 0,27 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 12.04.2027 | | 2.400 | (110) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 11.05.2027 | | 1.800 | (83) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,700 | 11.04.2027 | | 1.400 | (62) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 13.05.2027 | | 2.200 | (71) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.05.2027 | | 1.300 | (42) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 1,500 | 20.03.2024 | HUF | 342.600 | (116) | (0,02) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 4,870 | 07.07.2025 | MXN | 86.100 | (285) | (0,04) |
| Zahlung | UKRPI | 3,700 | 15.04.2031 | £ | 3.100 | (470) | (0,06) |
| Zahlung | UKRPI | 3,740 | 15.03.2031 | | 1.800 | (278) | (0,04) |
| | | | | | | $ (11.166) | (1,52) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | | **$ (10.089)** | **(1,38)** |

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

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

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

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

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

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

### OPTIONSKAUF

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,180 % | 11.01.2024 | 3.600 | $ 103 | $ 260 | 0,03 |

#### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Put - OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052 | € 97,000 | 23.05.2025 | 1.600 | $ 121 | $ 555 | 0,08 |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 % | 20.07.2022 | 2.400 | $ (11) | $ (5) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 3.700 | (10) | (12) | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 3.100 | (6) | (1) | 0,00 |
| BRC | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 3.000 | (14) | (6) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 1.400 | (3) | (2) | 0,00 |
| GST | Call - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Kauf | 0,700 | 17.08.2022 | 800 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,300 | 17.08.2022 | 2.300 | (5) | (4) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 95,000 | 17.08.2022 | 400 | (5) | (6) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,100 | 20.07.2022 | 2.300 | (9) | (9) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 3.500 | (11) | (13) | (0,01) |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,250 | 20.07.2022 | 1.400 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,350 | 17.08.2022 | 1.500 | (3) | (2) | 0,00 |
| | | | | | | $ (80) | $ (61) | (0,01) |

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,150 % | 01.12.2023 | 1.900 | $ (6) | $ (7) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,650 | 01.12.2023 | 1.900 | (6) | (6) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,310 | 11.01.2024 | 31.500 | (102) | (264) | (0,04) |

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,310 % | 19.08.2022 | 3.800 | $ (32) | $ (10) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,010 | 19.08.2022 | 3.800 | (33) | (36) | (0,01) |
| BPS | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 11.04.2023 | 3.300 | (3) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 11.04.2023 | 3.300 | (10) | (12) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 28.04.2023 | 2.100 | (4) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 28.04.2023 | 2.100 | (4) | (7) | 0,00 |
| | Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,451 | 23.05.2025 | 1.600 | (121) | (553) | (0,08) |
| CBK | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 01.09.2022 | 4.900 | (41) | (29) | (0,01) |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 01.09.2022 | 4.900 | (41) | (49) | (0,01) |
| DUB | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,920 | 13.10.2023 | 1.100 | (7) | (8) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,920 | 13.10.2023 | 1.100 | (7) | (6) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,790 | 08.04.2024 | 2.800 | (22) | (22) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,790 | 08.04.2024 | 2.800 | (22) | (17) | 0,00 |
| | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,350 | 08.08.2022 | 900 | (3) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,550 | 08.08.2022 | 900 | (3) | (18) | 0,00 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 02.09.2022 | 4.100 | (21) | (18) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 02.09.2022 | 4.100 | (21) | (29) | (0,01) |
| GLM | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,870 | 02.11.2022 | 93.600 | (186) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,270 | 02.11.2022 | 93.600 | (186) | (2.145) | (0,29) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,920 | 13.10.2023 | 800 | (5) | (6) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,920 | 13.10.2023 | 800 | (5) | (4) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,018 | 20.10.2023 | 800 | (5) | (6) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,018 | 20.10.2023 | 800 | (5) | (4) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,140 | 23.10.2023 | 900 | (6) | (7) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,140 | 23.10.2023 | 900 | (6) | (4) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,190 | 23.10.2023 | 800 | (6) | (7) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,190 | 23.10.2023 | 800 | (6) | (4) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,225 | 23.10.2023 | 900 | (6) | (8) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,225 | 23.10.2023 | 900 | (6) | (4) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,973 | 25.10.2023 | 1.100 | (8) | (8) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,973 | 25.10.2023 | 1.100 | (8) | (6) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,841 | 27.10.2023 | 800 | (5) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,841 | 27.10.2023 | 800 | (5) | (5) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,088 | 03.11.2023 | 500 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,088 | 03.11.2023 | 500 | (4) | (2) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,910 | 10.11.2023 | 1.700 | (11) | (12) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,910 | 10.11.2023 | 1.700 | (11) | (10) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 17.11.2023 | 3.000 | (11) | (13) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 17.11.2023 | 3.000 | (11) | (9) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,150 | 20.11.2023 | 1.500 | (5) | (6) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,650 | 20.11.2023 | 1.500 | (5) | (5) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 07.12.2023 | 1.400 | (4) | (6) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 07.12.2023 | 1.400 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,697 | 02.04.2024 | 3.400 | (27) | (24) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,697 | 02.04.2024 | 3.400 | (27) | (22) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,721 | 08.04.2024 | 900 | (7) | (7) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,721 | 08.04.2024 | 900 | (7) | (6) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 05.04.2023 | 6.500 | (12) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 05.04.2023 | 6.500 | (12) | (24) | (0,01) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 11.04.2023 | 11.400 | (22) | (7) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 11.04.2023 | 11.400 | (22) | (43) | (0,01) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 24.04.2023 | 1.600 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 24.04.2023 | 1.600 | (4) | (5) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 26.04.2023 | 2.200 | (4) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 26.04.2023 | 2.200 | (4) | (7) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 15.05.2023 | 4.000 | (7) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 15.05.2023 | 4.000 | (7) | (16) | 0,00 |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,370 | 18.08.2022 | 2.100 | (14) | (7) | 0,00 |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,070 | 18.08.2022 | 2.100 | (14) | (13) | 0,00 |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 06.09.2022 | 500 | (3) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 06.09.2022 | 500 | (3) | (4) | 0,00 |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 | 07.09.2022 | 2.100 | (13) | (14) | 0,00 |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,100 | 07.09.2022 | 2.100 | (13) | (16) | 0,00 |
| JPM | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 0,820 | 16.12.2024 | 8.700 | (61) | (25) | (0,01) |
| MYC | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,993 | 11.10.2023 | 700 | (5) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,993 | 11.10.2023 | 700 | (5) | (4) | 0,00 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,150 | 12.07.2022 | 4.100 | (32) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | $ (1.360) | $ (3.651) | (0,50) |

## ZINSCAPS

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYC | Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor | 1-Year USD-LIBOR | 0,000 % | 07.10.2022 | 16.750 | $ (17) | $ 0 | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor | 1-Year USD-LIBOR | 0,000 | 08.10.2022 | 9.000 | (9) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (26) | $ 0 | 0,00 |

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MSC | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 2.500 % fällig am 01.09.2052 - | $ 91,359 | 07.09.2022 | 500 | $ (3) | $ (3) | 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 | South Korea Government International Bond | (1,000) % | 20.06.2023 | $ 3.100 | $ (76) | $ 47 | $ (29) | (0,01) |
| BRC | China Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 1.600 | (31) | 16 | (15) | 0,00 |
| | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 4.400 | (111) | 69 | (42) | (0,01) |
| GST | China Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 2.900 | (56) | 28 | (28) | 0,00 |
| HUS | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 1.500 | (38) | 24 | (14) | 0,00 |
| JPM | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 2.100 | (50) | 30 | (20) | 0,00 |
| | | | | | $ (362) | $ 214 | $ (148) | (0,02) |

## 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | Italy Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2025 | $ 1.500 | $ (37) | $ 46 | $ 9 | 0,00 |
| CBK | Italy Government International Bond | 1,000 | 20.06.2025 | 1.000 | (24) | 30 | 6 | 0,00 |
| | | | | | $ (61) | $ 76 | $ 15 | 0,00 |

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

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

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

## CROSS-CURRENCY SWAPS

| Kontrahent | Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,290 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 04.01.2031 | AUD 5.900 | $ 4.445 | $ 29 | $ (19) | $ 10 | 0,00 |
| CBK | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,420 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 31.07.2029 | 7.100 | 4.899 | (2) | 2 | 0 | 0,00 |
| GLM | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,423 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 01.08.2029 | 7.000 | 4.830 | (14) | 3 | (11) | 0,00 |
| MYC | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,298 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 14.10.2030 | 2.000 | 1.437 | 9 | (7) | 2 | 0,00 |
| | | | | | | $ 22 | $ (21) | $ 1 | 0,00 |

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Erhalt | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,250 % | 16.03.2032 | MYR 29.900 | $ 95 | $ 373 | $ 468 | 0,07 |
| | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 4,000 | 15.06.2027 | 1.300 | (4) | 6 | 2 | 0,00 |
| | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 4,250 | 15.06.2027 | 10.100 | 26 | 20 | 46 | 0,01 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,000 | 16.03.2032 | THB 31.900 | 5 | (74) | (69) | (0,01) |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,000 | 15.06.2032 | 30.200 | (3) | (66) | (69) | (0,01) |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,250 | 15.06.2032 | 800 | 0 | 1 | 1 | 0,00 |
| BPS | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,000 | 15.06.2032 | 2.700 | (1) | (5) | (6) | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,250 | 15.06.2032 | 18.500 | 3 | 14 | 17 | 0,00 |
| CBK | Erhalt | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,500 | 16.03.2032 | MYR 2.800 | 1 | 29 | 30 | 0,01 |
| GLM | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 4,000 | 15.06.2027 | 10.000 | (22) | 40 | 18 | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,000 | 15.06.2032 | THB 18.800 | (1) | (42) | (43) | (0,01) |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,250 | 15.06.2032 | 4.500 | 1 | 3 | 4 | 0,00 |
| JPM | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,000 | 15.06.2032 | 42.900 | (5) | (94) | (99) | (0,01) |
| MBC | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,000 | 15.06.2032 | 23.900 | (6) | (49) | (55) | (0,01) |
| SCX | Erhalt | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,500 | 16.03.2032 | MYR 2.300 | (7) | 31 | 24 | 0,00 |
| | | | | | | $ 82 | $ 187 | $ 269 | 0,04 |

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nenn-betrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 10.900 | 20.09.2022 | $ 3 | $ 1.817 | $ 1.820 | 0,24 |
| GST | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 1,044 % | 9.900 | 20.12.2022 | 11 | 25 | 36 | 0,01 |
| MYC | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 1,044 | 1.900 | 20.09.2022 | 0 | 140 | 140 | 0,02 |
| | | | | | | | $ 14 | $ 1.982 | $ 1.996 | 0,27 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | CAD | 443 | $ | 352 | $ 8 | $ 0 | $ 8 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 2.784 | | 2.914 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 49.051 | | 62.019 | 2.449 | 0 | 2.449 | 0,33 |
| | 07.2022 | $ | 305 | AUD | 440 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 23.175 | DKK | 162.988 | 0 | (262) | (262) | (0,04) |
| | 07.2022 | | 1.115 | € | 1.054 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 774 | £ | 617 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.207 | PEN | 8.427 | 38 | (30) | 8 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 539 | ZAR | 8.276 | 0 | (35) | (35) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 440 | $ | 305 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 156.385 | | 22.289 | 264 | 0 | 264 | 0,04 |
| | 08.2022 | PEN | 849 | | 230 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 16 | IDR | 242.063 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 12.2022 | PEN | 8.248 | $ | 2.159 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| | 01.2023 | | 5.948 | | 1.566 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| | 05.2023 | CNH | 14.174 | | 2.191 | 73 | 0 | 73 | 0,01 |
| BPS | 07.2022 | BRL | 10.071 | | 1.970 | 45 | 0 | 45 | 0,01 |
| | 07.2022 | CAD | 1.050 | | 821 | 9 | (2) | 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | CHF | 784 | | 805 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 07.2022 | CZK | 699 | | 29 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK | 5.195 | | 739 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 6.360 | | 6.716 | 67 | 0 | 67 | 0,01 |
| | 07.2022 | £ | 949 | | 1.160 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 07.2022 | HUF | 9.948 | | 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 2.725 | | 136 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | NZD | 270 | | 169 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 806 | CAD | 1.045 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.454 | CHF | 2.362 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 3.991 | DKK | 27.950 | 3 | (64) | (61) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 142.687 | € | 135.624 | 0 | (899) | (899) | (0,12) |
| | 07.2022 | | 1.128 | £ | 895 | 0 | (41) | (41) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 28.992 | ¥ | 3.912.900 | 5 | (195) | (190) | (0,03) |
| | 07.2022 | | 171 | MXN | 3.576 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 131.379 | $ | 138.436 | 832 | 0 | 832 | 0,11 |
| | 08.2022 | $ | 1.714 | BRL | 8.907 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 491 | PEN | 1.882 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 60 | THB | 2.096 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 134 | MXN | 2.725 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10.2022 | € | 5.423 | $ | 5.755 | 38 | 0 | 38 | 0,01 |
| | 03.2023 | CNH | 12.279 | | 1.902 | 68 | 0 | 68 | 0,01 |
| BRC | 07.2022 | NOK | 65.596 | | 6.691 | 52 | 0 | 52 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 40.706 | ¥ | 5.521.802 | 0 | (61) | (61) | (0,01) |
| | 08.2022 | ¥ | 5.512.834 | $ | 40.706 | 60 | 0 | 60 | 0,01 |
| | 08.2022 | SGD | 2.759 | | 1.998 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 6.691 | NOK | 65.567 | 0 | (51) | (51) | (0,01) |
| | 09.2022 | ¥ | 232.000 | $ | 1.728 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 2.311 | MYR | 10.156 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | MXN | 5.328 | $ | 263 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | NZD | 254 | | 158 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | PEN | 5.948 | | 1.500 | 0 | (64) | (64) | (0,01) |
| | 07.2022 | $ | 1.433 | € | 1.335 | 0 | (38) | (38) | (0,01) |
| | 08.2022 | ILS | 6.492 | $ | 1.964 | 108 | 0 | 108 | 0,02 |
| | 08.2022 | PEN | 5.037 | | 1.331 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 449 | CLP | 395.540 | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 249 | PEN | 915 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 10.2022 | ILS | 300 | $ | 96 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 10.2022 | PEN | 8.535 | | 2.159 | 0 | (63) | (63) | (0,01) |
| | 11.2022 | | 7.254 | | 1.827 | 0 | (59) | (59) | (0,01) |
| | 12.2022 | ILS | 6.599 | | 2.085 | 180 | 0 | 180 | 0,03 |
| | 12.2022 | PEN | 9.149 | | 2.359 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 12.2022 | $ | 354 | PEN | 1.487 | 32 | 0 | 32 | 0,01 |
| | 01.2023 | ILS | 10.998 | $ | 3.481 | 298 | 0 | 298 | 0,04 |
| | 03.2023 | | 25.388 | | 7.487 | 113 | 0 | 113 | 0,02 |
| | 05.2023 | CNH | 1.559 | | 241 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | DKK | 52.872 | | 7.829 | 397 | 0 | 397 | 0,05 |
| | 07.2022 | $ | 2.505 | DKK | 17.675 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 45 | PLN | 194 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08.2022 | THB | 52.562 | $ | 1.514 | $ 25 | $ 0 | $ 25 | 0,00 |
| | 12.2022 | ILS | 700 | | 221 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 12.2022 | $ | 727 | ZAR | 11.427 | 0 | (41) | (41) | (0,01) |
| GLM | 07.2022 | | 1.999 | BRL | 10.071 | 0 | (73) | (73) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 392 | CLP | 325.775 | 0 | (45) | (45) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 863 | MXN | 17.621 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 2 | THB | 55 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 557 | MYR | 2.435 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 10.2022 | | 87 | MXN | 1.781 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03.2023 | CNH | 6.354 | $ | 984 | 35 | 0 | 35 | 0,01 |
| IND | 05.2023 | | 22.540 | | 3.485 | 117 | 0 | 117 | 0,02 |
| JPM | 07.2022 | CZK | 1.493 | | 64 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 37.426 | | 1.840 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 68 | AUD | 99 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 440 | DKK | 3.125 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 99 | $ | 68 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 33.040 | | 4.911 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 37.691.290 | | 2.542 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 08.2022 | KRW | 9.306.808 | | 7.311 | 136 | 0 | 136 | 0,02 |
| | 08.2022 | SGD | 22.146 | | 16.111 | 197 | 0 | 197 | 0,03 |
| | 08.2022 | $ | 1.240 | IDR | 18.075.106 | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 5.121 | SGD | 7.102 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | AUD | 1.565 | $ | 1.085 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07.2022 | CAD | 5.221 | | 4.135 | 88 | 0 | 88 | 0,01 |
| | 07.2022 | CHF | 423 | | 439 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 851 | | 41 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | NOK | 3.800 | | 406 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| | 07.2022 | NZD | 2.278 | | 1.486 | 70 | 0 | 70 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 12.513 | AUD | 18.169 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 745 | DKK | 4.990 | 0 | (43) | (43) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 4.667 | € | 4.452 | 9 | (22) | (13) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 850 | £ | 691 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 11.487 | ¥ | 1.534.800 | 0 | (190) | (190) | (0,03) |
| | 08.2022 | AUD | 18.169 | $ | 12.515 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 98.258 | | 14.633 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 367 | CNH | 2.455 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.182 | IDR | 17.334.501 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 239 | PEN | 898 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 05.2023 | CNH | 95.487 | $ | 14.228 | 0 | (40) | (40) | (0,01) |
| MYI | 07.2022 | DKK | 190.479 | | 28.232 | 1.454 | 0 | 1.454 | 0,20 |
| | 07.2022 | $ | 4.519 | DKK | 31.798 | 0 | (49) | (49) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 8.145 | ¥ | 1.109.005 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNY | 730 | $ | 109 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 31.733 | | 4.519 | 50 | 0 | 50 | 0,01 |
| | 08.2022 | ¥ | 1.107.209 | | 8.145 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 08.2022 | KRW | 12.045.827 | | 9.457 | 170 | 0 | 170 | 0,02 |
| | 08.2022 | THB | 128.226 | | 3.722 | 90 | 0 | 90 | 0,01 |
| | 09.2022 | $ | 593 | MYR | 2.603 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | ILS | 7.456 | $ | 2.212 | 82 | 0 | 82 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 519 | AUD | 755 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.122 | CLP | 930.174 | 0 | (129) | (129) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 6.332 | ¥ | 861.979 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 755 | $ | 519 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 167.505 | | 25.005 | 31 | 0 | 31 | 0,01 |
| | 08.2022 | CNY | 1.168 | | 175 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 860.582 | | 6.332 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 59.000 | | 440 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 09.2022 | MYR | 78.382 | | 18.644 | 872 | 0 | 872 | 0,12 |
| | 09.2022 | $ | 5.438 | MYR | 24.038 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 674 | ZAR | 10.421 | 0 | (42) | (42) | (0,01) |
| SOG | 07.2022 | € | 133.321 | $ | 143.295 | 3.914 | 0 | 3.914 | 0,53 |
| | 07.2022 | $ | 58.169 | £ | 47.797 | 0 | (122) | (122) | (0,02) |
| | 08.2022 | £ | 47.797 | $ | 58.196 | 121 | 0 | 121 | 0,02 |
| SSB | 09.2022 | $ | 2.267 | MYR | 9.931 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | CAD | 2.935 | $ | 2.288 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 13.402.653 | | 105.593 | 6.939 | 0 | 6.939 | 0,95 |
| | 07.2022 | $ | 133 | AUD | 193 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 4.292 | CAD | 5.521 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 193 | $ | 133 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 5.522 | | 4.292 | 12 | (1) | 11 | 0,00 |
| | 09.2022 | ¥ | 1.050.000 | | 7.863 | 92 | 0 | 92 | 0,01 |
| UAG | 07.2022 | AUD | 18.169 | | 12.978 | 484 | 0 | 484 | 0,07 |
| | 07.2022 | CLP | 930.174 | | 1.014 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 7.362 | NOK | 69.417 | 0 | (336) | (336) | (0,04) |
| | 09.2022 | | 1.002 | CLP | 930.174 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 979 | MXN | 19.514 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| | | | | | | $ 20.473 | $ (3.425) | $ 17.048 | 2,33 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 07.2022 | € 8.266 | $ 8.694 | $ 53 | $ 0 | $ 53 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ 603 | € 574 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | 8.708 | 8.264 | 0 | (52) | (52) | (0,01) |
| CBK | 07.2022 | € 36 | $ 39 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | 8.531 | 8.973 | 55 | (1) | 54 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ 8.322 | € 7.717 | 0 | (254) | (254) | (0,03) |
| | 08.2022 | 8.710 | 8.264 | 0 | (54) | (54) | (0,01) |
| MYI | 07.2022 | 1.997 | 1.863 | 0 | (50) | (50) | (0,01) |
| SOG | 07.2022 | 8.299 | 7.722 | 0 | (227) | (227) | (0,03) |
| UAG | 07.2022 | 7.098 | 6.605 | 0 | (193) | (193) | (0,03) |
| | | | | $ 109 | $ (833) | $ (724) | (0,10) |

Zum 30. Juni 2022 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | AUD 805 | $ 559 | $ 6 | $ 0 | $ 6 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 559 | AUD 805 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | AUD 1.374 | $ 954 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07.2022 | CAD 134 | 104 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK 1.289 | 183 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | € 97 | 102 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | SGD 10 | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 5.596 | £ 4.425 | 0 | (221) | (221) | (0,03) |
| | 07.2022 | 102 | HUF 37.334 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07.2022 | 0 | SGD 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 954 | AUD 1.374 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 08.2022 | 183 | DKK 1.286 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | 8 | SGD 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CNY 64.064 | $ 9.554 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07.2022 | € 20.749 | 21.824 | 132 | 0 | 132 | 0,02 |
| | 07.2022 | £207 | 257 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | IDR 6.931.937 | 466 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | ILS 657 | 191 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ 23.696 | 183 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN 7.262 | 359 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 635 | CHF 609 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | 221 | DKK 1.559 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | 9.554 | CNY 64.091 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | 21.773 | € 20.663 | 0 | (131) | (131) | (0,02) |
| | 08.2022 | 466 | IDR6.935.747 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | 191 | ILS 656 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | 357 | MXN 7.262 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | 198 | ILS 657 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | € 166 | $ 178 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07.2022 | PEN 278 | 75 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | TWD 492 | 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 149 | CZK 3.429 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07.2022 | 475 | IDR6.916.261 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07.2022 | 1.439 | KRW1.779.273 | 0 | (68) | (68) | (0,01) |
| | 07.2022 | 364 | MXN 7.262 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08.2022 | 74 | PEN 278 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | CHF 605 | $ 637 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 637 | CHF 604 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | CLP 38.151 | $ 43 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | MYR 1.853 | 422 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | PLN 793 | 178 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | SGD 343 | 247 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 46 | CLP 38.151 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07.2022 | 1 | IDR 10.109 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 421 | MYR 1.853 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | 43 | CLP 38.151 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | 421 | MYR 1.853 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | 178 | PLN 797 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | 247 | SGD 343 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | AUD 119 | $ 86 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07.2022 | CZK 4 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | € 3.417 | 3.592 | 22 | (1) | 21 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 298 | CAD 376 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07.2022 | 23.686 | € 21.965 | 0 | (724) | (724) | (0,10) |
| | 07.2022 | 124 | NOK 1.159 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07.2022 | 203 | NZD 312 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 07.2022 | 185 | PLN 794 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07.2022 | 512 | SEK 4.995 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| | 08.2022 | 3.428 | € 3.253 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | DKK 270 | $ 38 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07.2022 | $ | 0 | SGD | 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 38 | DKK | 270 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RBC | 07.2022 | | 74 | PEN | 278 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | | 17 | TWD | 492 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 492 | $ | 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | AUD | 122 | | 84 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 14.173 | | 105 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | KRW | 1.725.637 | | 1.330 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 9.667 | CNY | 64.491 | 0 | (37) | (37) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 15.228 | ¥ | 1.956.454 | 0 | (827) | (827) | (0,11) |
| | 07.2022 | | 3 | KRW | 3.831 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 253 | SGD | 346 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 84 | AUD | 122 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.330 | KRW | 1.724.919 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | AUD | 31 | $ | 21 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 3.213 | CAD | 4.103 | 0 | (32) | (32) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 21 | AUD | 31 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | CZK | 3.424 | $ | 146 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | HUF | 37.300 | | 100 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | PLN | 1 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | THB | 12.951 | | 369 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.771 | AUD | 2.479 | 0 | (66) | (66) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 115 | CNY | 764 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.647 | € | 2.463 | 0 | (72) | (72) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 14 | SGD | 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 380 | THB | 12.951 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 146 | CZK | 3.437 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 100 | HUF | 37.475 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 369 | THB | 12.951 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | | | | | | $ 223 | $ (2.369) | $ (2.146) | (0,29) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **$ 13.411** | **1,83** |

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.07.2037 | $ 13.300 | $ (12.418) | (1,69) |
| 2,000 % fällig am 01.07.2052 | 9.900 | (8.595) | (1,17) |
| 2,000 % fällig am 01.08.2052 | 83.050 | (72.020) | (9,82) |
| 2,500 % fällig am 14.07.2052 | 40.000 | (35.984) | (4,90) |
| 3,000 % fällig am 01.07.2052 (i) | 8.000 | (7.453) | (1,02) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (136.470)** | **(18,60)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 685.168** | **93,39** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ 48.470** | **6,61** |
| **Nettovermögen** | | **$ 733.638** | **100,00** |

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

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

**^** **Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a)** **Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

**(b)** **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

**(c)** **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)** **Zum 30. Juni 2022 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.**

**(j)** **Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeits-datum | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Citigroup, Inc. | 3,290 % | 17.03.2026 | 10.03.2022 | $ 2.200 | $ 2.130 | 0,29 |
| Deutsche Bank AG | 3,729 | 14.01.2032 | 22.01.2021 | 301 | 226 | 0,03 |
| Oracle Corp. | 2,300 | 25.03.2028 | 22.03.2021 | 2.395 | 2.067 | 0,28 |
| Oracle Corp. | 2,875 | 25.03.2031 | 22.03.2021 | 599 | 495 | 0,07 |

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeits-datum | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Oracle Corp. | 3,950 % | 25.03.2051 | 22.03.2021 | $ 100 | $ 74 | 0,01 |
| Oracle Corp. | 4,100 | 25.03.2061 | 22.03.2021 | 699 | 497 | 0,07 |
| | | | | $ 6.294 | $ 5.489 | 0,75 |

**(k) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 27.844 und Barmittel in Höhe von USD 4.603 als Sicherheiten verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von USD 19.645 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 4.350 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 770.957 | $ 0 | $ 770.957 |
| Investmentfonds | 44.341 | 0 | 0 | 44.341 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 494 | 0 | 494 |
| Finanzderivate[3] | 2.593 | 3.253 | 0 | 5.846 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (136.470) | 0 | (136.470) |
| **Summen** | **$ 46.934** | **$ 638.234** | **$ 0** | **$ 685.168** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 1.081.382 | $ 0 | $ 1.081.382 |
| Investmentfonds | 6.361 | 0 | 0 | 6.361 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 1.246 | 0 | 1.246 |
| Finanzderivate[3] | 1.470 | (10.441) | 0 | (8.971) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (150.627) | 0 | (150.627) |
| **Summen** | **$ 7.831** | **$ 921.560** | **$ 0** | **$ 929.391** |

(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 2022:**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | (0,540) % | 14.02.2022 | 15.08.2022 | € (6.399) | $ (6.676) | (0,91) |
| | (0,480) | 16.05.2022 | 13.09.2022 | (679) | (709) | (0,10) |
| | (0,450) | 16.05.2022 | 13.09.2022 | (483) | (505) | (0,07) |
| BRC | (5,000) | 23.05.2022 | TBD[1] | (721) | (748) | (0,10) |
| MYI | (0,580) | 14.02.2022 | 15.08.2022 | (20.950) | (21.852) | (2,98) |
| | (0,580) | 24.05.2022 | 15.08.2022 | (295) | (309) | (0,04) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (30.799)** | **(4,20)** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ 10 | $ 0 | $ 10 |
| BOA | 2.603 | (2.630) | (27) |
| BPS | 1.654 | (1.690) | (36) |
| BRC | (45) | 20 | (25) |
| CBK | 363 | 0 | 363 |
| DUB | 259 | (200) | 59 |
| GLM | (2.639) | 2.810 | 171 |
| GST | 4 | (150) | (146) |
| HUS | (14) | 0 | (14) |
| IND | 117 | 0 | 117 |
| JPM | 109 | 0 | 109 |
| MBC | (1,188) | 1.240 | 52 |
| MSC | (3) | 0 | (3) |

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| MYC | $ 130 | $ (740) | $ (610) |
| MYI | 1.662 | (1.370) | 292 |
| RBC | (1) | 0 | (1) |
| SCX | (15) | 0 | (15) |
| SOG | 3.686 | (3.820) | (134) |
| SSB | (15) | 0 | (15) |
| TOR | 7.011 | (7.530) | (519) |
| UAG | (222) | 270 | 48 |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 70,81 | 92,15 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 33,58 | 26,23 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 0,70 | 0,22 |
| Investmentfonds | 6,04 | 0,70 |
| Pensionsgeschäfte | 0,07 | 0,14 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,34 | 0,21 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (1,38) | (0,77) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 1,83 | (0,42) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (18,60) | (16,52) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (4,20) | (10,91) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | k. A. | (0,93) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Australien | 2,06 | 2,63 |
| Brasilien | 0,20 | 0,17 |
| Kanada | 1,75 | 2,18 |
| Cayman-Inseln | 2,78 | 3,57 |
| China | 6,62 | 13,05 |
| Dänemark | 3,25 | 4,33 |
| Finnland | 0,15 | 0,08 |
| Frankreich | 4,80 | 4,03 |
| Deutschland | 2,58 | 2,36 |
| Guernsey, Kanalinseln | 0,05 | 0,04 |
| Hongkong | 0,16 | 0,13 |
| Ungarn | k. A. | 0,06 |
| Indien | k. A. | 0,17 |
| Irland | 6,39 | 5,22 |
| Israel | 0,82 | 1,13 |
| Italien | 1,35 | 4,31 |
| Japan | 10,04 | 17,80 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,03 | 0,03 |
| Luxemburg | 0,75 | 0,84 |
| Malaysia | 1,13 | 1,94 |
| Mexiko | 0,04 | 0,05 |
| Multinational | 0,14 | 0,11 |
| Niederlande | 2,43 | 1,66 |
| Neuseeland | 0,09 | 0,09 |
| Norwegen | 0,22 | 0,08 |
| Peru | 1,23 | 1,12 |
| Portugal | 0,14 | 0,02 |
| Katar | 0,20 | 0,28 |
| Rumänien | 0,53 | 0,47 |
| Russland | k. A. | 0,28 |
| Saudi-Arabien | 0,14 | 0,79 |
| Serbien | 0,25 | 0,30 |
| Singapur | 1,74 | 0,90 |
| Slowenien | 0,22 | 0,33 |
| Südafrika | 0,04 | 0,08 |
| Südkorea | 2,16 | 2,11 |
| Spanien | 1,63 | 4,43 |
| Supranational | 0,50 | 0,41 |
| Schweden | 0,09 | 0,11 |
| Schweiz | 2,20 | 1,76 |
| Thailand | 0,74 | k. A. |
| Vereinigte Arabische Emirate | 0,04 | 0,20 |
| Großbritannien | 12,31 | 12,91 |
| USA | 30,04 | 24,99 |
| Kurzfristige Instrumente | 3,06 | 1,05 |
| Investmentfonds | 6,04 | 0,70 |
| Pensionsgeschäfte | 0,07 | 0,14 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,35 | 0,21 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | (0,01) | k. A. |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,04) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | 0,29 | (0,04) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,11) | 0,00 |
| Zinsswaps — Basisswaps | 0,00 | 0,01 |
| Zinsswaps | (1,52) | (0,74) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoptionen | 0,03 | 0,01 |
| Optionen auf Wertpapiere | 0,08 | 0,02 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,01) | 0,00 |
| Devisenoptionen | k. A. | (0,01) |
| Zinsswapoptionen | (0,50) | (0,16) |
| Zinscaps | 0,00 | 0,00 |
| Optionen auf Wertpapiere | 0,00 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf | (0,02) | (0,03) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,00 | 0,00 |
| Cross-Currency Swaps | 0,00 | 0,00 |
| Zinsswaps | 0,04 | 0,01 |
| Total Return Swaps auf Indizes | 0,27 | 0,01 |
| Total Return Swaps auf Wertpapiere | k. A. | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | 2,33 | (0,34) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (0,39) | 0,07 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (18,60) | (16,52) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 6,61 | (1,94) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Global Core Asset Allocation Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **AAdvantage Loyalty IP Ltd.** | | | | |
| 5,813 % fällig am 20.04.2028 | $ | 1.500 | $ 1.437 | 0,18 |
| **Air Canada** | | | | |
| 4,250 % fällig am 11.08.2028 | | 400 | 369 | 0,05 |
| **Carnival Corp.** | | | | |
| 5,877 % fällig am 30.06.2025 | | 99 | 93 | 0,01 |
| 6,127 % fällig am 18.10.2028 | | 796 | 716 | 0,09 |
| **United Airlines, Inc.** | | | | |
| 5,392 % fällig am 21.04.2028 | | 497 | 463 | 0,06 |
| **Viad Corp.** | | | | |
| 6,666 % fällig am 30.07.2028 | | 645 | 606 | 0,08 |
| | | | 3.684 | 0,47 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | |
| 2,528 % fällig am 18.11.2027 | | 216 | 176 | 0,02 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.03.2028 (f) | | 650 | 571 | 0,07 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 5,250 % fällig am 11.02.2027 (f)(h) | | 1.300 | 1.007 | 0,13 |
| **DAE Sukuk Difc Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.02.2026 | | 700 | 663 | 0,09 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 13.11.2025 | | 400 | 361 | 0,05 |
| 3,810 % fällig am 09.01.2024 | | 200 | 194 | 0,03 |
| 4,063 % fällig am 01.11.2024 | | 200 | 190 | 0,02 |
| 4,389 % fällig am 08.01.2026 | | 200 | 185 | 0,02 |
| 4,687 % fällig am 09.06.2025 | | 400 | 379 | 0,05 |
| 5,125 % fällig am 16.06.2025 | | 1.500 | 1.436 | 0,18 |
| 5,584 % fällig am 18.03.2024 | | 600 | 598 | 0,08 |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 29.03.2025 | € | 300 | 277 | 0,04 |
| **Kaisa Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 9,375 % fällig am 30.06.2024 ^ | $ | 650 | 91 | 0,01 |
| 9,750 % fällig am 28.09.2023 ^ | | 1.100 | 152 | 0,02 |
| 11,700 % fällig am 11.11.2025 ^ | | 250 | 35 | 0,00 |
| **New Metro Global Ltd.** | | | | |
| 4,800 % fällig am 15.12.2024 | | 1.300 | 715 | 0,09 |
| **Nissan Motor Acceptance Co. LLC** | | | | |
| 1,850 % fällig am 16.09.2026 | | 300 | 253 | 0,03 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 18.11.2030 (f)(h) | | 1.300 | 1.011 | 0,13 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | |
| 8,350 % fällig am 19.04.2023 ^ | | 800 | 122 | 0,02 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 7,500 % fällig am 03.06.2026 (f)(h) | € | 1.000 | 968 | 0,12 |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | $ | 7.350 | 7.614 | 0,98 |
| **Ursa Re Ltd.** | | | | |
| 5,448 % fällig am 07.12.2027 | | 1.150 | 1.148 | 0,15 |
| **VICI Properties LP** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.02.2029 | | 800 | 690 | 0,09 |
| **Yango Justice International Ltd.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.04.2024 ^ | | 1.300 | 105 | 0,01 |
| | | | 18.941 | 2,43 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **Air Canada** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.08.2029 | CAD | 100 | 66 | 0,01 |
| **American Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,575 % fällig am 15.07.2029 | $ | 443 | 412 | 0,05 |
| 3,700 % fällig am 01.04.2028 | | 300 | 261 | 0,03 |
| **Berry Global, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.07.2026 | | 4.500 | 4.303 | 0,55 |
| **Caesars Entertainment, Inc.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 01.07.2025 | | 400 | 387 | 0,05 |
| **Carnival Corp.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2028 | | 900 | 741 | 0,10 |
| **DAE Funding LLC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 15.02.2024 | | 400 | 379 | 0,05 |
| **Energy Transfer LP** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.05.2030 | | 2.100 | 1.895 | 0,24 |
| **Las Vegas Sands Corp.** | | | | |
| 3,200 % fällig am 08.08.2024 | $ | 200 | $ 189 | 0,03 |
| 3,500 % fällig am 18.08.2026 | | 200 | 174 | 0,02 |
| **Mitsubishi Corp.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 14.07.2022 | | 2.300 | 2.300 | 0,30 |
| **Nissan Motor Co. Ltd.** | | | | |
| 4,345 % fällig am 17.09.2027 | | 100 | 92 | 0,01 |
| 4,810 % fällig am 17.09.2030 | | 2.100 | 1.868 | 0,24 |
| **Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.10.2027 | | 1.200 | 1.028 | 0,13 |
| **RCS & RDS S.A.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 05.02.2028 | € | 1.400 | 1.150 | 0,15 |
| **Rolls-Royce PLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.10.2027 | £ | 1.000 | 1.146 | 0,15 |
| **United Airlines, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.04.2026 | $ | 200 | 177 | 0,02 |
| 4,625 % fällig am 15.04.2029 | | 300 | 256 | 0,03 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.06.2027 | | 400 | 382 | 0,05 |
| **Wynn Las Vegas LLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.05.2027 | | 400 | 343 | 0,04 |
| | | | 17.549 | 2,25 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **Midwest Connector Capital Co. LLC** | | | | |
| 3,900 % fällig am 01.04.2024 | | 3.400 | 3.339 | 0,43 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.02.2031 | | 1.100 | 842 | 0,11 |
| | | | 4.181 | 0,54 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 40.671 | 5,22 |
| **WANDELANLEIHEN & WECHSEL** | | | | |
| **Multiplan Corp. (6,000 % bar oder 7,000 % PIK)** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.10.2027 (b) | | 1.400 | 1.157 | 0,15 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 4,956 % fällig am 25.03.2036 (a) | | 143 | 20 | 0,00 |
| **Freddie Mac** | | | | |
| 4,776 % fällig am 15.08.2043 (a) | | 400 | 91 | 0,01 |
| 9,435 % fällig am 15.05.2035 | | 180 | 167 | 0,02 |
| **Ginnie Mae** | | | | |
| 0,382 % fällig am 20.08.2068 | | 899 | 877 | 0,11 |
| 1,671 % fällig am 20.09.2071 | | 7.753 | 7.767 | 1,00 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 | | 12.100 | 10.885 | 1,40 |
| 3,000 % fällig am 01.09.2052 | | 4.900 | 4.554 | 0,58 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2052 | | 76.700 | 73.698 | 9,46 |
| | | | 98.059 | 12,58 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | | |
| 1,375 % fällig am 15.11.2040 | | 5.700 | 4.107 | 0,53 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 3,333 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 41 | 39 | 0,01 |
| 3,440 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 102 | 94 | 0,01 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.09.2047 | | 219 | 201 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 | | 828 | 753 | 0,10 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,244 % fällig am 25.04.2035 | | 138 | 116 | 0,01 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 46 | 23 | 0,00 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | | |
| 1,703 % fällig am 25.05.2053 | £ | 2.274 | 2.757 | 0,35 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | | |
| 2,484 % fällig am 25.08.2029 | $ | 446 | 430 | 0,05 |
| **Impac CMB Trust** | | | | |
| 2,244 % fällig am 25.04.2035 | | 218 | 208 | 0,03 |
| 2,269 % fällig am 25.04.2035 | | 280 | 263 | 0,03 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.04.2037 | | 1.967 | 1.712 | 0,22 |
| 2,184 % fällig am 25.07.2035 | | 102 | 79 | 0,01 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 2,024 % fällig am 25.08.2046 | $ | 1.288 | $ 1.187 | 0,15 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | | |
| 2,104 % fällig am 25.05.2037 | | 599 | 285 | 0,04 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 2,144 % fällig am 25.06.2046 | | 1.264 | 335 | 0,04 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036 | | 334 | 293 | 0,04 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,605 % fällig am 20.10.2051 | £ | 1.667 | 2.018 | 0,26 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,284 % fällig am 25.01.2045 | $ | 2.336 | 2.235 | 0,29 |
| 2,424 % fällig am 25.01.2045 | | 657 | 622 | 0,08 |
| 2,544 % fällig am 25.10.2044 | | 104 | 95 | 0,01 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | | 503 | 387 | 0,05 |
| | | | 14.132 | 1,81 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Aames Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 2,104 % fällig am 25.04.2036 | | 92 | 86 | 0,01 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,104 % fällig am 25.06.2036 | | 276 | 213 | 0,03 |
| 2,524 % fällig am 25.08.2035 | | 300 | 293 | 0,04 |
| 2,749 % fällig am 25.04.2035 | | 157 | 137 | 0,02 |
| 3,424 % fällig am 25.06.2034 | | 36 | 36 | 0,01 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,269 % fällig am 25.12.2035 | | 480 | 462 | 0,06 |
| **Apidos CLO** | | | | |
| 1,974 % fällig am 17.07.2030 | | 300 | 296 | 0,04 |
| 2,073 % fällig am 20.04.2031 | | 950 | 934 | 0,12 |
| **Ares European CLO DAC** | | | | |
| 0,850 % fällig am 20.04.2032 | € | 300 | 305 | 0,04 |
| **Argent Securities Trust** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.07.2036 | $ | 1.216 | 1.077 | 0,14 |
| 1,944 % fällig am 25.05.2036 | | 406 | 111 | 0,01 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | |
| 2,324 % fällig am 25.06.2034 | | 603 | 580 | 0,07 |
| 2,359 % fällig am 25.03.2035 | | 626 | 564 | 0,07 |
| **Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.12.2036 | | 873 | 856 | 0,11 |
| **Atlas Senior Loan Fund Ltd.** | | | | |
| 2,274 % fällig am 17.11.2027 | | 380 | 377 | 0,05 |
| **Barings CLO Ltd.** | | | | |
| 1,863 % fällig am 20.01.2028 | | 301 | 298 | 0,04 |
| **Cairn CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 20.10.2028 | € | 141 | 146 | 0,02 |
| 0,710 % fällig am 25.04.2032 | | 200 | 205 | 0,03 |
| **Catamaran CLO Ltd.** | | | | |
| 2,236 % fällig am 22.04.2030 | $ | 1.293 | 1.277 | 0,16 |
| **Centex Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,674 % fällig am 25.10.2035 | | 993 | 947 | 0,12 |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,974 % fällig am 25.10.2037 | | 913 | 909 | 0,12 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 2,059 % fällig am 25.11.2036 | | 189 | 186 | 0,02 |
| 2,524 % fällig am 25.01.2036 | | 985 | 945 | 0,12 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 1,854 % fällig am 25.05.2037 | | 10.405 | 9.810 | 1,26 |
| 1,884 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 219 | 199 | 0,03 |
| 3,274 % fällig am 25.12.2034 | | 2.063 | 2.042 | 0,26 |
| 3,574 % fällig am 25.08.2035 | | 750 | 727 | 0,09 |
| **Ellington Loan Acquisition Trust** | | | | |
| 2,724 % fällig am 25.05.2037 | | 248 | 240 | 0,03 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,329 % fällig am 25.11.2036 | | 2.200 | 2.122 | 0,27 |
| 2,569 % fällig am 25.06.2034 | | 740 | 700 | 0,09 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.10.2036 | | 6.792 | 3.224 | 0,41 |
| **GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC** | | | | |
| 0,900 % fällig am 20.01.2032 | € | 300 | 305 | 0,04 |
| **GSAMP Trust** | | | | |
| 2,299 % fällig am 25.11.2035 | $ | 514 | 502 | 0,06 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | € | 269 | 280 | 0,04 |
| 0,850 % fällig am 15.01.2032 | | 800 | 814 | 0,10 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 2,299 % fällig am 25.02.2036 | $ | 3.523 $ | 3.427 | 0,44 |
| **Invesco Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 15.07.2031 | € | 500 | 507 | 0,07 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 1,724 % fällig am 25.03.2047 | $ | 1.278 | 836 | 0,11 |
| 1,834 % fällig am 25.10.2036 | | 66 | 65 | 0,01 |
| 1,924 % fällig am 25.03.2037 | | 1.000 | 942 | 0,12 |
| **Jubilee CLO DAC** | | | | |
| 0,519 % fällig am 15.12.2029 | € | 259 | 268 | 0,03 |
| **Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust** | | | | |
| 7,170 % fällig am 15.04.2040 ^ | $ | 817 | 562 | 0,07 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,224 % fällig am 25.01.2036 | | 2.401 | 2.217 | 0,29 |
| 2,899 % fällig am 25.02.2035 | | 597 | 586 | 0,08 |
| **Man GLG Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,870 % fällig am 15.01.2030 | € | 257 | 266 | 0,03 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,834 % fällig am 25.05.2037 | $ | 872 | 828 | 0,11 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.07.2035 | | 704 | 683 | 0,09 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 1,734 % fällig am 25.03.2037 | | 1.416 | 675 | 0,09 |
| 1,754 % fällig am 25.10.2036 | | 89 | 81 | 0,01 |
| 1,764 % fällig am 25.10.2036 | | 1.119 | 570 | 0,07 |
| 1,924 % fällig am 25.06.2036 | | 264 | 231 | 0,03 |
| 2,874 % fällig am 25.07.2037 | | 800 | 728 | 0,09 |
| **Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd.** | | | | |
| 2,103 % fällig am 20.04.2031 | | 250 | 244 | 0,03 |
| **OCP Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,820 % fällig am 15.01.2032 | € | 1.100 | 1.135 | 0,15 |
| 0,880 % fällig am 22.09.2034 | | 1.100 | 1.113 | 0,14 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,359 % fällig am 25.05.2035 | $ | 500 | 480 | 0,06 |
| 2,494 % fällig am 25.05.2035 | | 1.151 | 1.035 | 0,13 |
| **OZLM Ltd.** | | | | |
| 2,213 % fällig am 20.01.2031 | | 300 | 294 | 0,04 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.10.2031 | € | 2.200 | 2.253 | 0,29 |
| 0,780 % fällig am 15.04.2031 | | 738 | 762 | 0,10 |
| **Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 1,954 % fällig am 25.07.2036 | $ | 323 | 310 | 0,04 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | | |
| 1,974 % fällig am 25.10.2036 | | 600 | 578 | 0,07 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 1,874 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 3.257 | 3.016 | 0,39 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 1,974 % fällig am 25.05.2037 | | 141 | 112 | 0,01 |
| 2,404 % fällig am 25.02.2034 | | 351 | 341 | 0,04 |
| **Segovia European CLO DAC** | | | | |
| 0,880 % fällig am 20.07.2032 | € | 700 | 711 | 0,09 |
| **Sound Point CLO Ltd.** | | | | |
| 2,194 % fällig am 18.04.2031 | $ | 800 | 788 | 0,10 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 2,244 % fällig am 25.01.2036 | | 477 | 455 | 0,06 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,194 % fällig am 25.10.2036 | | 229 | 225 | 0,03 |
| 2,419 % fällig am 25.02.2036 | | 200 | 185 | 0,02 |
| 2,629 % fällig am 25.11.2035 | | 1.000 | 972 | 0,13 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | |
| 0,920 % fällig am 12.01.2032 | € | 300 | 305 | 0,04 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | |
| 1,924 % fällig am 15.07.2027 | $ | 131 | 132 | 0,02 |
| **Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 1,934 % fällig am 25.08.2036 | | 604 | 565 | 0,07 |
| | | | 61.688 | 7,92 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 09.07.2030 | | 994 | 209 | 0,03 |
| 1,125 % fällig am 09.07.2035 | | 653 | 135 | 0,02 |
| 47,331 % fällig am 04.10.2022 | ARS | 5.300 | 5 | 0,00 |
| **Argentina Treasury Bond BONCER** | | | | |
| 1,400 % fällig am 25.03.2023 | | 41.869 | 154 | 0,02 |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos** | | | | |
| 4,700 % fällig am 01.09.2030 | CLP | 3.225.000 | 3.088 | 0,40 |
| **China Government Bond** | | | | |
| 2,850 % fällig am 04.06.2027 | CNY | 21.200 $ | 3.197 | 0,41 |
| 3,280 % fällig am 03.12.2027 | | 184.700 | 28.462 | 3,65 |
| **Colombian TES** | | | | |
| 6,250 % fällig am 26.11.2025 | COP | 48.202.000 | 10.164 | 1,30 |
| 7,750 % fällig am 18.09.2030 | | 39.400.000 | 7.661 | 0,98 |
| **Israel Government International Bond** | | | | |
| 0,750 % fällig am 31.07.2022 | ILS | 3.900 | 1.113 | 0,14 |
| 1,250 % fällig am 30.11.2022 | | 1.300 | 371 | 0,05 |
| **Japan Government International Bond** | | | | |
| 1,700 % fällig am 20.09.2044 | ¥ | 600.000 | 5.057 | 0,65 |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 1,862 % fällig am 01.12.2032 | $ | 1.800 | 1.369 | 0,17 |
| 5,400 % fällig am 12.08.2034 | PEN | 13.200 | 2.806 | 0,36 |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 3,875 % fällig am 23.04.2023 | $ | 2.000 | 2.009 | 0,26 |
| **Spain Government International Bond** | | | | |
| 0,700 % fällig am 30.04.2032 | € | 5.000 | 4.434 | 0,57 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 0,625 % fällig am 22.10.2050 | £ | 3.126 | 2.316 | 0,30 |
| | | | 72.550 | 9,31 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| **Activision Blizzard, Inc.** | 63.273 | 4.927 | 0,63 |
| **TEGNA, Inc.** | 168.148 | 3.526 | 0,45 |
| **Twitter, Inc. (c)** | 70.963 | 2.653 | 0,34 |
| | | 11.106 | 1,42 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| **Alleghany Corp. (c)** | 4.414 | 3.677 | 0,47 |
| **Credit Suisse Group AG** | 1 | 0 | 0,00 |
| **First Horizon Corp.** | 161.653 | 3.534 | 0,46 |
| | | 7.211 | 0,93 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| **AbbVie, Inc.** | 6.110 | 936 | 0,12 |
| **Biohaven Pharmaceutical Holding Co. Ltd. (c)** | 23.306 | 3.396 | 0,44 |
| **Change Healthcare, Inc. (c)** | 106.415 | 2.454 | 0,31 |
| **Cigna Corp.** | 1.806 | 476 | 0,06 |
| **Elevance Health, Inc.** | 4.621 | 2.230 | 0,29 |
| **Exact Sciences Corp. (c)** | 6.587 | 259 | 0,03 |
| **Exelixis, Inc. (c)** | 57.204 | 1.191 | 0,15 |
| **Halozyme Therapeutics, Inc. (c)** | 26.937 | 1.185 | 0,15 |
| **Hologic, Inc. (c)** | 17.523 | 1.214 | 0,16 |
| **Humana, Inc.** | 5.766 | 2.699 | 0,35 |
| **Incyte Corp. (c)** | 13.224 | 1.005 | 0,13 |
| **LHC Group, Inc. (c)** | 22.910 | 3.568 | 0,46 |
| **Merck & Co., Inc.** | 14.970 | 1.365 | 0,18 |
| **Molina Healthcare, Inc. (c)** | 1.792 | 501 | 0,06 |
| **Neurocrine Biosciences, Inc. (c)** | 3.543 | 345 | 0,04 |
| **Regeneron Pharmaceuticals, Inc. (c)** | 3.435 | 2.031 | 0,26 |
| **Seagen, Inc. (c)** | 4.534 | 802 | 0,10 |
| **Turning Point Therapeutics, Inc. (c)** | 41.960 | 3.158 | 0,41 |
| **United Therapeutics Corp. (c)** | 5.001 | 1.178 | 0,15 |
| **Vertex Pharmaceuticals, Inc. (c)** | 12.713 | 3.582 | 0,46 |
| | | 33.575 | 4,31 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| **ABB Ltd.** | 28.267 $ | 756 | 0,10 |
| **AMETEK, Inc.** | 16.956 | 1.863 | 0,24 |
| **Caterpillar, Inc.** | 7.841 | 1.402 | 0,18 |
| **Deere & Co.** | 2.355 | 705 | 0,09 |
| **Eaton Corp. PLC** | 10.206 | 1.286 | 0,17 |
| **Emerson Electric Co.** | 16.145 | 1.284 | 0,16 |
| **FANUC Corp.** | 6.484 | 1.015 | 0,13 |
| **GXO Logistics, Inc. (c)** | 17.500 | 757 | 0,10 |
| **Kubota Corp.** | 70.668 | 1.058 | 0,14 |
| **MasTec, Inc. (c)** | 17.777 | 1.274 | 0,16 |
| **Mueller Water Products, Inc. 'A'** | 142.508 | 1.672 | 0,21 |
| | | 13.072 | 1,68 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| **Applied Materials, Inc.** | 15.036 | 1.368 | 0,17 |
| **Arista Networks, Inc. (c)** | 9.122 | 855 | 0,11 |
| **Automatic Data Processing, Inc.** | 2.609 | 548 | 0,07 |
| **BE Semiconductor Industries NV** | 8.400 | 400 | 0,05 |
| **Flex Ltd. (c)** | 123.495 | 1.787 | 0,23 |
| **Intel Corp.** | 32.922 | 1.232 | 0,16 |
| **IPG Photonics Corp. (c)** | 4.105 | 386 | 0,05 |
| **Lam Research Corp.** | 3.580 | 1.526 | 0,19 |
| **Marvell Technology, Inc.** | 19.443 | 846 | 0,11 |
| **Micron Technology, Inc. (c)** | 12.587 | 696 | 0,09 |
| **NetApp, Inc.** | 26.589 | 1.735 | 0,22 |
| **Rogers Corp. (c)** | 14.611 | 3.829 | 0,49 |
| **Skyworks Solutions, Inc.** | 5.595 | 518 | 0,07 |
| **Switch, Inc. 'A'** | 97.376 | 3.262 | 0,42 |
| **Teradyne, Inc.** | 13.184 | 1.181 | 0,15 |
| **Vonage Holdings Corp. (c)** | 202.399 | 3.813 | 0,49 |
| **Zebra Technologies Corp. 'A' (c)** | 1.000 | 294 | 0,04 |
| | | 24.276 | 3,11 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| **GCP Applied Technologies, Inc. (c)** | 128.950 | 4.034 | 0,52 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| **PNM Resources, Inc.** | 49.758 | 2.377 | 0,30 |
| | | 95.651 | 12,27 |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| **Nationwide Building Society** 10,250 % | 8.144 | 1.449 | 0,19 |
| **REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS** | | | |
| **Agree Realty Corp.** | 41.327 | 2.981 | 0,38 |
| **American Tower Corp.** | 9.856 | 2.519 | 0,32 |
| **Apartment Income REIT Corp.** | 62.213 | 2.588 | 0,33 |
| **Duke Realty Corp.** | 88.978 | 4.889 | 0,63 |
| **Equinix, Inc.** | 1.943 | 1.277 | 0,16 |
| **Equity LifeStyle Properties, Inc.** | 30.425 | 2.144 | 0,28 |
| **Equity Residential** | 39.817 | 2.876 | 0,37 |
| **First Industrial Realty Trust, Inc.** | 62.470 | 2.966 | 0,38 |
| **Gaming and Leisure Properties, Inc.** | 48.445 | 2.222 | 0,29 |
| **Host Hotels & Resorts, Inc.** | 135.801 | 2.129 | 0,27 |
| **Invitation Homes, Inc.** | 104.896 | 3.732 | 0,48 |
| **Life Storage, Inc.** | 10.431 | 1.165 | 0,15 |
| **Medical Properties Trust, Inc.** | 102.589 | 1.567 | 0,20 |
| **RLJ Lodging Trust** | 138.744 | 1.530 | 0,20 |
| **SBA Communications Corp.** | 9.092 | 2.910 | 0,37 |
| **Simon Property Group, Inc.** | 22.810 | 2.165 | 0,28 |
| **Sun Communities, Inc.** | 13.938 | 2.221 | 0,28 |
| **Sunstone Hotel Investors, Inc.** | 56.900 | 564 | 0,07 |
| **VICI Properties, Inc.** | 129.562 | 3.860 | 0,50 |
| | | 46.305 | 5,94 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | | |
| 51,049 % fällig am 30.09.2022 (d)(e) | ARS | 63.100 | $ 211 | 0,03 |
| **ISRAEL TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,050) % fällig am 07.10.2022 (d)(e) | ILS | 200 | 57 | 0,01 |
| (0,020) % fällig am 07.12.2022 (d)(e) | | 3.000 | 854 | 0,11 |
| (0,005) % fällig am 03.08.2022 (d)(e) | | 5.200 | 1.485 | 0,19 |
| 0,000 % fällig am 07.12.2022 (d)(e) | | 1.400 | 399 | 0,05 |
| 0,016 % fällig am 04.01.2023 (d)(e) | | 9.900 | 2.813 | 0,36 |
| 0,020 % fällig am 07.12.2022 (d)(e) | | 1.300 | 370 | 0,05 |
| 0,022 % fällig am 04.01.2023 (d)(e) | | 7.400 | 2.103 | 0,27 |
| 0,023 % fällig am 07.12.2022 (d)(e) | | 3.500 | 997 | 0,13 |
| 0,035 % fällig am 07.12.2022 (d)(e) | | 2.600 | 740 | 0,09 |
| 0,156 % fällig am 04.01.2023 (d)(e) | | 600 | 170 | 0,02 |
| | | | 9.988 | 1,28 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **JAPAN TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,150) % fällig am 29.08.2022 (d)(e) | ¥ | 2.910.000 | $ 21.425 | 2,75 |
| (0,121) % fällig am 22.08.2022 (d)(e) | | 3.300.000 | 24.296 | 3,12 |
| (0,087) % fällig am 04.07.2022 (d)(e) | | 3.530.000 | 25.984 | 3,33 |
| (0,082) % fällig am 04.07.2022 (d)(e) | | 4.848.000 | 35.686 | 4,58 |
| | | | 107.391 | 13,78 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 117.590 | 15,09 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **$ 557.043** | **71,48** |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g) | 15.715.099 | $ 156.334 | 20,06 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g) | 1.012.212 | 100.155 | 12,85 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$ 256.489** | **32,91** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 36.319 | U.S. Treasury Notes, 3,000 % fällig am 30.06.2024 | $ (37.046) | $ 36.319 | $ 36.319 | 4,66 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (37.046)** | **$ 36.319** | **$ 36.319** | **4,66** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 3-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 74 | $ 3 | 0,00 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 15 | (5) | 0,00 |
| CAC 40 Index July Futures | Long | 07.2022 | 30 | (22) | 0,00 |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 45 | (146) | (0,02) |
| DAX Index September Futures | Long | 09.2022 | 4 | (55) | (0,01) |
| E-mini NASDAQ 100 Index September Futures | Long | 09.2022 | 4 | (6) | 0,00 |
| E-mini S&P 500 Index September Futures | Long | 09.2022 | 1.456 | (6.821) | (0,88) |
| Euro STOXX 50 September Futures | Long | 09.2022 | 236 | (215) | (0,03) |
| Euro STOXX 600 September Futures | Long | 09.2022 | 3.143 | (772) | (0,10) |
| Euro-Bobl September Futures | Long | 09.2022 | 101 | (5) | 0,00 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Long | 09.2022 | 59 | (186) | (0,02) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 139 | 154 | 0,02 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 6 | (85) | (0,01) |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 33 | 36 | 0,01 |
| Euro-Schatz September Futures | Long | 09.2022 | 155 | (57) | (0,01) |
| FTSE 100 Index September Futures | Long | 09.2022 | 62 | (43) | (0,01) |
| FTSE/MIB Index September Futures | Long | 09.2022 | 1 | (3) | 0,00 |
| Hang Seng China Enterprises Index July Futures | Long | 07.2022 | 6 | (13) | 0,00 |
| IBEX 35 Index July Futures | Long | 07.2022 | 1 | 0 | 0,00 |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 32 | 332 | 0,04 |
| Mini MSCI Emerging Markets Index September Futures | Long | 09.2022 | 303 | 52 | 0,01 |
| Nikkei 225 Yen-Denominated September Futures | Long | 09.2022 | 252 | (1.030) | (0,13) |
| OMX Stockholm 30 Index July Futures | Short | 07.2022 | 1 | 1 | 0,00 |
| S&P/Toronto Stock Exchange 60 September Futures | Long | 09.2022 | 97 | (846) | (0,11) |
| SPI 200 Index September Futures | Long | 09.2022 | 131 | (144) | (0,02) |
| Swiss Market September Futures | Short | 09.2022 | 1 | 1 | 0,00 |
| Topix Index September Futures | Long | 09.2022 | 39 | (180) | (0,02) |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 237 | (185) | (0,02) |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 812 | 321 | 0,04 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 878 | 45 | 0,01 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 140 | (214) | (0,03) |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09.2022 | 80 | (222) | (0,03) |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Long | 09.2022 | 100 | (129) | (0,02) |
| | | | | $ (10.439) | (1,34) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ (10.439)** | **(1,34)** |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20.06.2026 | $ 200 | $ (5) | 0,00 |
| General Motors Co. | 5,000 | 20.12.2026 | 300 | (31) | (0,01) |
| | | | | $ (36) | (0,01) |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[2]

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Crossover 37 5-Year Index | (5,000) % | 20.06.2027 | € 100 | $ 9 | 0,00 |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-38 5-Year Index | 5,000 % | 20.06.2027 | $ 99 | $ (8) | 0,00 |
| CDX.IG-35 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2025 | 900 | (13) | 0,00 |
| CDX.IG-36 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2026 | 3.200 | (63) | (0,01) |
| CDX.IG-37 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 2.600 | (52) | (0,01) |
| CDX.IG-38 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 53.800 | (633) | (0,08) |
| iTraxx Europe Main 37 10-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | € 300 | (7) | 0,00 |
| | | | | $ (776) | (0,10) |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 % | 21.09.2024 | £ 54.300 | $ 291 | 0,04 |
| Zahlung[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 | 21.09.2027 | 2.000 | (56) | (0,01) |
| Erhalt[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2032 | 12.600 | (150) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 5,260 | 15.09.2026 | INR 19.200 | 3 | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 15.12.2026 | ¥ 6.130.000 | (89) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,050 | 15.12.2031 | 3.030.000 | 167 | 0,02 |
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 1,250 | 15.12.2026 | SGD 7.900 | (68) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 1,250 | 16.03.2027 | 3.000 | (25) | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 0,250 | 16.03.2024 | $ 14.500 | (47) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 | 16.03.2027 | 4.800 | 289 | 0,04 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 | 15.06.2027 | 4.900 | 25 | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2027 | 62.200 | 1.027 | 0,13 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2027 | 20.800 | (101) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2032 | 14.300 | (278) | (0,04) |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2052 | 3.100 | (53) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,385 | 08.06.2032 | 6.100 | 146 | 0,02 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,420 | 02.01.2025 | BRL 35.600 | (158) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,575 | 04.01.2027 | 5.200 | (2) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,670 | 02.01.2025 | 48.400 | (151) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,825 | 02.01.2025 | 36.200 | (107) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,910 | 02.01.2025 | 36.200 | (96) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,330 | 02.01.2025 | 84.800 | (97) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,460 | 02.01.2025 | 84.800 | 61 | 0,01 |
| Zahlung[4] | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,250 | 21.09.2052 | CAD 2.600 | (200) | (0,03) |
| Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,500 | 15.12.2026 | CNY 12.700 | (5) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,920 | 26.08.2026 | COP 21.200.000 | 763 | 0,10 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,925 | 26.08.2026 | 20.900.000 | (574) | (0,07) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,215 | 09.02.2027 | 10.183.800 | 76 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,620 | 18.09.2030 | 29.000.000 | 545 | 0,07 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,585 | 26.11.2025 | 21.088.900 | 109 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,590 | 26.11.2025 | 22.207.400 | 108 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,930 | 18.09.2030 | 2.700.000 | 2 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 1,215 | 11.02.2027 | ILS 38.300 | (640) | (0,08) |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,268 | 17.03.2031 | KRW 2.741.200 | (223) | (0,03) |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,336 | 17.03.2031 | 1.600.000 | (133) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 2,500 | 16.03.2027 | 2.781.300 | (105) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 17.06.2025 | $ 9.000 | 902 | 0,12 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 6,690 | 04.11.2026 | ZAR 146.400 | (361) | (0,05) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,178 | 26.04.2027 | 133.800 | 41 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,850 | 14.01.2027 | CLP 7.417.400 | 351 | 0,05 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,930 | 22.02.2032 | 3.091.900 | 117 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,045 | 11.02.2027 | 3.472.700 | 127 | 0,02 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,205 | 03.03.2027 | 7.944.300 | (237) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,270 | 07.03.2027 | 4.639.800 | (121) | (0,02) |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,280 % | 07.03.2027 | CLP | 4.361.500 | $ (112) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,070 | 05.04.2024 | | 10.126.800 | (276) | (0,04) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,950 | 28.06.2024 | | 8.976.000 | 80 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 2,015 | 10.08.2026 | CZK | 415.000 | 1.229 | 0,16 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,081 | 15.02.2031 | € | 24.400 | (1.599) | (0,21) |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2027 | | 10.700 | (74) | (0,01) |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | | 29.700 | (1.323) | (0,17) |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2024 | | 61.000 | (390) | (0,05) |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2052 | | 6.500 | (1.282) | (0,16) |
| Erhalt | 6-Month HUF-BBR | 3,700 | 08.11.2026 | HUF | 4.540.400 | 1.035 | 0,13 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 2,983 | 08.11.2026 | PLN | 47.800 | 947 | 0,12 |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 4,135 | 08.02.2027 | | 26.800 | (426) | (0,05) |
| | | | | | | $ (1.118) | (0,14) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | | **$ (1.921)** | **(0,25)** |

(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

#### INFLATION-CAPPED OPTIONS

| Kontrahent | Beschreibung | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | Cap - OTC CPALEMU | $ 100,151 | Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0 | 22.06.2035 | 8.200 | $ (373) | $ (118) | (0,01) |
| 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 |
| | | | | | | $ (384) | $ (118) | (0,01) |

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 % | 17.11.2059 | $ 2.900 | $ (86) | $ 75 | $ (11) | 0,00 |
| MYC | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 12.200 | (403) | 359 | (44) | (0,01) |
| SAL | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 2.200 | (5) | (19) | (24) | 0,00 |
| UAG | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 5.100 | (148) | 130 | (18) | 0,00 |
| | | | | | $ (642) | $ 545 | $ (97) | (0,01) |

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

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

### ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 2,750 % | 15. Dezember 2026 | MYR | 6.350 | $ (16) | $ (49) | $ (65) | (0,01) |
| | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,000 | 16. März 2027 | | 85.400 | (106) | (613) | (719) | (0,09) |
| CBK | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,430 | 1. Juli 2029 | KRW | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,750 | 15. Juni 2027 | THB | 162.600 | (92) | (114) | (206) | (0,03) |
| MYC | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,000 | 15. September 2026 | | 631.800 | (155) | (1.022) | (1.177) | (0,15) |
| | | | | | | | $ (369) | $ (1.798) | $ (2.167) | (0,28) |

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nenn-betrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Zahlung | DWRTFT Index | 229 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 2.914 | 04.01.2023 | $ 0 | $ 229 | $ 229 | 0,03 |
| BPS | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 1,044 % | 100 | 20.09.2022 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 1,044 | 100 | 20.12.2022 | 0 | 2 | 2 | 0,00 |
| | Zahlung | DWRTFT Index | 623 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 7.902 | 15.02.2023 | 0 | 597 | 597 | 0,08 |
| JPM | Receive | NDUEACWF Index | 54.688 | 1-Month USD-LIBOR less a specified spread | 16.930 | 07.09.2022 | 0 | 98 | 98 | 0,01 |
| | Pay | NDUEACWF Index | 99.160 | 1-Month USD-LIBOR plus a specified spread | 33.627 | 07.09.2022 | 0 | 2.765 | 2.765 | 0,36 |
| | Zahlung | JPPMGSHP Index | 189.602 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | 16.918 | 07.06.2023 | 0 | 1.532 | 1.532 | 0,20 |
| MYI | Receive | NDUEEGF Index | 24.335 | 1-Month USD-LIBOR less a specified spread | 13.022 | 07.09.2022 | 0 | (838) | (838) | (0,11) |
| | Receive | NDUEEGF Index | 24.335 | 1-Month USD-LIBOR less a specified spread | 13.022 | 07.12.2022 | 0 | (839) | (839) | (0,11) |
| | Receive | NDUEEGF Index | 24.335 | 1-Month USD-LIBOR less a specified spread | 13.022 | 08.03.2023 | 0 | (840) | (840) | (0,11) |
| | Receive | NDUEEGF Index | 24.335 | 1-Month USD-LIBOR plus a specified spread | 13.022 | 07.06.2023 | 0 | (839) | (839) | (0,11) |
| SOG | Zahlung | DWRTFT Index | 1.843 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 23.454 | 24.08.2022 | 0 | 1.847 | 1.847 | 0,24 |
| | Zahlung | DWRTFT Index | 1.065 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 12.564 | 05.04.2023 | 0 | 79 | 79 | 0,01 |
| | | | | | | | $ 0 | $ 3.789 | $ 3.789 | 0,49 |

## TOTAL RETURN SWAPS AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nenn-betrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Zahlung | 3M Co. | 18.600 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | $ 2.424 | 28.06.2023 | $ 0 | $ 17 | $ 17 | 0,00 |
| | Zahlung | Allison Transmission, Inc. | 23.400 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | 905 | 28.06.2023 | 0 | 5 | 5 | 0,00 |
| | Zahlung | Fastenal Co. | 48.200 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | 2.370 | 28.06.2023 | 0 | (37) | (37) | (0,01) |
| | Zahlung | Illinois Tool Works, Inc. | 13.300 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | 2.434 | 28.06.2023 | 0 | 10 | 10 | 0,00 |
| | Zahlung | J.B. Hunt Transport, Inc. | 5.500 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | 867 | 28.06.2023 | 0 | 1 | 1 | 0,00 |
| | Zahlung | Knight-Swift Transportation Holdings, Inc. | 18.900 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | 873 | 28.06.2023 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Zahlung | Old Dominion Freight Line, Inc. | 3.400 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | 852 | 28.06.2023 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | Zahlung | W.W. Grainger, Inc. | 5.400 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | 2.433 | 28.06.2023 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | Zahlung | Watsco, Inc. | 10.400 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | 2.480 | 28.06.2023 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | | | | | | | $ 0 | $ (49) | $ (49) | (0,01) |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | $ | 731 | AUD | 1.051 | $ 0 | $ (8) | $ (8) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 1.051 | $ | 731 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | CHF | 1.109 | | 1.113 | 0 | (46) | (46) | (0,01) |
| | 07.2022 | CLP | 164.890 | | 191 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK | 13.320 | | 1.895 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 16.200 | | 20.483 | 809 | 0 | 809 | 0,10 |
| | 07.2022 | HUF | 119.204 | | 313 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 4.848.000 | | 39.845 | 4.161 | 0 | 4.161 | 0,53 |
| | 07.2022 | MXN | 603 | | 29 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.035 | AUD | 1.491 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.669 | CAD | 2.165 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.256 | CLP | 1.969.750 | 0 | (158) | (158) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 661 | DKK | 4.460 | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.223 | € | 1.156 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.507 | £ | 1.191 | 0 | (60) | (60) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 222 | HUF | 82.735 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 295 | SEK | 2.890 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 134 | ZAR | 2.063 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 1.491 | $ | 1.035 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN | 42.478 | | 10.782 | 0 | (358) | (358) | (0,05) |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08.2022 | $ | 1.895 | DKK | 13.293 | $ 0 | $ (22) | $ (22) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.139 | ZAR | 18.708 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 10.2022 | | 3.066 | COP | 12.355.980 | 0 | (151) | (151) | (0,02) |
| | 11.2022 | | 3.505 | ZAR | 56.220 | 0 | (117) | (117) | (0,01) |
| | 11.2022 | ZAR | 12.683 | $ | 799 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| | 12.2022 | PEN | 9.540 | | 2.498 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | AUD | 8.958 | | 6.177 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 07.2022 | CAD | 2.307 | | 1.784 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK | 3.210 | | 462 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 50.458 | | 53.055 | 304 | 0 | 304 | 0,04 |
| | 07.2022 | £ | 2.932 | | 3.592 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| | 07.2022 | HUF | 318.728 | | 833 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 247.200 | | 1.840 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 18.895 | | 940 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07.2022 | NOK | 3.590 | | 363 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 4.117 | AUD | 5.930 | 0 | (40) | (40) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 2.258 | BRL | 11.362 | 0 | (85) | (85) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 1.660 | CAD | 2.105 | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 3.175 | CHF | 3.043 | 5 | (1) | 4 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 245 | CZK | 5.782 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.634 | DKK | 11.670 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 8.338 | € | 7.824 | 0 | (159) | (159) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 1.011 | £ | 835 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 19.738 | ¥ | 2.662.000 | 0 | (143) | (143) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 100 | MXN | 2.090 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 72 | PLN | 321 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 9.208 | $ | 579 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 08.2022 | INR | 80.751 | | 1.036 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 08.2022 | MXN | 44.023 | | 2.192 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 08.2022 | THB | 18 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 48.831 | € | 46.341 | 0 | (294) | (294) | (0,04) |
| | 08.2022 | | 1.950 | ZAR | 31.597 | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| | 08.2022 | ZAR | 36.919 | $ | 2.312 | 68 | 0 | 68 | 0,01 |
| | 09.2022 | TWD | 6.183 | | 223 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 926 | MXN | 18.895 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 22.689 | $ | 1.417 | 50 | 0 | 50 | 0,01 |
| BRC | 07.2022 | CZK | 9.569 | | 407 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | NOK | 59.034 | | 6.022 | 47 | 0 | 47 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 152 | CZK | 3.582 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 28.787 | ¥ | 3.904.989 | 0 | (43) | (43) | (0,01) |
| | 08.2022 | ¥ | 7.198.647 | $ | 54.643 | 1.533 | 0 | 1.533 | 0,20 |
| | 08.2022 | $ | 466 | KRW | 582.766 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 6.022 | NOK | 59.008 | 0 | (46) | (46) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 175 | SGD | 242 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 404 | MYR | 1.775 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 10.2022 | | 3.066 | COP | 12.342.520 | 0 | (154) | (154) | (0,02) |
| | 11.2022 | ZAR | 6.328 | $ | 394 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | BRL | 1.361 | | 280 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 07.2022 | HUF | 88.201 | | 231 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | ILS | 579 | | 168 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 22.809 | | 1.125 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07.2022 | NZD | 1.409 | | 879 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.450 | AUD | 2.015 | 0 | (64) | (64) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 2.533 | ¥ | 337.500 | 0 | (49) | (49) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 1.127 | MXN | 22.905 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 2.822.849 | $ | 190 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | ILS | 9.135 | | 2.836 | 224 | 0 | 224 | 0,03 |
| | 08.2022 | INR | 45.920 | | 587 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 08.2022 | KRW | 1.250.896 | | 1.006 | 42 | 0 | 42 | 0,01 |
| | 08.2022 | PEN | 6.302 | | 1.665 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 1.233 | CLP | 1.085.513 | 0 | (82) | (82) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 1.270 | KRW | 1.592.963 | 0 | (42) | (42) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 1.523 | MXN | 31.720 | 39 | 0 | 39 | 0,01 |
| | 08.2022 | | 379 | PEN | 1.388 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 302 | THB | 10.563 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 248 | TWD | 7.346 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | COP | 22.230.926 | $ | 5.765 | 488 | 0 | 488 | 0,06 |
| | 10.2022 | | 22.531.234 | | 5.643 | 326 | 0 | 326 | 0,04 |
| | 10.2022 | ILS | 200 | | 64 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 11.2022 | | 1.316 | | 417 | 38 | 0 | 38 | 0,01 |
| | 11.2022 | $ | 7.002 | PEN | 27.791 | 223 | 0 | 223 | 0,03 |
| | 11.2022 | | 512 | ZAR | 8.272 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 34.513 | $ | 2.294 | 214 | 0 | 214 | 0,03 |
| | 12.2022 | ILS | 10.799 | | 3.439 | 321 | 0 | 321 | 0,04 |
| | 12.2022 | PEN | 4.296 | | 1.118 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 01.2023 | ILS | 17.896 | | 5.668 | 489 | 0 | 489 | 0,06 |
| DUB | 07.2022 | PLN | 118 | | 27 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 180 | DKK | 1.217 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 5.245 | $ | 177 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 325 | THB | 11.279 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 12.2022 | ILS | 600 | $ | 189 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 12.2022 | $ | 181 | ZAR | 2.849 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | BRL | 46.981 | $ | 9.097 | 113 | 0 | 113 | 0,02 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07.2022 | CLP | 2.047.623 | $ | 2.371 | $ 190 | $ 0 | $ 190 | 0,02 |
| | 07.2022 | HUF | 76.955 | | 213 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 53.877 | | 2.638 | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| | 07.2022 | PLN | 666 | | 147 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 6.957 | BRL | 35.012 | 0 | (262) | (262) | (0,03) |
| | 07.2022 | | 4.730 | CLP | 4.117.574 | 0 | (344) | (344) | (0,04) |
| | 07.2022 | | 3.621 | MXN | 73.529 | 55 | (34) | 21 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.948 | ZAR | 31.170 | 0 | (49) | (49) | (0,01) |
| | 07.2022 | ZAR | 53.300 | $ | 3.316 | 67 | 0 | 67 | 0,01 |
| | 08.2022 | INR | 32.835 | | 421 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 8.595 | BRL | 44.902 | 0 | (82) | (82) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 998 | INR | 78.008 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 256 | PEN | 968 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | ZAR | 23.276 | $ | 1.500 | 85 | 0 | 85 | 0,01 |
| | 09.2022 | TWD | 33.390 | | 1.137 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 2.195 | HKD | 17.186 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10.2022 | | 6.108 | MXN | 125.029 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 11.2022 | COP | 4.295.558 | $ | 1.011 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 13.430 | | 837 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| IND | 08.2022 | $ | 221 | ZAR | 3.583 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | CZK | 4.371 | $ | 186 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 30.769 | | 1.514 | 1 | (9) | (8) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 9.071 | CLP | 7.893.706 | 0 | (664) | (664) | (0,08) |
| | 07.2022 | | 124 | CZK | 2.941 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.297 | ILS | 7.938 | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 5.406 | $ | 804 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 61.123 | | 2.075 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 252 | KRW | 320.820 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 5.465 | PEN | 20.787 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.415 | SGD | 1.945 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 09.2022 | TWD | 7.321 | $ | 263 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 11.2022 | $ | 876 | ZAR | 14.290 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 12.2022 | ILS | 400 | $ | 130 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | AUD | 26.231 | | 18.077 | 39 | 0 | 39 | 0,01 |
| | 07.2022 | BRL | 11.331 | | 2.258 | 91 | 0 | 91 | 0,01 |
| | 07.2022 | CAD | 971 | | 756 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 3.515 | | 3.658 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 665 | € | 630 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 95 | HUF | 36.284 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.145 | SEK | 20.945 | 0 | (101) | (101) | (0,01) |
| | 08.2022 | CLP | 3.154.520 | $ | 3.765 | 421 | 0 | 421 | 0,05 |
| | 08.2022 | CNH | 12.298 | | 1.831 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | INR | 81.508 | | 1.039 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 23.864 | | 814 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 15.944 | AUD | 23.147 | 0 | (23) | (23) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 410 | KRW | 527.354 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 733 | TWD | 21.368 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 09.2022 | ¥ | 2.910.824 | $ | 22.040 | 499 | 0 | 499 | 0,06 |
| | 09.2022 | $ | 1.106 | MXN | 22.544 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 10.2022 | | 807 | ZAR | 13.175 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 10.2022 | ZAR | 17.423 | $ | 1.167 | 114 | 0 | 114 | 0,02 |
| | 11.2022 | $ | 619 | ZAR | 10.013 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 05.2023 | | 727 | CNH | 4.877 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | CLP | 2.261.219 | $ | 2.506 | 98 | 0 | 98 | 0,01 |
| | 07.2022 | CZK | 14.152 | | 598 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK | 2.796 | | 397 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07.2022 | NOK | 22.170 | | 2.226 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 293 | DKK | 1.981 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 297 | € | 283 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 4.769 | £ | 3.947 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 5.760 | ¥ | 784.283 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 113 | ZAR | 1.817 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | CNY | 96.194 | $ | 14.328 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 08.2022 | INR | 157.088 | | 2.011 | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 783.013 | | 5.760 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 08.2022 | KRW | 1.067.031 | | 838 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 49.166 | | 1.683 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 397 | DKK | 2.790 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 799 | THB | 27.515 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 671 | TWD | 19.578 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 09.2022 | CLP | 2.060.955 | $ | 2.355 | 187 | 0 | 187 | 0,02 |
| | 09.2022 | $ | 74 | TWD | 2.052 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 10.2022 | COP | 9.095.583 | $ | 2.286 | 140 | 0 | 140 | 0,02 |
| RBC | 07.2022 | CLP | 819.928 | | 984 | 111 | 0 | 111 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 1.406 | CAD | 1.806 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 09.2022 | HKD | 2.235 | $ | 285 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | MXN | 4.693 | | 228 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | SEK | 2.850 | | 281 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 705 | CLP | 614.329 | 0 | (51) | (51) | (0,01) |
| SCX | 07.2022 | £ | 931 | $ | 1.143 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 07.2022 | NOK | 15.805 | | 1.592 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2.406 | BRL | 12.364 | 0 | (42) | (42) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 423 | ILS | 1.428 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07.2022 | $ | 4.478 | ¥ | 609.587 | $ 9 | $ 0 | $ 9 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 262 | NOK | 2.485 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.499 | SEK | 24.375 | 0 | (120) | (120) | (0,01) |
| | 08.2022 | CNH | 21.815 | $ | 3.257 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNY | 153.976 | | 23.007 | 49 | 0 | 49 | 0,01 |
| | 08.2022 | INR | 12.374 | | 158 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 608.599 | | 4.478 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 57.888 | | 1.971 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 519 | INR | 40.646 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 08.2022 | ZAR | 16.969 | $ | 1.102 | 70 | 0 | 70 | 0,01 |
| | 09.2022 | $ | 2.406 | CLP | 2.117.868 | 0 | (178) | (178) | (0,02) |
| | 09.2022 | | 1.787 | COP | 7.180.155 | 0 | (85) | (85) | (0,01) |
| | 09.2022 | | 168 | ZAR | 2.598 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 10.2022 | | 263 | | 4.248 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 11.2022 | COP | 78.098.219 | $ | 18.375 | 44 | 0 | 44 | 0,01 |
| | 11.2022 | $ | 1.992 | ZAR | 31.983 | 0 | (65) | (65) | (0,01) |
| | 11.2022 | ZAR | 35.316 | $ | 2.346 | 218 | 0 | 218 | 0,03 |
| SOG | 07.2022 | $ | 47.682 | € | 44.363 | 0 | (1.303) | (1.303) | (0,17) |
| | 07.2022 | | 17.190 | £ | 14.125 | 0 | (36) | (36) | 0,00 |
| | 08.2022 | £ | 14.125 | $ | 17.198 | 36 | 0 | 36 | 0,01 |
| SSB | 08.2022 | KRW | 1.281.061 | | 1.006 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN | 711 | | 189 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 28.146 | | 972 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 345 | KRW | 435.404 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 460 | TWD | 13.515 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 435 | MYR | 1.908 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 10.2022 | | 2.177 | COP | 8.381.254 | 0 | (199) | (199) | (0,03) |
| TOR | 07.2022 | AUD | 756 | $ | 527 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 196 | BRL | 934 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 12.822 | CAD | 16.405 | 0 | (105) | (105) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 88 | HUF | 31.806 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 08.2022 | KRW | 199.085 | $ | 158 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 09.2022 | ZAR | 2.598 | | 161 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 11.2022 | $ | 132 | ZAR | 2.111 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 12.2022 | ZAR | 2.849 | $ | 175 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | ¥ | 3.530.000 | | 28.792 | 2.809 | 0 | 2.809 | 0,36 |
| | 07.2022 | $ | 17.797 | AUD | 24.916 | 0 | (664) | (664) | (0,08) |
| | 07.2022 | | 123 | CZK | 2.909 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 823 | HUF | 288.532 | 0 | (65) | (65) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 10.407 | NOK | 98.133 | 0 | (474) | (474) | (0,06) |
| | 07.2022 | | 10.747 | ZAR | 172.914 | 0 | (210) | (210) | (0,03) |
| | 08.2022 | | 23 | PHP | 1.228 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 261 | ZAR | 4.194 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 09.2022 | MXN | 261.730 | $ | 13.085 | 268 | 0 | 268 | 0,03 |
| | 09.2022 | $ | 796 | HKD | 6.233 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10.2022 | MXN | 48.763 | $ | 2.384 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 29.692 | | 1.892 | 103 | 0 | 103 | 0,01 |
| | | | | | | $ 15.950 | $ (7.981) | $ 7.969 | 1,02 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | HKD | 84.238 | $ | 10.744 | $ 9 | $ 0 | $ 9 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2.407 | AUD | 3.463 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 3.463 | $ | 2.408 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | CHF | 9.248 | | 9.678 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 31 | | 33 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 10.643 | | 13.456 | 531 | 0 | 531 | 0,07 |
| | 07.2022 | HUF | 54.850 | | 150 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07.2022 | INR | 451.779 | | 5.803 | 85 | 0 | 85 | 0,01 |
| | 07.2022 | SGD | 1 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 4.105 | AUD | 5.914 | 0 | (39) | (39) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 1.750 | DKK | 12.304 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 5.005 | € | 4.663 | 0 | (131) | (131) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 671 | INR | 52.296 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 24 | SGD | 34 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 5.914 | $ | 4.106 | 39 | 0 | 39 | 0,01 |
| | 08.2022 | DKK | 12.279 | | 1.750 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| | 08.2022 | SGD | 34 | | 24 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | DKK | 14.888 | | 2.111 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 196.235 | | 206.601 | 1.448 | 0 | 1.448 | 0,19 |
| | 07.2022 | ¥ | 379 | | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 769 | CHF | 738 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.864 | CNY | 12.498 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 11 | € | 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 949 | IDR | 14.105.160 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07.2022 | $ | 235 | ILS | 809 | $ 0 | $ (4) | $ (4) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.225 | MXN | 24.778 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 0 | $ | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNY | 12.504 | | 1.864 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 14.112.913 | | 949 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08.2022 | ILS | 807 | | 234 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | MXN | 24.778 | | 1.218 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 186.796 | € | 177.273 | 0 | (1.123) | (1.123) | (0,14) |
| BRC | 07.2022 | ILS | 808 | $ | 244 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 12.325 | ¥ | 1.671.861 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 1.669.146 | $ | 12.325 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | CZK | 3.098 | | 134 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | IDR | 14.073.261 | | 967 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | 07.2022 | KRW | 6.837.356 | | 5.529 | 262 | 0 | 262 | 0,03 |
| | 07.2022 | MXN | 24.778 | | 1.241 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 07.2022 | TWD | 176.421 | | 6.052 | 120 | 0 | 120 | 0,02 |
| | 07.2022 | $ | 5.657 | € | 5.269 | 0 | (149) | (149) | (0,02) |
| | 07.2022 | ZAR | 26.587 | $ | 1.710 | 87 | 0 | 87 | 0,01 |
| DUB | 07.2022 | $ | 8.906 | CHF | 8.460 | 0 | (70) | (70) | (0,01) |
| | 08.2022 | CHF | 8.446 | $ | 8.906 | 69 | 0 | 69 | 0,01 |
| GLM | 07.2022 | BRL | 11.861 | | 2.354 | 86 | 0 | 86 | 0,01 |
| | 07.2022 | CLP | 144.422 | | 173 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 07.2022 | IDR | 20.569 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | MYR | 3.191 | | 726 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 163 | CLP | 144.422 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 0 | CZK | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 3 | INR | 266 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 726 | MYR | 3.191 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 284 | PLN | 1.267 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 790 | SGD | 1.097 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 119 | $ | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CLP | 144.422 | | 162 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 08.2022 | MYR | 3.191 | | 726 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | PLN | 1.272 | | 284 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | SGD | 1.097 | | 790 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | CNY | 149 | | 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 48 | AUD | 69 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 554 | PHP | 30.502 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 69 | $ | 48 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | PHP | 30.502 | | 553 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | CAD | 1.238 | | 981 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 177.526 | | 186.755 | 1.163 | (1) | 1.162 | 0,15 |
| | 07.2022 | NOK | 4.569 | | 488 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| | 07.2022 | NZD | 402 | | 263 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 07.2022 | PHP | 30.502 | | 582 | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| | 07.2022 | PLN | 1.268 | | 296 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 07.2022 | SEK | 34.581 | | 3.542 | 167 | 0 | 167 | 0,02 |
| | 07.2022 | $ | 206.828 | € | 191.865 | 0 | (6.244) | (6.244) | (0,80) |
| | 07.2022 | | 4.932 | INR | 389.513 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | INR | 390.420 | $ | 4.932 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 186.831 | € | 177.273 | 0 | (1.158) | (1.158) | (0,15) |
| MYI | 07.2022 | SGD | 0 | $ | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2.307 | BRL | 11.861 | 0 | (39) | (39) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 367 | DKK | 2.582 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.466 | ¥ | 335.779 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08.2022 | BRL | 11.861 | $ | 2.288 | 40 | 0 | 40 | 0,01 |
| | 08.2022 | DKK | 2.577 | | 367 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 335.235 | | 2.466 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| RBC | 08.2022 | HKD | 84.175 | | 10.736 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | $ | 5.936 | TWD | 176.421 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 176.421 | $ | 5.950 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | CNY | 12.582 | | 1.886 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | KRW | 14.721 | | 12 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | SGD | 1.107 | | 810 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 362 | AUD | 526 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 5.111 | KRW | 6.631.247 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.655 | ZAR | 26.639 | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 526 | $ | 362 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | KRW | 6.628.488 | | 5.111 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | ZAR | 26.717 | | 1.655 | 29 | 0 | 29 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | $ | 197.718 | € | 183.956 | 0 | (5.402) | (5.402) | (0,69) |
| TOR | 07.2022 | CAD | 13.516 | $ | 10.582 | 104 | 0 | 104 | 0,01 |
| | 07.2022 | ¥ | 2.408.178 | | 18.973 | 1.248 | 0 | 1.248 | 0,16 |
| | 07.2022 | $ | 92 | AUD | 134 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 7.360 | CAD | 9.468 | 1 | (21) | (20) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 134 | $ | 92 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 9.469 | | 7.360 | 21 | (1) | 20 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | AUD | 10.160 | | 7.257 | 271 | 0 | 271 | 0,04 |
| | 07.2022 | HKD | 5 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | HUF | 4 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | SGD | 60 | | 44 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | THB | 30.499 | | 894 | 31 | 0 | 31 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 132 | CZK | 3.094 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07.2022 | $ | 150.996 | € | 140.514 | $ 0 | $ (4.097) | $ (4.097) | (0,52) |
| | 07.2022 | | 146 | HUF | 54.805 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1 | PLN | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 868 | THB | 30.499 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 08.2022 | CZK | 3.105 | $ | 132 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | HUF | 55.062 | | 146 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | THB | 30.499 | | 869 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | | | | | | $ 6.180 | $ (18.631) | $ (12.451) | (1,60) |

Zum 30. Juni 2022 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | HKD | 700 | $ | 89 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 20 | AUD | 28 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 28 | $ | 20 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | HUF | 664 | | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | INR | 3.628 | | 47 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | SGD | 0 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 33 | AUD | 48 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.668 | £ | 1.320 | 0 | (65) | (65) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 0 | SGD | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 48 | $ | 33 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | SGD | 0 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CHF | 0 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK | 136 | | 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 88 | | 109 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 636 | | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 6 | CHF | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 19 | CNY | 127 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 225 | € | 213 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 28 | £ | 22 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 6 | IDR | 86.241 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 4 | ILS | 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 9 | ¥ | 1.170 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 8 | MXN | 171 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNY | 127 | $ | 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 204 | | 215 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 86.288 | | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | ILS | 12 | | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | MXN | 171 | | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | £ | 4 | | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | ILS | 12 | | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.528 | £ | 1.212 | 0 | (57) | (57) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 100 | ¥ | 13.523 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 13.501 | $ | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | CHF | 73 | | 76 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | CZK | 38 | | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | IDR | 86.039 | | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | KRW | 52.730 | | 43 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 171 | | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | TWD | 1.466 | | 50 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 5 | INR | 428 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 267 | $ | 17 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | $ | 71 | CHF | 67 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | CHF | 67 | $ | 71 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | BRL | 88 | | 18 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | CLP | 2.256 | | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | MYR | 40 | | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 3 | CLP | 2.256 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 0 | INR | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 9 | MYR | 40 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 3 | PLN | 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 8 | SGD | 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 1 | $ | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CLP | 2.256 | | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | MYR | 40 | | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | PLN | 15 | | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | SGD | 11 | | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | CNY | 2 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 0 | AUD | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 0 | CZK | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 7 | PHP | 397 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 1 | $ | 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | PHP | 397 | | 7 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MBC | 07.2022 | CAD | 10 | | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | NOK | 55 | | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | NZD | 5 | | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | PHP | 397 | | 8 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | PLN | 15 | | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | SEK | 267 | | 27 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 40 | INR | 3.120 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | INR | 3.128 | $ | 40 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | $ | 17 | BRL | 88 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 7 | DKK | 49 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | BRL | 88 | $ | 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 48 | | 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RBC | 08.2022 | HKD | 700 | | 89 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | $ | 49 | TWD | 1.466 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 1.466 | $ | 49 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | CNY | 128 | | 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | SGD | 11 | | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 3 | AUD | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 39 | KRW | 51.138 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 17 | ZAR | 268 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 4 | $ | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | KRW | 51.116 | | 39 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | ZAR | 269 | | 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | € | 213 | | 229 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 1.207 | | 1.468 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | IDR | 117 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | KRW | 109 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 12 | DKK | 88 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 88 | $ | 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 1.469 | £ | 1.207 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | CAD | 112 | $ | 88 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 20.017 | | 158 | 11 | 0 | 11 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 1 | AUD | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 61 | CAD | 79 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.576 | £ | 1.250 | 0 | (58) | (58) | (0,01) |
| | 08.2022 | AUD | 1 | $ | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 79 | | 61 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | AUD | 83 | | 59 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | HKD | 0 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | HUF | 0 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | SGD | 1 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | THB | 303 | | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2 | CZK | 38 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2 | HUF | 663 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 0 | PLN | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 9 | THB | 303 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CZK | 38 | $ | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | HUF | 666 | | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | THB | 303 | | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 36 | $ (186) | $ (150) | (0,02) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **$ (3.274)** | **(0,42)** |

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.07.2052 | $ 19.400 | $ (16.842) | (2,16) |
| 2,500 % fällig am 14.07.2052 (i) | 32.600 | (29.327) | (3,76) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (46.169)** | **(5,92)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 788.048** | **101,12** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (8.756)** | **(1,12)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 779.292** | **100,00** |

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

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

**^** **Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a)** **Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

**(b)** **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

**(c)** **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

**(d)** **Nullkuponwertpapier.**

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

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

**(g)** **Mit dem Fonds verbunden.**

**(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(i) Zum 30. Juni 2022 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.**

**Barmittel in Höhe von USD 40.428 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 14.180 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 138.727 | $ 416.624 | $ 1.692 | $ 557.043 |
| Investmentfonds | 156.334 | 100.155 | 0 | 256.489 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 36.319 | 0 | 36.319 |
| Finanzderivate[3] | (10.185) | (5.449) | 0 | (15.634) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (46.169) | 0 | (46.169) |
| **Summen** | **$ 284.876** | **$ 501.480** | **$ 1.692** | **$ 788.048** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 124.910 | $ 450.226 | $ 648 | $ 575.784 |
| Investmentfonds | 388.149 | 0 | 0 | 388.149 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 511 | 0 | 511 |
| Finanzderivate[3] | 11.497 | 8.311 | 0 | 19.808 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (84.769) | 0 | (84.769) |
| **Summen** | **$ 524.556** | **$ 374.279** | **$ 648** | **$ 899.483** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ 9 | $ 0 | $ 9 |
| BOA | 3.917 | (4.050) | (133) |
| BPS | 749 | (1.860) | (1.111) |
| BRC | 1.288 | (1.250) | 38 |
| CBK | 2.560 | (2.059) | 501 |
| DUB | (8) | 0 | (8) |
| GLM | (487) | 200 | (287) |
| GST | (11) | 0 | (11) |
| IND | (3) | 0 | (3) |
| JPM | 3.686 | (3.520) | 166 |
| MBC | (4.970) | 4.310 | (660) |
| MYC | (1.221) | 1.275 | 54 |
| MYI | (2.921) | 2.340 | (581) |
| RBC | 103 | 0 | 103 |
| RYL | (42) | 0 | (42) |
| SAL | (24) | 0 | (24) |
| SCX | (106) | 240 | 134 |
| SOG | (4.773) | 4.180 | (593) |
| SSB | (171) | 0 | (171) |
| TOR | 1.193 | (1.230) | (37) |
| UAG | (2.042) | 1.450 | (592) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 32,50 | 33,48 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 37,02 | 21,09 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 1,96 | 1,06 |
| Investmentfonds | 32,91 | 37,50 |
| Pensionsgeschäfte | 4,66 | 0,05 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (1,34) | 1,11 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,25) | 0,07 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (0,42) | 0,73 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (5,92) | (8,19) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 0,47 | 0,39 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 5,22 | 8,14 |
| Wandelanleihen & Wechsel | 0,15 | 0,11 |
| US-Regierungsbehörden | 12,58 | 1,05 |
| US-Schatzobligationen | 0,53 | 0,50 |
| Non-Agency-MBS | 1,81 | 1,11 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 7,92 | 4,81 |
| Staatsemissionen | 9,31 | 12,31 |
| Stammaktien | 12,27 | 8,25 |
| Vorzugswertpapiere | 0,19 | 0,20 |
| Real Estate Investment Trusts | 5,94 | 5,92 |
| Kurzfristige Instrumente | 15,09 | 12,84 |
| Investmentfonds | 32,91 | 37,50 |
| Pensionsgeschäfte | 4,66 | 0,05 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (1,34) | 1,11 |
| 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 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,10) | 0,01 |
| Zinsswaps | (0,14) | 0,06 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Devisenoptionen | k. A. | 0,00 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Devisenoptionen | k. A. | 0,00 |
| Inflation-Capped Options | (0,01) | (0,01) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,01) | 0,02 |
| Zinsswaps | (0,28) | (0,02) |
| Total Return Swaps auf Indizes | 0,49 | 0,01 |
| Total Return Swaps auf Wertpapiere | (0,01) | (0,03) |
| Devisenterminkontrakte | 1,02 | 0,24 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (1,62) | 0,52 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (5,92) | (8,19) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (1,12) | 13,10 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global High Yield Bond Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **BELGIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Ontex Group NV** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.07.2026 | € | 10.000 | $ | 8.371 | 0,24 |
| **BERMUDA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **NCL Corp. Ltd.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.03.2026 | $ | 2.850 | | 2.245 | 0,06 |
| 5,875 % fällig am 15.02.2027 | | 1.875 | | 1.607 | 0,04 |
| **Viking Cruises Ltd.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.09.2027 | | 5.000 | | 3.742 | 0,11 |
| 13,000 % fällig am 15.05.2025 | | 3.750 | | 3.848 | 0,11 |
| **VOC Escrow Ltd.** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.02.2028 | | 3.500 | | 2.817 | 0,08 |
| Summe Bermuda | | | | 14.259 | 0,40 |
| **KANADA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Air Canada** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.08.2026 | | 3.250 | | 2.756 | 0,08 |
| 4,625 % fällig am 15.08.2029 | CAD | 3.000 | | 1.982 | 0,06 |
| **B.C. Unlimited Liability Co.** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.02.2029 | $ | 4.000 | | 3.393 | 0,10 |
| 4,000 % fällig am 15.10.2030 | | 15.000 | | 12.086 | 0,34 |
| 4,375 % fällig am 15.01.2028 | | 3.250 | | 2.847 | 0,08 |
| **Bausch Health Cos., Inc.** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.06.2028 | | 3.500 | | 2.746 | 0,08 |
| 5,000 % fällig am 30.01.2028 | | 2.500 | | 1.338 | 0,04 |
| 5,250 % fällig am 30.01.2030 | | 7.000 | | 3.637 | 0,10 |
| 5,250 % fällig am 15.02.2031 | | 2.000 | | 1.029 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 01.11.2025 | | 5.000 | | 4.400 | 0,13 |
| 5,750 % fällig am 15.08.2027 | | 2.500 | | 2.075 | 0,06 |
| 6,250 % fällig am 15.02.2029 | | 8.000 | | 4.280 | 0,12 |
| 7,000 % fällig am 15.01.2028 | | 2.000 | | 1.147 | 0,03 |
| 7,250 % fällig am 30.05.2029 | | 5.000 | | 2.720 | 0,08 |
| **Bombardier, Inc.** | | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.06.2026 | | 4.250 | | 3.518 | 0,10 |
| 7,500 % fällig am 15.03.2025 | | 2.901 | | 2.630 | 0,08 |
| 7,875 % fällig am 15.04.2027 | | 3.000 | | 2.505 | 0,07 |
| **Garda World Security Corp.** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.06.2029 | | 2.000 | | 1.541 | 0,04 |
| **GFL Environmental, Inc.** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.09.2028 | | 5.000 | | 4.295 | 0,12 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2028 | | 4.000 | | 3.306 | 0,09 |
| 4,250 % fällig am 01.06.2025 | | 2.000 | | 1.891 | 0,05 |
| **MEG Energy Corp.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.02.2029 | | 2.575 | | 2.356 | 0,07 |
| 7,125 % fällig am 01.02.2027 | | 5.000 | | 5.047 | 0,14 |
| **Strathcona Resources Ltd.** | | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.08.2026 | | 5.875 | | 5.354 | 0,15 |
| Summe Kanada | | | | 78.879 | 2,24 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Diamond Foreign Asset Co. (9,000 % bar oder 9,000 % PIK)** | | | | | |
| 9,000 % fällig am 22.04.2027 (a)(h) | | 66 | | 65 | 0,00 |
| 9,000 % fällig am 22.04.2027 (a) | | 18 | | 17 | 0,00 |
| **Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd.** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 20.01.2026 | | 2.750 | | 2.471 | 0,07 |
| **Noble Finance Co. (11,000 % bar oder 15,000 % PIK)** | | | | | |
| 11,000 % fällig am 15.02.2028 (a) | | 976 | | 1.068 | 0,03 |
| **Transocean Poseidon Ltd.** | | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.02.2027 | | 1.875 | | 1.653 | 0,05 |
| **Transocean Proteus Ltd.** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 01.12.2024 | | 1.800 | | 1.681 | 0,05 |
| **UPCB Finance Ltd.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.06.2029 | € | 12.500 | | 10.822 | 0,31 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.12.2029 | $ | 2.500 | | 1.556 | 0,04 |
| 5,500 % fällig am 01.10.2027 | | 5.000 | | 3.243 | 0,09 |
| Summe Cayman Inseln | | | | 22.576 | 0,64 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **FRANKREICH** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Accor S.A.** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 29.11.2028 | € | 5.000 | $ | 4.165 | 0,12 |
| **Altice France S.A.** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.01.2028 | | 10.000 | | 7.858 | 0,22 |
| 4,000 % fällig am 15.07.2029 | | 5.150 | | 3.955 | 0,11 |
| 4,125 % fällig am 15.01.2029 | | 4.000 | | 3.173 | 0,09 |
| 4,250 % fällig am 15.10.2029 | | 2.000 | | 1.567 | 0,05 |
| 5,125 % fällig am 15.07.2029 | $ | 2.000 | | 1.516 | 0,04 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2028 | | 10.000 | | 8.086 | 0,23 |
| 5,500 % fällig am 15.10.2029 | | 5.000 | | 3.835 | 0,11 |
| **Banijay Entertainment SASU** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.03.2025 | € | 2.750 | | 2.574 | 0,07 |
| 5,375 % fällig am 01.03.2025 | $ | 5.000 | | 4.707 | 0,13 |
| **Banijay Group S.A.S.** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.03.2026 | € | 2.500 | | 2.194 | 0,06 |
| **CAB SELAS** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 01.02.2028 | | 12.000 | | 10.121 | 0,29 |
| **Chrome Bidco SASU** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 31.05.2028 | | 3.400 | | 2.925 | 0,08 |
| **Chrome Holdco SASU** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 31.05.2029 | | 3.850 | | 3.059 | 0,09 |
| **Elior Group S.A.** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.07.2026 | | 4.400 | | 3.595 | 0,10 |
| **Rexel S.A.** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.12.2028 | | 7.000 | | 5.690 | 0,16 |
| **Verallia S.A.** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 10.11.2031 | | 7.000 | | 5.477 | 0,16 |
| Summe Frankreich | | | | 74.497 | 2,11 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Cheplapharm Arzneimittel GmbH** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 11.02.2027 | | 10.000 | | 8.941 | 0,25 |
| 4,375 % fällig am 15.01.2028 | | 7.000 | | 6.252 | 0,18 |
| **Ctec GmbH** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.02.2030 | | 12.000 | | 9.141 | 0,26 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | | |
| 3,729 % fällig am 14.01.2032 (h) | $ | 7.000 | | 5.269 | 0,15 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK)** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2025 (a) | € | 2.750 | | 2.514 | 0,07 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.09.2026 (a) | | 3.000 | | 2.609 | 0,08 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK)** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.05.2027 (a) | | 2.000 | | 1.636 | 0,05 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (4,750 % bar oder 5,500 % PIK)** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.09.2026 (a) | $ | 6.000 | | 5.165 | 0,15 |
| **Nidda BondCo GmbH** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 30.09.2025 | € | 20.000 | | 16.973 | 0,48 |
| **Nidda Healthcare Holding GmbH** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 30.09.2024 | | 25.000 | | 23.209 | 0,66 |
| **Schenck Process Holding GmbH** | | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.06.2023 | | 5.000 | | 5.049 | 0,14 |
| **Techem Verwaltungsgesellschaft mbH** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 15.07.2025 | | 15.000 | | 13.796 | 0,39 |
| **TK Elevator Midco GmbH** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.07.2027 | | 7.000 | | 6.341 | 0,18 |
| **WEPA Hygieneprodukte GmbH** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.12.2027 (i) | | 15.000 | | 12.056 | 0,34 |
| **ZF Finance GmbH** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 03.05.2028 | | 5.000 | | 3.854 | 0,11 |
| 3,750 % fällig am 21.09.2028 | | 4.000 | | 3.298 | 0,09 |
| Summe Deutschland | | | | 126.103 | 3,58 |
| **IRLAND** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Jazz Securities DAC** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.01.2029 | $ | 4.000 | | 3.566 | 0,10 |
| **Motion Bondco DAC** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.11.2027 | € | 3.000 | | 2.433 | 0,07 |
| 6,625 % fällig am 15.11.2027 | $ | 5.000 | | 3.965 | 0,11 |
| Summe Irland | | | | 9.964 | 0,28 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **ITALIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Atlantia SpA** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 03.02.2025 | € | 2.000 | $ | 1.912 | 0,05 |
| 1,875 % fällig am 13.07.2027 | | 12.500 | | 10.661 | 0,30 |
| 1,875 % fällig am 12.02.2028 | | 12.500 | | 10.207 | 0,29 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | | |
| 5,375 % fällig am 18.01.2028 | | 9.950 | | 6.182 | 0,18 |
| 8,000 % fällig am 22.01.2030 | | 5.000 | | 3.348 | 0,09 |
| 10,500 % fällig am 23.07.2029 | | 5.800 | | 4.242 | 0,12 |
| **FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.08.2027 | | 5.800 | | 5.157 | 0,15 |
| **IMA Industria Macchine Automatiche SpA** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.01.2028 | | 7.500 | | 6.313 | 0,18 |
| **Inter Media and Communication SpA** | | | | | |
| 6,750 % fällig am 09.02.2027 | | 6.000 | | 5.614 | 0,16 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | | |
| 4,198 % fällig am 01.06.2032 | $ | 1.000 | | 733 | 0,02 |
| 4,950 % fällig am 01.06.2042 | | 2.000 | | 1.354 | 0,04 |
| 5,710 % fällig am 15.01.2026 | | 5.000 | | 4.771 | 0,14 |
| 5,875 % fällig am 01.09.2031 (e)(g) | € | 5.000 | | 4.086 | 0,12 |
| 6,250 % fällig am 16.05.2024 (e)(g) | | 5.500 | | 5.484 | 0,16 |
| 7,700 % fällig am 17.09.2025 (e)(g) | $ | 7.000 | | 6.323 | 0,18 |
| 7,750 % fällig am 11.01.2027 (e)(g) | € | 4.000 | | 3.980 | 0,11 |
| **Nexi SpA** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.04.2026 | | 8.000 | | 6.831 | 0,19 |
| 1,750 % fällig am 31.10.2024 | | 10.000 | | 9.678 | 0,27 |
| 2,125 % fällig am 30.04.2029 | | 12.000 | | 8.797 | 0,25 |
| **Shiba BidCo SpA** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 31.10.2028 | | 5.000 | | 4.324 | 0,12 |
| **Telecom Italia SpA** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 18.01.2029 | | 5.000 | | 3.814 | 0,11 |
| 5,303 % fällig am 30.05.2024 | $ | 3.000 | | 2.890 | 0,08 |
| **UniCredit SpA** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 03.06.2027 (e)(g) | € | 5.000 | | 3.758 | 0,11 |
| 5,459 % fällig am 30.06.2035 | $ | 14.000 | | 11.326 | 0,32 |
| Summe Italien | | | | 131.785 | 3,74 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Adient Global Holdings Ltd.** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.08.2024 | € | 5.000 | | 4.741 | 0,13 |
| 4,875 % fällig am 15.08.2026 | $ | 4.000 | | 3.517 | 0,10 |
| Summe Jersey, Kanalinseln | | | | 8.258 | 0,23 |
| **LIBERIA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Royal Caribbean Cruises Ltd.** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.04.2028 | | 5.000 | | 3.487 | 0,10 |
| 9,125 % fällig am 15.06.2023 | | 3.000 | | 2.974 | 0,09 |
| 11,500 % fällig am 01.06.2025 | | 1.491 | | 1.536 | 0,04 |
| Summe Liberia | | | | 7.997 | 0,23 |
| **LUXEMBURG** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Albion Financing SARL** | | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.10.2026 | | 6.125 | | 5.253 | 0,15 |
| **Altice Financing S.A.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.01.2028 | € | 10.000 | | 7.835 | 0,22 |
| 4,250 % fällig am 15.08.2029 | | 1.750 | | 1.386 | 0,04 |
| 5,750 % fällig am 15.08.2029 | $ | 8.500 | | 6.845 | 0,19 |
| **Altice France Holding S.A.** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.02.2028 | € | 5.000 | | 3.566 | 0,10 |
| 6,000 % fällig am 15.02.2028 | $ | 4.000 | | 2.847 | 0,08 |
| **Aramark International Finance SARL** | | | | | |
| 3,125 % fällig am 01.04.2025 | € | 5.000 | | 4.699 | 0,13 |
| **Camelot Finance S.A.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.11.2026 (i) | $ | 5.000 | | 4.568 | 0,13 |
| **Cirsa Finance International SARL** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2027 | € | 5.000 | | 4.247 | 0,12 |
| 4,750 % fällig am 22.05.2025 | | 3.000 | | 2.784 | 0,08 |
| 6,250 % fällig am 20.12.2023 | | 4.246 | | 4.245 | 0,12 |
| **FAGE International S.A.** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.08.2026 | $ | 2.223 | | 1.898 | 0,05 |
| **Herens Holdco SARL** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.05.2028 | | 7.000 | | 5.826 | 0,17 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Herens Midco SARL** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.05.2029 | € | 15.000 | $ | 10.368 | 0,30 |
| **InPost S.A.** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.07.2027 | | 2.925 | | 2.405 | 0,07 |
| **LHMC Finco 2 SARL (7,250 % bar oder 8,000 % PIK)** | | | | | |
| 7,250 % fällig am 02.10.2025 (a) | | 3.510 | | 3.210 | 0,09 |
| **Lincoln Financing SARL** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.04.2024 | | 7.250 | | 7.357 | 0,21 |
| **Summer BC Holdco SARL** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 31.10.2026 | | 6.000 | | 5.490 | 0,16 |
| 9,250 % fällig am 31.10.2027 | | 3.154 | | 2.558 | 0,07 |
| **Telecom Italia Capital S.A.** | | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.11.2033 | $ | 7.000 | | 5.425 | 0,15 |
| 7,200 % fällig am 18.07.2036 | | 3.000 | | 2.287 | 0,07 |
| Summe Luxemburg | | | | 95.099 | 2,70 |
| **MULTINATIONAL** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Allied Universal Holdco LLC** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.06.2028 | € | 7.500 | | 5.961 | 0,17 |
| 4,875 % fällig am 01.06.2028 | £ | 4.250 | | 4.073 | 0,12 |
| **American Airlines, Inc.** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 20.04.2026 | $ | 10.000 | | 9.223 | 0,26 |
| 5,750 % fällig am 20.04.2029 | | 10.000 | | 8.572 | 0,24 |
| **Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.09.2029 | € | 3.075 | | 2.405 | 0,07 |
| 3,250 % fällig am 01.09.2028 | $ | 3.000 | | 2.565 | 0,07 |
| 4,000 % fällig am 01.09.2029 | | 3.500 | | 2.819 | 0,08 |
| **Ardagh Packaging Finance PLC** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.08.2026 | | 7.000 | | 5.945 | 0,17 |
| 5,250 % fällig am 15.08.2027 (i) | | 5.000 | | 3.579 | 0,10 |
| **Clarios Global LP** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.05.2026 | € | 10.000 | | 9.167 | 0,26 |
| 8,500 % fällig am 15.05.2027 | $ | 5.000 | | 4.843 | 0,14 |
| **Connect Finco SARL** | | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.10.2026 | | 5.000 | | 4.510 | 0,13 |
| **Endo DAC** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 30.06.2028 | | 5.000 | | 400 | 0,01 |
| **Paysafe Finance PLC** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.06.2029 | € | 1.875 | | 1.476 | 0,04 |
| 4,000 % fällig am 15.06.2029 (i) | $ | 4.500 | | 3.250 | 0,09 |
| Summe multinational | | | | 68.788 | 1,95 |
| **NIEDERLANDE** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Ashland Services BV** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 30.01.2028 | € | 15.000 | | 12.917 | 0,37 |
| **Axalta Coating Systems Dutch Holding BV** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.01.2025 | | 10.000 | | 9.486 | 0,27 |
| **Clear Channel International BV** | | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.08.2025 | $ | 3.000 | | 2.794 | 0,08 |
| **Diamond BC BV** | | | | | |
| 4,625 % fällig am 01.10.2029 | | 15.000 | | 12.016 | 0,34 |
| **Dufry One BV** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 15.02.2027 (i) | € | 14.250 | | 11.219 | 0,32 |
| 3,375 % fällig am 15.04.2028 | | 10.000 | | 8.013 | 0,23 |
| **Energizer Gamma Acquisition BV** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 30.06.2029 | | 10.000 | | 7.485 | 0,21 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.05.2024 (e)(g) | | 7.000 | | 7.161 | 0,20 |
| **Q-Park Holding BV** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.03.2025 | | 5.375 | | 4.889 | 0,14 |
| 2,000 % fällig am 01.03.2027 | | 7.000 | | 5.854 | 0,17 |
| **Schoeller Packaging BV** | | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.11.2024 | | 5.000 | | 4.395 | 0,12 |
| **Sensata Technologies BV** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.10.2023 | $ | 2.000 | | 1.971 | 0,06 |
| 5,000 % fällig am 01.10.2025 | | 1.000 | | 962 | 0,03 |
| **Sigma Holdco BV** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.05.2026 | € | 7.000 | | 3.870 | 0,11 |
| 7,875 % fällig am 15.05.2026 | $ | 4.000 | | 2.277 | 0,06 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **United Group BV** | | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.02.2026 | € | 10.000 | | 8.284 | 0,23 |
| 3,625 % fällig am 15.02.2028 | | 7.500 | | 5.851 | 0,17 |
| 4,000 % fällig am 15.11.2027 | | 1.500 | | 1.194 | 0,03 |
| **UPC Holding BV** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.06.2029 | € | 10.000 | $ | 8.432 | 0,24 |
| **WP/AP Telecom Holdings BV** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.01.2029 | | 2.700 | | 2.321 | 0,07 |
| **ZF Europe Finance BV** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 23.02.2026 | | 3.000 | | 2.603 | 0,07 |
| 3,000 % fällig am 23.10.2029 | | 5.600 | | 4.288 | 0,12 |
| **Ziggo Bond Co. BV** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 28.02.2030 | | 10.000 | | 7.365 | 0,21 |
| 5,125 % fällig am 28.02.2030 | $ | 5.000 | | 3.928 | 0,11 |
| 6,000 % fällig am 15.01.2027 | | 5.000 | | 4.431 | 0,13 |
| **Ziggo BV** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.01.2030 | € | 5.000 | | 3.999 | 0,11 |
| Summe Niederlande | | | | 148.005 | 4,20 |
| **NORWEGEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Adevinta ASA** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.11.2025 | | 10.000 | | 9.383 | 0,27 |
| 3,000 % fällig am 15.11.2027 | | 2.750 | | 2.412 | 0,07 |
| Summe Norwegen | | | | 11.795 | 0,34 |
| **PANAMA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Carnival Corp.** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2028 | $ | 7.625 | | 6.280 | 0,18 |
| 5,750 % fällig am 01.03.2027 | | 10.000 | | 7.257 | 0,20 |
| 6,000 % fällig am 01.05.2029 | | 4.000 | | 2.824 | 0,08 |
| 7,625 % fällig am 01.03.2026 | | 5.000 | | 3.884 | 0,11 |
| Summe Panama | | | | 20.245 | 0,57 |
| **SPANIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Cellnex Finance Co. S.A.** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 15.09.2032 | € | 10.000 | | 7.117 | 0,20 |
| 2,000 % fällig am 15.02.2033 | | 3.000 | | 2.091 | 0,06 |
| 3,875 % fällig am 07.07.2041 | $ | 2.400 | | 1.652 | 0,05 |
| **Cellnex Telecom S.A.** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 20.04.2027 | € | 4.100 | | 3.518 | 0,10 |
| 1,875 % fällig am 26.06.2029 | | 3.000 | | 2.404 | 0,07 |
| **Grifols Escrow Issuer S.A.** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.10.2028 | | 7.000 | | 6.061 | 0,17 |
| **Grifols S.A.** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 15.02.2025 | | 5.000 | | 4.804 | 0,14 |
| 2,250 % fällig am 15.11.2027 | | 5.000 | | 4.377 | 0,12 |
| **Kaixo Bondco Telecom S.A.** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.09.2029 | | 5.000 | | 3.986 | 0,11 |
| **Lorca Telecom Bondco S.A.** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 18.09.2027 | | 10.400 | | 9.118 | 0,26 |
| Summe Spanien | | | | 45.128 | 1,28 |
| **SCHWEDEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Dometic Group AB** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 29.09.2028 | | 5.000 | | 3.730 | 0,11 |
| **Intrum AB** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.09.2027 | | 10.000 | | 8.095 | 0,23 |
| 3,125 % fällig am 15.07.2024 | | 4.000 | | 3.880 | 0,11 |
| 3,500 % fällig am 15.07.2026 | | 4.000 | | 3.511 | 0,10 |
| 4,875 % fällig am 15.08.2025 | | 2.000 | | 1.901 | 0,05 |
| **Verisure Holding AB** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.02.2027 | | 10.000 | | 8.671 | 0,25 |
| **Verisure Midholding AB** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.02.2029 | | 2.650 | | 2.119 | 0,06 |
| Summe Schweden | | | | 31.907 | 0,91 |
| **SCHWEIZ** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | | |
| 6,375 % fällig am 21.08.2026 (e)(g) | $ | 4.900 | | 4.061 | 0,12 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Arqiva Broadcast Finance PLC** | | | | | |
| 6,750 % fällig am 30.09.2023 | £ | 5.000 | $ | 5.806 | 0,16 |
| **BCP Modular Services Finance PLC** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.11.2028 | € | 10.000 | | 8.338 | 0,24 |
| 6,750 % fällig am 30.11.2029 | | 12.500 | | 9.608 | 0,27 |
| **Bellis Acquisition Co. PLC** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 16.02.2026 | £ | 20.375 | | 19.301 | 0,55 |
| **Bellis Finco PLC** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 16.02.2027 | | 4.000 | | 3.375 | 0,10 |
| **Boparan Finance PLC** | | | | | |
| 7,625 % fällig am 30.11.2025 (i) | | 7.000 | | 6.069 | 0,17 |
| **Carnival PLC** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 28.10.2029 | € | 10.000 | | 5.926 | 0,17 |
| **INEOS Finance PLC** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 01.05.2026 | | 5.000 | | 4.578 | 0,13 |
| **INEOS Quattro Finance PLC** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.01.2026 | | 5.150 | | 4.546 | 0,13 |
| 3,750 % fällig am 15.07.2026 | | 2.475 | | 2.082 | 0,06 |
| **International Game Technology PLC** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.04.2028 | | 2.500 | | 2.067 | 0,06 |
| 5,250 % fällig am 15.01.2029 | $ | 3.000 | | 2.723 | 0,08 |
| 6,500 % fällig am 15.02.2025 | | 8.500 | | 8.473 | 0,24 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | | |
| 7,500 % fällig am 27.06.2024 (e)(g) | | 6.000 | | 5.831 | 0,16 |
| **Rolls-Royce PLC** | | | | | |
| 0,875 % fällig am 09.05.2024 | € | 5.250 | | 5.087 | 0,14 |
| 4,625 % fällig am 16.02.2026 | | 2.500 | | 2.462 | 0,07 |
| 5,750 % fällig am 15.10.2027 | £ | 4.000 | | 4.585 | 0,13 |
| **Virgin Media Finance PLC** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.07.2030 | € | 12.000 | | 9.392 | 0,27 |
| 5,000 % fällig am 15.07.2030 | $ | 5.000 | | 3.976 | 0,11 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.01.2030 | £ | 10.000 | | 9.816 | 0,28 |
| **Vmed O2 UK Financing PLC** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 31.01.2031 | € | 10.750 | | 8.695 | 0,25 |
| 4,750 % fällig am 15.07.2031 | $ | 10.000 | | 8.100 | 0,23 |
| **Vodafone Group PLC** | | | | | |
| 7,000 % fällig am 04.04.2079 | | 4.000 | | 3.936 | 0,11 |
| **Zenith Finco PLC** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 30.06.2027 | £ | 3.000 | | 2.946 | 0,08 |
| Summe Großbritannien | | | | 147.718 | 4,19 |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **USA** | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **ENERGIE** | | | |
| **Diamond Offshore Drilling, Inc. (b)(h)** | 28.681 | 169 | 0,00 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| **Associated Materials Group, Inc. (b)** | 1.621.009 | 376 | 0,01 |
| Summe Stammaktien | | 545 | 0,01 |

| | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Academy Ltd.** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.11.2027 | $ | 6.000 | | 5.493 | 0,16 |
| **Acadia Healthcare Co., Inc.** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.04.2029 | | 7.000 | | 6.295 | 0,18 |
| **Acrisure LLC** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.02.2029 | | 4.000 | | 3.240 | 0,09 |
| **AdaptHealth LLC** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.03.2030 | | 2.000 | | 1.688 | 0,05 |
| 6,125 % fällig am 01.08.2028 | | 3.000 | | 2.658 | 0,08 |
| **ADT Security Corp.** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.07.2032 | | 5.000 | | 3.990 | 0,11 |
| **Advantage Sales & Marketing, Inc.** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.11.2028 | | 10.000 | | 8.592 | 0,24 |
| **Albertsons Cos., Inc.** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.03.2029 | | 5.000 | | 4.061 | 0,12 |
| 4,625 % fällig am 15.01.2027 | | 2.500 | | 2.238 | 0,06 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Allied Universal Holdco LLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.06.2029 | $ | 3.000 | $ 2.187 | 0,06 |
| 6,625 % fällig am 15.07.2026 | | 4.000 | 3.678 | 0,10 |
| **Allison Transmission, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 30.01.2031 | | 2.000 | 1.606 | 0,05 |
| 4,750 % fällig am 01.10.2027 | | 2.000 | 1.832 | 0,05 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.11.2031 (i) | | 4.189 | 4.624 | 0,13 |
| **AMC Networks, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.02.2029 | | 7.000 | 5.693 | 0,16 |
| **American Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,375 % fällig am 01.11.2028 | | 977 | 877 | 0,03 |
| **American Builders & Contractors Supply Co., Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.11.2029 | | 4.500 | 3.604 | 0,10 |
| 4,000 % fällig am 15.01.2028 | | 10.000 | 8.584 | 0,24 |
| **Amsted Industries, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.05.2030 | | 5.000 | 4.271 | 0,12 |
| **AmWINS Group, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.06.2029 | | 5.500 | 4.511 | 0,13 |
| **ANGI Group LLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.08.2028 | | 4.250 | 3.243 | 0,09 |
| **Antero Midstream Partners LP** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.06.2029 | | 5.750 | 5.160 | 0,15 |
| 5,750 % fällig am 01.03.2027 | | 2.000 | 1.863 | 0,05 |
| **Antero Resources Corp.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.03.2030 | | 5.000 | 4.567 | 0,13 |
| **Apache Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.11.2027 | | 5.000 | 4.613 | 0,13 |
| **APi Escrow Corp.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.10.2029 | | 3.000 | 2.427 | 0,07 |
| **Aramark Services, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.02.2028 | | 3.000 | 2.725 | 0,08 |
| **Ascent Resources Utica Holdings LLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 30.06.2029 | | 5.000 | 4.407 | 0,13 |
| 8,250 % fällig am 31.12.2028 | | 2.000 | 1.908 | 0,05 |
| **ASP Unifrax Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 30.09.2028 | | 5.000 | 3.999 | 0,11 |
| 7,500 % fällig am 30.09.2029 | | 2.000 | 1.392 | 0,04 |
| **At Home Group, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.07.2028 | | 2.000 | 1.453 | 0,04 |
| 7,125 % fällig am 15.07.2029 | | 2.500 | 1.423 | 0,04 |
| **Avantor Funding, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.07.2028 | € | 5.375 | 4.892 | 0,14 |
| 4,625 % fällig am 15.07.2028 | $ | 3.250 | 2.988 | 0,09 |
| **Avient Corp.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.05.2025 | | 3.000 | 2.880 | 0,08 |
| **Ball Corp.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.03.2027 | € | 5.000 | 4.409 | 0,13 |
| 2,875 % fällig am 15.08.2030 | $ | 7.500 | 6.053 | 0,17 |
| 3,125 % fällig am 15.09.2031 | | 5.000 | 4.042 | 0,11 |
| **Bath & Body Works, Inc.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.10.2030 | | 5.000 | 4.332 | 0,12 |
| 6,875 % fällig am 01.11.2035 | | 10.000 | 8.155 | 0,23 |
| **BCPE Empire Holdings, Inc.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 01.05.2027 | | 10.000 | 8.155 | 0,23 |
| **Black Knight InfoServ LLC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.09.2028 | | 5.000 | 4.338 | 0,12 |
| **Blue Racer Midstream LLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 15.12.2025 | | 5.000 | 4.735 | 0,13 |
| **Boxer Parent Co., Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 02.10.2025 | € | 5.000 | 4.923 | 0,14 |
| **Boyd Gaming Corp.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.12.2027 | $ | 2.000 | 1.814 | 0,05 |
| 4,750 % fällig am 15.06.2031 | | 4.625 | 3.917 | 0,11 |
| **Boyne USA, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.05.2029 | | 5.000 | 4.338 | 0,12 |
| **Buckeye Partners LP** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.03.2025 | | 3.875 | 3.593 | 0,10 |
| 4,500 % fällig am 01.03.2028 | | 3.500 | 2.952 | 0,08 |
| **Builders FirstSource, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.02.2032 | | 3.000 | 2.289 | 0,07 |
| 5,000 % fällig am 01.03.2030 | | 5.000 | 4.244 | 0,12 |
| **Cable One, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.11.2030 | | 3.000 | 2.469 | 0,07 |
| **Caesars Entertainment, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.10.2029 | | 6.925 | 5.403 | 0,15 |
| 6,250 % fällig am 01.07.2025 | | 5.000 | 4.836 | 0,14 |
| **Callon Petroleum Co.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.06.2030 | $ | 4.000 | $ 3.687 | 0,10 |
| **Calpine Corp.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.03.2031 | | 2.000 | 1.631 | 0,05 |
| 4,500 % fällig am 15.02.2028 | | 5.000 | 4.549 | 0,13 |
| 4,625 % fällig am 01.02.2029 | | 1.750 | 1.459 | 0,04 |
| 5,125 % fällig am 15.03.2028 | | 4.750 | 4.193 | 0,12 |
| 5,250 % fällig am 01.06.2026 | | 663 | 631 | 0,02 |
| **Catalent Pharma Solutions, Inc.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 01.03.2028 | € | 20.000 | 17.147 | 0,49 |
| 5,000 % fällig am 15.07.2027 | $ | 2.500 | 2.356 | 0,07 |
| **CCO Holdings LLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.02.2031 | | 5.000 | 4.089 | 0,12 |
| 4,250 % fällig am 15.01.2034 | | 8.000 | 6.208 | 0,18 |
| 4,500 % fällig am 15.08.2030 | | 10.000 | 8.335 | 0,24 |
| 4,500 % fällig am 01.05.2032 | | 10.000 | 8.131 | 0,23 |
| 4,500 % fällig am 01.06.2033 | | 7.500 | 5.926 | 0,17 |
| 4,750 % fällig am 01.03.2030 | | 7.000 | 6.008 | 0,17 |
| 5,125 % fällig am 01.05.2027 | | 10.000 | 9.470 | 0,27 |
| 5,375 % fällig am 01.06.2029 | | 4.000 | 3.584 | 0,10 |
| **CD&R Smokey Buyer, Inc.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.07.2025 | | 3.000 | 2.667 | 0,08 |
| **CDI Escrow Issuer, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.04.2030 | | 3.750 | 3.420 | 0,10 |
| **Centene Corp.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.03.2031 | | 7.000 | 5.578 | 0,16 |
| 2,625 % fällig am 01.08.2031 | | 5.000 | 3.988 | 0,11 |
| 3,375 % fällig am 15.02.2030 | | 5.000 | 4.255 | 0,12 |
| 4,625 % fällig am 15.12.2029 | | 3.000 | 2.806 | 0,08 |
| **Centennial Resource Production LLC** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.01.2026 | | 2.000 | 1.810 | 0,05 |
| 6,875 % fällig am 01.04.2027 | | 4.000 | 3.806 | 0,11 |
| **Central Garden & Pet Co.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 30.04.2031 | | 7.500 | 6.033 | 0,17 |
| **Charles River Laboratories International, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.03.2029 | | 2.500 | 2.174 | 0,06 |
| 4,000 % fällig am 15.03.2031 | | 2.000 | 1.709 | 0,05 |
| **Cheniere Energy Partners LP** | | | | |
| 3,250 % fällig am 31.01.2032 | | 5.000 | 3.949 | 0,11 |
| 4,000 % fällig am 01.03.2031 | | 7.000 | 5.968 | 0,17 |
| 4,500 % fällig am 01.10.2029 | | 4.000 | 3.579 | 0,10 |
| **Cheniere Energy, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.10.2028 | | 7.000 | 6.327 | 0,18 |
| **Chesapeake Energy Corp.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.02.2026 | | 2.000 | 1.908 | 0,05 |
| 5,875 % fällig am 01.02.2029 | | 1.500 | 1.417 | 0,04 |
| 6,750 % fällig am 15.04.2029 | | 12.000 | 11.640 | 0,33 |
| **Clarivate Science Holdings Corp.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.07.2028 | | 3.875 | 3.249 | 0,09 |
| 4,875 % fällig am 01.07.2029 | | 4.000 | 3.296 | 0,09 |
| **Clearway Energy Operating LLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.01.2032 | | 5.000 | 3.970 | 0,11 |
| 4,750 % fällig am 15.03.2028 | | 2.000 | 1.803 | 0,05 |
| **Coinbase Global, Inc.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 01.10.2028 | | 2.000 | 1.265 | 0,04 |
| 3,625 % fällig am 01.10.2031 | | 3.000 | 1.694 | 0,05 |
| **Colgate Energy Partners LLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.07.2029 | | 4.000 | 3.510 | 0,10 |
| **CommScope Technologies LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2027 | | 5.000 | 3.703 | 0,11 |
| 6,000 % fällig am 15.06.2025 | | 3.334 | 2.890 | 0,08 |
| **CommScope, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.09.2029 | | 10.000 | 8.095 | 0,23 |
| 6,000 % fällig am 01.03.2026 | | 3.000 | 2.769 | 0,08 |
| 7,125 % fällig am 01.07.2028 | | 5.000 | 3.808 | 0,11 |
| 8,250 % fällig am 01.03.2027 | | 4.000 | 3.172 | 0,09 |
| **Community Health Systems, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.02.2031 | | 10.000 | 7.349 | 0,21 |
| 5,250 % fällig am 15.05.2030 (i) | | 5.000 | 3.809 | 0,11 |
| 5,625 % fällig am 15.03.2027 | | 9.000 | 7.642 | 0,22 |
| 6,000 % fällig am 15.01.2029 | | 1.625 | 1.349 | 0,04 |
| 6,875 % fällig am 15.04.2029 | | 4.000 | 2.592 | 0,07 |
| **Comstock Resources, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.01.2030 (i) | | 3.150 | 2.718 | 0,08 |
| 6,750 % fällig am 01.03.2029 | | 5.000 | 4.488 | 0,13 |
| **CoreLogic, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.05.2028 | | 9.000 | 6.944 | 0,20 |
| **Cornerstone Building Brands, Inc.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.01.2029 | | 6.000 | 3.862 | 0,11 |
| **Coty, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.04.2026 | € | 7.750 | $ 7.188 | 0,20 |
| 4,750 % fällig am 15.04.2026 | | 5.000 | 4.515 | 0,13 |
| 5,000 % fällig am 15.04.2026 | $ | 5.500 | 5.049 | 0,14 |
| 6,500 % fällig am 15.04.2026 (i) | | 3.000 | 2.770 | 0,08 |
| **Covanta Holding Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.12.2029 | | 3.000 | 2.445 | 0,07 |
| 5,000 % fällig am 01.09.2030 | | 3.000 | 2.455 | 0,07 |
| **Crocs, Inc.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.08.2031 | | 4.000 | 2.837 | 0,08 |
| **Crown Americas LLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 30.09.2026 | | 5.000 | 4.621 | 0,13 |
| 4,750 % fällig am 01.02.2026 | | 2.000 | 1.907 | 0,05 |
| **CrownRock LP** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.05.2029 | | 2.000 | 1.797 | 0,05 |
| 5,625 % fällig am 15.10.2025 | | 8.000 | 7.542 | 0,21 |
| **CSC Holdings LLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.02.2031 | | 5.000 | 3.711 | 0,11 |
| 4,125 % fällig am 01.12.2030 | | 5.000 | 3.913 | 0,11 |
| 4,625 % fällig am 01.12.2030 | | 8.000 | 5.374 | 0,15 |
| 5,500 % fällig am 15.04.2027 | | 2.500 | 2.270 | 0,06 |
| 5,750 % fällig am 15.01.2030 | | 10.000 | 7.302 | 0,21 |
| **Curo Group Holdings Corp.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 01.08.2028 | | 10.000 | 6.304 | 0,18 |
| **DaVita, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.02.2031 | | 10.000 | 7.196 | 0,20 |
| 4,625 % fällig am 01.06.2030 | | 15.000 | 11.745 | 0,33 |
| **DCP Midstream Operating LP** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.02.2032 | | 6.000 | 4.718 | 0,13 |
| 5,375 % fällig am 15.07.2025 | | 2.000 | 1.948 | 0,06 |
| 5,625 % fällig am 15.07.2027 | | 1.500 | 1.434 | 0,04 |
| **Diamond Offshore Drilling, Inc.** | | | | |
| 13,000 % fällig am 21.12.2026 | | 44 | 44 | 0,00 |
| **Diamond Sports Group LLC** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.08.2026 | | 8.000 | 2.010 | 0,06 |
| 6,625 % fällig am 15.08.2027 | | 5.000 | 625 | 0,02 |
| **Directv Financing LLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.08.2027 | | 13.500 | 11.560 | 0,33 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.12.2026 | | 6.750 | 5.304 | 0,15 |
| 5,750 % fällig am 01.12.2028 | | 6.750 | 5.010 | 0,14 |
| 5,875 % fällig am 15.11.2024 | | 5.000 | 4.230 | 0,12 |
| 7,750 % fällig am 01.07.2026 | | 5.000 | 3.915 | 0,11 |
| **Diversified Healthcare Trust** | | | | |
| 4,375 % fällig am 01.03.2031 | | 3.500 | 2.385 | 0,07 |
| **DT Midstream, Inc.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.06.2029 | | 5.000 | 4.252 | 0,12 |
| 4,375 % fällig am 15.06.2031 | | 5.375 | 4.518 | 0,13 |
| **Edgewell Personal Care Co.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.04.2029 | | 5.000 | 4.136 | 0,12 |
| 5,500 % fällig am 01.06.2028 | | 5.000 | 4.559 | 0,13 |
| **Elanco Animal Health, Inc.** | | | | |
| 6,400 % fällig am 28.08.2028 (i) | | 5.000 | 4.785 | 0,14 |
| **Element Solutions, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.09.2028 | | 6.000 | 4.960 | 0,14 |
| **Enact Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.08.2025 | | 3.500 | 3.307 | 0,09 |
| **Encino Acquisition Partners Holdings LLC** | | | | |
| 8,500 % fällig am 01.05.2028 | | 4.000 | 3.786 | 0,11 |
| **Endeavor Energy Resources LP** | | | | |
| 5,750 % fällig am 30.01.2028 | | 10.000 | 9.553 | 0,27 |
| 6,625 % fällig am 15.07.2025 | | 3.000 | 3.019 | 0,09 |
| **Energizer Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 31.03.2029 | | 5.000 | 3.846 | 0,11 |
| 4,750 % fällig am 15.06.2028 | | 2.500 | 1.988 | 0,06 |
| **EnLink Midstream LLC** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.06.2029 | | 7.500 | 6.576 | 0,19 |
| 5,625 % fällig am 15.01.2028 | | 1.000 | 919 | 0,03 |
| **EQM Midstream Partners LP** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2024 | | 1.871 | 1.741 | 0,05 |
| 4,500 % fällig am 15.01.2029 | | 2.500 | 2.034 | 0,06 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2031 | | 3.250 | 2.601 | 0,07 |
| 6,000 % fällig am 01.07.2025 | | 735 | 706 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 01.07.2027 | | 2.000 | 1.863 | 0,05 |
| 6,500 % fällig am 15.07.2048 | | 3.000 | 2.293 | 0,07 |
| 7,500 % fällig am 01.06.2027 | | 1.000 | 967 | 0,03 |
| 7,500 % fällig am 01.06.2030 | | 2.000 | 1.925 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Fertitta Entertainment LLC** | | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.01.2029 | $ | 2.000 | $ | 1.711 | 0,05 |
| 6,750 % fällig am 15.01.2030 | | 4.250 | | 3.274 | 0,09 |
| **First Student Bidco, Inc.** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 31.07.2029 | | 5.000 | | 4.008 | 0,11 |
| **Ford Motor Co.** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.02.2032 | | 6.125 | | 4.602 | 0,13 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | | |
| 0,346 % fällig am 01.12.2024 | € | 5.000 | | 4.879 | 0,14 |
| 1,744 % fällig am 19.07.2024 | | 3.000 | | 2.905 | 0,08 |
| 2,700 % fällig am 10.08.2026 | $ | 8.000 | | 6.827 | 0,19 |
| 2,900 % fällig am 16.02.2028 | | 5.000 | | 4.037 | 0,11 |
| 2,900 % fällig am 10.02.2029 | | 4.900 | | 3.850 | 0,11 |
| 3,375 % fällig am 13.11.2025 | | 5.000 | | 4.518 | 0,13 |
| 3,664 % fällig am 08.09.2024 | | 3.000 | | 2.843 | 0,08 |
| 4,000 % fällig am 13.11.2030 | | 12.000 | | 9.747 | 0,28 |
| 4,125 % fällig am 17.08.2027 | | 5.000 | | 4.417 | 0,13 |
| 4,134 % fällig am 04.08.2025 | | 6.000 | | 5.700 | 0,16 |
| 4,542 % fällig am 01.08.2026 | | 3.000 | | 2.750 | 0,08 |
| 5,125 % fällig am 16.06.2025 | | 2.000 | | 1.914 | 0,05 |
| **Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.05.2028 | | 6.000 | | 4.970 | 0,14 |
| 6,500 % fällig am 01.10.2025 | | 7.000 | | 6.618 | 0,19 |
| **Frontier Communications Holdings LLC** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.05.2028 | | 2.500 | | 2.131 | 0,06 |
| 5,875 % fällig am 15.10.2027 | | 4.625 | | 4.170 | 0,12 |
| 6,750 % fällig am 01.05.2029 | | 5.000 | | 4.126 | 0,12 |
| **Gap, Inc.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.10.2029 | | 4.500 | | 3.168 | 0,09 |
| 3,875 % fällig am 01.10.2031 | | 5.000 | | 3.498 | 0,10 |
| **Gartner, Inc.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.06.2029 | | 4.000 | | 3.472 | 0,10 |
| 3,750 % fällig am 01.10.2030 | | 2.000 | | 1.706 | 0,05 |
| 4,500 % fällig am 01.07.2028 | | 3.000 | | 2.760 | 0,08 |
| **Genesis Energy LP** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.05.2026 | | 2.000 | | 1.790 | 0,05 |
| 6,500 % fällig am 01.10.2025 | | 3.000 | | 2.772 | 0,08 |
| **Global Medical Response, Inc.** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.10.2025 | | 10.000 | | 8.924 | 0,25 |
| **Go Daddy Operating Co. LLC** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.03.2029 | | 5.000 | | 4.225 | 0,12 |
| **Graphic Packaging International LLC** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.03.2029 | | 3.125 | | 2.628 | 0,07 |
| 4,125 % fällig am 15.08.2024 | | 2.000 | | 1.968 | 0,06 |
| **Greystar Real Estate Partners LLC** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.12.2025 | | 6.250 | | 5.927 | 0,17 |
| **H-Food Holdings LLC** | | | | | |
| 8,500 % fällig am 01.06.2026 | | 8.000 | | 5.611 | 0,16 |
| **HAT Holdings LLC** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.06.2026 | | 4.000 | | 3.450 | 0,10 |
| 3,750 % fällig am 15.09.2030 | | 5.750 | | 4.597 | 0,13 |
| **HCA, Inc.** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.09.2030 | | 10.000 | | 8.536 | 0,24 |
| 5,875 % fällig am 15.02.2026 | | 2.000 | | 2.014 | 0,06 |
| **HealthEquity, Inc.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.10.2029 | | 2.000 | | 1.753 | 0,05 |
| **Hertz Corp.** | | | | | |
| 4,625 % fällig am 01.12.2026 | | 2.000 | | 1.674 | 0,05 |
| 5,000 % fällig am 01.12.2029 | | 4.000 | | 3.091 | 0,09 |
| **Hilton Domestic Operating Co., Inc.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.02.2032 | | 6.000 | | 4.780 | 0,14 |
| 3,750 % fällig am 01.05.2029 | | 4.500 | | 3.823 | 0,11 |
| 4,000 % fällig am 01.05.2031 | | 4.375 | | 3.649 | 0,10 |
| 4,875 % fällig am 15.01.2030 | | 4.000 | | 3.626 | 0,10 |
| 5,750 % fällig am 01.05.2028 | | 2.250 | | 2.143 | 0,06 |
| **Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.07.2031 | | 8.000 | | 6.119 | 0,17 |
| 5,000 % fällig am 01.06.2029 | | 5.500 | | 4.464 | 0,13 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.04.2027 | | 3.500 | | 3.302 | 0,09 |
| **Hologic, Inc.** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.02.2029 | | 4.000 | | 3.430 | 0,10 |
| 4,625 % fällig am 01.02.2028 | | 5.000 | | 4.687 | 0,13 |
| **Howard Hughes Corp.** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.02.2029 | | 4.000 | | 3.092 | 0,09 |
| 4,375 % fällig am 01.02.2031 | | 3.000 | | 2.225 | 0,06 |
| 5,375 % fällig am 01.08.2028 | | 4.500 | | 3.778 | 0,11 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Howard Midstream Energy Partners LLC** | | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.01.2027 | $ | 1.750 | $ | 1.510 | 0,04 |
| **Howmet Aerospace, Inc.** | | | | | |
| 5,900 % fällig am 01.02.2027 | | 3.000 | | 2.960 | 0,08 |
| 5,950 % fällig am 01.02.2037 | | 5.000 | | 4.723 | 0,13 |
| **iHeartCommunications, Inc.** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.01.2028 | | 5.000 | | 4.127 | 0,12 |
| 5,250 % fällig am 15.08.2027 | | 3.000 | | 2.572 | 0,07 |
| **Imola Merger Corp.** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.05.2029 | | 7.500 | | 6.300 | 0,18 |
| **IQVIA, Inc.** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.01.2028 | € | 11.000 | | 9.560 | 0,27 |
| 2,250 % fällig am 15.03.2029 | | 5.900 | | 4.907 | 0,14 |
| 2,875 % fällig am 15.06.2028 | | 7.000 | | 6.253 | 0,18 |
| 5,000 % fällig am 15.05.2027 | $ | 2.000 | | 1.897 | 0,05 |
| **Jeld-Wen, Inc.** | | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.12.2025 | | 4.000 | | 3.405 | 0,10 |
| 4,875 % fällig am 15.12.2027 | | 10.000 | | 7.813 | 0,22 |
| 6,250 % fällig am 15.05.2025 | | 2.000 | | 1.924 | 0,05 |
| **Kaiser Aluminum Corp.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.06.2031 | | 2.000 | | 1.517 | 0,04 |
| 4,625 % fällig am 01.03.2028 | | 4.000 | | 3.336 | 0,09 |
| **KFC Holding Co.** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.06.2027 | | 3.500 | | 3.372 | 0,10 |
| **Kinetik Holdings LP** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.06.2030 | | 3.500 | | 3.340 | 0,10 |
| **Kronos Acquisition Holdings, Inc.** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 31.12.2026 | | 5.000 | | 4.281 | 0,12 |
| **LABL, Inc.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.11.2028 | | 2.875 | | 2.327 | 0,07 |
| 6,750 % fällig am 15.07.2026 | | 5.000 | | 4.509 | 0,13 |
| **Lamb Weston Holdings, Inc.** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 31.01.2030 | | 2.000 | | 1.736 | 0,05 |
| 4,375 % fällig am 31.01.2032 | | 3.000 | | 2.616 | 0,07 |
| 4,875 % fällig am 15.05.2028 | | 4.000 | | 3.771 | 0,11 |
| **Legacy LifePoint Health LLC** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.02.2027 | | 4.000 | | 3.432 | 0,10 |
| **Legends Hospitality Holding Co. LLC** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.02.2026 | | 1.750 | | 1.469 | 0,04 |
| **Lehman Brothers Holdings, Inc.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.05.2010 ^ | | 14.200 | | 60 | 0,00 |
| **Level 3 Financing, Inc.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.01.2029 | | 4.000 | | 3.092 | 0,09 |
| 3,750 % fällig am 15.07.2029 | | 4.000 | | 3.100 | 0,09 |
| 4,250 % fällig am 01.07.2028 | | 5.000 | | 4.021 | 0,11 |
| **LFS Topco LLC** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.10.2026 | | 2.500 | | 1.979 | 0,06 |
| **Live Nation Entertainment, Inc.** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.11.2024 | | 3.000 | | 2.871 | 0,08 |
| 6,500 % fällig am 15.05.2027 | | 5.000 | | 4.928 | 0,14 |
| **LogMeIn, Inc.** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.09.2027 | | 4.500 | | 3.144 | 0,09 |
| **Madison IAQ LLC** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 30.06.2028 | | 10.000 | | 8.274 | 0,24 |
| 5,875 % fällig am 30.06.2029 | | 7.000 | | 5.382 | 0,15 |
| **Marriott Ownership Resorts, Inc.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.06.2029 | | 2.600 | | 2.166 | 0,06 |
| 6,125 % fällig am 15.09.2025 | | 501 | | 497 | 0,01 |
| **Mattel, Inc.** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.04.2029 | | 5.000 | | 4.502 | 0,13 |
| 5,875 % fällig am 15.12.2027 | | 5.000 | | 4.895 | 0,14 |
| **Mauser Packaging Solutions Holding Co.** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.04.2024 | € | 5.000 | | 4.894 | 0,14 |
| **MGM Resorts International** | | | | | |
| 4,625 % fällig am 01.09.2026 | $ | 6.000 | | 5.334 | 0,15 |
| 5,500 % fällig am 15.04.2027 | | 1.306 | | 1.174 | 0,03 |
| 5,750 % fällig am 15.06.2025 | | 2.000 | | 1.908 | 0,05 |
| **Midcap Financial Issuer Trust** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.05.2028 | | 5.000 | | 4.314 | 0,12 |
| **Midwest Gaming Borrower LLC** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.05.2029 | | 7.000 | | 5.716 | 0,16 |
| **Moog, Inc.** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.12.2027 | | 5.000 | | 4.342 | 0,12 |
| **Mozart Debt Merger Sub, Inc.** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.04.2029 | | 12.000 | | 10.261 | 0,29 |
| 5,250 % fällig am 01.10.2029 (i) | | 10.000 | | 8.244 | 0,23 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **MPH Acquisition Holdings LLC** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.09.2028 | $ | 5.000 | $ | 4.464 | 0,13 |
| 5,750 % fällig am 01.11.2028 (i) | | 10.000 | | 8.307 | 0,24 |
| **MPT Operating Partnership LP** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.03.2031 | | 7.500 | | 5.933 | 0,17 |
| **MSCI, Inc.** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.08.2033 | | 1.000 | | 799 | 0,02 |
| 3,875 % fällig am 15.02.2031 | | 2.500 | | 2.145 | 0,06 |
| 4,000 % fällig am 15.11.2029 | | 5.000 | | 4.444 | 0,13 |
| **Nabors Industries, Inc.** | | | | | |
| 7,375 % fällig am 15.05.2027 | | 2.750 | | 2.616 | 0,07 |
| 9,000 % fällig am 01.02.2025 | | 1.125 | | 1.121 | 0,03 |
| **Nationstar Mortgage Holdings, Inc.** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.08.2028 | | 7.000 | | 5.625 | 0,16 |
| **NCR Corp.** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.10.2028 | | 4.000 | | 3.397 | 0,10 |
| 5,250 % fällig am 01.10.2030 | | 2.500 | | 2.159 | 0,06 |
| 5,750 % fällig am 01.09.2027 | | 3.750 | | 3.333 | 0,09 |
| 6,125 % fällig am 01.09.2029 | | 2.000 | | 1.732 | 0,05 |
| **NESCO Holdings, Inc.** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.04.2029 | | 2.825 | | 2.374 | 0,07 |
| **Nexstar Media, Inc.** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.11.2028 | | 4.000 | | 3.438 | 0,10 |
| 5,625 % fällig am 15.07.2027 | | 4.000 | | 3.658 | 0,10 |
| **NextEra Energy Operating Partners LP** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.07.2024 | | 2.000 | | 1.917 | 0,05 |
| 4,250 % fällig am 15.09.2024 | | 262 | | 251 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 15.09.2027 | | 5.000 | | 4.640 | 0,13 |
| **Nielsen Finance LLC** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.07.2029 | | 2.500 | | 2.262 | 0,06 |
| 4,750 % fällig am 15.07.2031 | | 5.000 | | 4.505 | 0,13 |
| 5,625 % fällig am 01.10.2028 | | 3.500 | | 3.260 | 0,09 |
| 5,875 % fällig am 01.10.2030 | | 5.000 | | 4.600 | 0,13 |
| **Novelis Corp.** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.11.2026 | | 3.000 | | 2.541 | 0,07 |
| 3,875 % fällig am 15.08.2031 | | 8.000 | | 6.175 | 0,18 |
| 4,750 % fällig am 30.01.2030 | | 10.000 | | 8.331 | 0,24 |
| **NRG Energy, Inc.** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.02.2029 | | 4.250 | | 3.435 | 0,10 |
| 3,625 % fällig am 15.02.2031 | | 3.750 | | 2.948 | 0,08 |
| 3,875 % fällig am 15.02.2032 | | 8.000 | | 6.372 | 0,18 |
| 6,625 % fällig am 15.01.2027 | | 1.067 | | 1.047 | 0,03 |
| **NSG Holdings LLC** | | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.12.2025 | | 1.154 | | 1.137 | 0,03 |
| **NuStar Logistics LP** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.10.2025 | | 4.250 | | 3.980 | 0,11 |
| 6,375 % fällig am 01.10.2030 | | 3.625 | | 3.155 | 0,09 |
| **Occidental Petroleum Corp.** | | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.06.2045 | | 1.500 | | 1.236 | 0,04 |
| 5,550 % fällig am 15.03.2026 | | 4.000 | | 3.980 | 0,11 |
| 5,875 % fällig am 01.09.2025 | | 3.625 | | 3.617 | 0,10 |
| 6,125 % fällig am 01.01.2031 (h) | | 1.250 | | 1.270 | 0,04 |
| 6,200 % fällig am 15.03.2040 | | 7.000 | | 6.909 | 0,20 |
| 6,375 % fällig am 01.09.2028 | | 3.000 | | 3.042 | 0,09 |
| 6,450 % fällig am 15.09.2036 | | 5.000 | | 5.137 | 0,15 |
| 6,600 % fällig am 15.03.2046 | | 6.000 | | 6.390 | 0,18 |
| 6,625 % fällig am 01.09.2030 | | 5.000 | | 5.159 | 0,15 |
| 7,500 % fällig am 01.05.2031 | | 1.000 | | 1.077 | 0,03 |
| 8,000 % fällig am 15.07.2025 | | 3.000 | | 3.163 | 0,09 |
| 8,875 % fällig am 15.07.2030 | | 5.625 | | 6.469 | 0,18 |
| **Olympus Water U.S. Holding Corp.** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.10.2028 | € | 10.000 | | 8.505 | 0,24 |
| 4,250 % fällig am 01.10.2028 | $ | 5.000 | | 3.924 | 0,11 |
| 5,375 % fällig am 01.10.2029 | € | 10.000 | | 7.549 | 0,21 |
| **ON Semiconductor Corp.** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.09.2028 | $ | 5.500 | | 4.850 | 0,14 |
| **OneMain Finance Corp.** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.01.2027 | | 5.000 | | 4.007 | 0,11 |
| 5,375 % fällig am 15.11.2029 | | 5.000 | | 4.061 | 0,12 |
| 6,125 % fällig am 15.03.2024 | | 3.000 | | 2.872 | 0,08 |
| 6,625 % fällig am 15.01.2028 | | 3.000 | | 2.687 | 0,08 |
| 6,875 % fällig am 15.03.2025 | | 5.000 | | 4.749 | 0,14 |
| 7,125 % fällig am 15.03.2026 | | 2.750 | | 2.548 | 0,07 |
| **Organon & Co.** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 30.04.2028 | € | 5.750 | | 5.052 | 0,14 |
| 4,125 % fällig am 30.04.2028 | $ | 5.000 | | 4.444 | 0,13 |
| 5,125 % fällig am 30.04.2031 | | 12.000 | | 10.398 | 0,30 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Outfront Media Capital LLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.01.2029 | $ | 2.500 | $ 1.995 | 0,06 |
| 4,625 % fällig am 15.03.2030 | | 2.000 | 1.578 | 0,04 |
| 5,000 % fällig am 15.08.2027 | | 4.000 | 3.500 | 0,10 |
| 6,250 % fällig am 15.06.2025 | | 3.000 | 2.851 | 0,08 |
| **Owens & Minor, Inc.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.04.2030 | | 3.750 | 3.430 | 0,10 |
| **Oxford Finance LLC** | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.02.2027 | | 4.800 | 4.605 | 0,13 |
| **Pactiv Evergreen Group Issuer LLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.10.2028 | | 5.875 | 5.002 | 0,14 |
| **Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.10.2027 | | 13.000 | 11.141 | 0,32 |
| **Park Intermediate Holdings LLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.05.2029 | | 5.750 | 4.947 | 0,14 |
| 7,500 % fällig am 01.06.2025 | | 4.000 | 3.998 | 0,11 |
| **Park River Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.02.2029 | | 7.000 | 4.372 | 0,12 |
| 6,750 % fällig am 01.08.2029 | | 3.000 | 1.950 | 0,06 |
| **PDC Energy, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.05.2026 | | 3.000 | 2.804 | 0,08 |
| **PennyMac Financial Services, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.02.2029 | | 10.000 | 7.368 | 0,21 |
| 5,750 % fällig am 15.09.2031 | | 5.000 | 3.738 | 0,11 |
| **Performance Food Group, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.08.2029 | | 4.000 | 3.348 | 0,10 |
| 5,500 % fällig am 15.10.2027 | | 5.000 | 4.638 | 0,13 |
| 6,875 % fällig am 01.05.2025 | | 1.500 | 1.495 | 0,04 |
| **PetSmart, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.02.2028 | | 12.000 | 10.417 | 0,30 |
| 7,750 % fällig am 15.02.2029 | | 10.000 | 9.028 | 0,26 |
| **Post Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.09.2031 | | 11.000 | 9.029 | 0,26 |
| 4,625 % fällig am 15.04.2030 | | 5.000 | 4.227 | 0,12 |
| 5,500 % fällig am 15.12.2029 | | 5.000 | 4.480 | 0,13 |
| 5,625 % fällig am 15.01.2028 | | 6.000 | 5.708 | 0,16 |
| **Premier Entertainment Sub LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.09.2029 | | 7.750 | 5.529 | 0,16 |
| 5,875 % fällig am 01.09.2031 | | 6.000 | 4.172 | 0,12 |
| **Prime Healthcare Services, Inc.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 01.11.2025 | | 7.000 | 5.996 | 0,17 |
| **Prime Security Services Borrower LLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 31.08.2027 | | 7.000 | 5.788 | 0,16 |
| 5,250 % fällig am 15.04.2024 | | 3.000 | 2.938 | 0,08 |
| 5,750 % fällig am 15.04.2026 | | 4.000 | 3.738 | 0,11 |
| 6,250 % fällig am 15.01.2028 (i) | | 5.000 | 4.196 | 0,12 |
| **Radiate Holdco LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.09.2026 | | 6.000 | 5.183 | 0,15 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2028 | | 5.000 | 3.878 | 0,11 |
| **Range Resources Corp.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.02.2030 | | 2.000 | 1.797 | 0,05 |
| 5,000 % fällig am 15.03.2023 | | 1.121 | 1.114 | 0,03 |
| 8,250 % fällig am 15.01.2029 | | 2.000 | 2.042 | 0,06 |
| **RHP Hotel Properties LP** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.02.2029 | | 7.500 | 6.374 | 0,18 |
| 4,750 % fällig am 15.10.2027 | | 4.000 | 3.554 | 0,10 |
| **RLJ Lodging Trust LP** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.09.2029 | | 5.000 | 4.116 | 0,12 |
| **Rockcliff Energy LLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.10.2029 | | 5.000 | 4.557 | 0,13 |
| **Rocket Mortgage LLC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.03.2029 | | 1.750 | 1.379 | 0,04 |
| 3,875 % fällig am 01.03.2031 | | 3.000 | 2.256 | 0,06 |
| 4,000 % fällig am 15.10.2033 | | 3.500 | 2.493 | 0,07 |
| **Rockies Express Pipeline LLC** | | | | |
| 3,600 % fällig am 15.05.2025 | | 1.500 | 1.362 | 0,04 |
| 4,800 % fällig am 15.05.2030 | | 2.000 | 1.668 | 0,05 |
| 4,950 % fällig am 15.07.2029 | | 4.000 | 3.427 | 0,10 |
| **Sabre GLBL, Inc.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 01.09.2025 | | 3.500 | 3.253 | 0,09 |
| 9,250 % fällig am 15.04.2025 | | 2.000 | 1.931 | 0,05 |
| **SBA Communications Corp.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 01.02.2029 | | 7.000 | 5.746 | 0,16 |
| 3,875 % fällig am 15.02.2027 | | 10.000 | 9.151 | 0,26 |
| **SCIH Salt Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.05.2028 | | 7.750 | 6.457 | 0,18 |
| 6,625 % fällig am 01.05.2029 | | 5.000 | 3.957 | 0,11 |
| **Scripps Escrow, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.07.2027 | $ | 5.000 | $ 4.384 | 0,12 |
| **Select Medical Corp.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.08.2026 | | 5.000 | 4.677 | 0,13 |
| **Sensata Technologies, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.02.2031 | | 6.000 | 4.819 | 0,14 |
| **Silgan Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 01.06.2028 | € | 5.750 | 4.748 | 0,13 |
| **Sinclair Television Group, Inc.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.12.2030 | $ | 5.000 | 3.973 | 0,11 |
| 5,125 % fällig am 15.02.2027 | | 3.000 | 2.533 | 0,07 |
| 5,500 % fällig am 01.03.2030 | | 2.000 | 1.475 | 0,04 |
| **Sirius XM Radio, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.09.2031 | | 3.000 | 2.395 | 0,07 |
| 4,000 % fällig am 15.07.2028 | | 10.000 | 8.685 | 0,25 |
| 5,000 % fällig am 01.08.2027 | | 5.000 | 4.649 | 0,13 |
| **SM Energy Co.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.07.2028 | | 2.000 | 1.842 | 0,05 |
| 6,625 % fällig am 15.01.2027 | | 4.000 | 3.745 | 0,11 |
| **Southwestern Energy Co.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.02.2029 | | 6.275 | 5.832 | 0,17 |
| 5,375 % fällig am 15.03.2030 | | 8.500 | 7.837 | 0,22 |
| **Spectrum Brands, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.03.2031 | | 5.000 | 4.037 | 0,11 |
| 4,000 % fällig am 01.10.2026 | € | 2.000 | 1.983 | 0,06 |
| 5,000 % fällig am 01.10.2029 | $ | 2.000 | 1.732 | 0,05 |
| 5,750 % fällig am 15.07.2025 | | 480 | 475 | 0,01 |
| **Spirit AeroSystems, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2025 | | 2.750 | 2.549 | 0,07 |
| 7,500 % fällig am 15.04.2025 | | 4.625 | 4.309 | 0,12 |
| **Sprint Capital Corp.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.11.2028 | | 2.000 | 2.109 | 0,06 |
| 8,750 % fällig am 15.03.2032 | | 10.000 | 12.067 | 0,34 |
| **Sprint Corp.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 15.02.2025 | | 10.000 | 10.442 | 0,30 |
| **SRS Distribution, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 01.07.2028 | | 7.000 | 6.136 | 0,17 |
| 6,000 % fällig am 01.12.2029 | | 7.000 | 5.506 | 0,16 |
| 6,125 % fällig am 01.07.2029 | | 5.000 | 3.952 | 0,11 |
| **Standard Industries, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 21.11.2026 | € | 20.000 | 16.421 | 0,47 |
| 3,375 % fällig am 15.01.2031 | $ | 7.500 | 5.547 | 0,16 |
| 4,375 % fällig am 15.07.2030 | | 5.000 | 3.953 | 0,11 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2028 | | 5.000 | 4.289 | 0,12 |
| **Staples, Inc.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.04.2026 | | 8.500 | 7.071 | 0,20 |
| **Station Casinos LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.02.2028 | | 4.000 | 3.384 | 0,10 |
| 4,625 % fällig am 01.12.2031 | | 2.000 | 1.563 | 0,04 |
| **Suburban Propane Partners LP** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.06.2031 | | 5.750 | 4.899 | 0,14 |
| **Summer BC Bidco LLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 31.10.2026 | | 5.000 | 4.486 | 0,13 |
| **Switch Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.09.2028 | | 2.500 | 2.476 | 0,07 |
| **Syneos Health, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.01.2029 | | 5.000 | 4.240 | 0,12 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.02.2029 | | 7.000 | 5.911 | 0,17 |
| 2,875 % fällig am 15.02.2031 | | 7.750 | 6.449 | 0,18 |
| 3,375 % fällig am 15.04.2029 | | 4.000 | 3.512 | 0,10 |
| 3,500 % fällig am 15.04.2031 | | 5.000 | 4.327 | 0,12 |
| **Tallgrass Energy Partners LP** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2028 | | 5.000 | 4.258 | 0,12 |
| 6,000 % fällig am 31.12.2030 | | 3.000 | 2.494 | 0,07 |
| 7,500 % fällig am 01.10.2025 | | 2.000 | 1.939 | 0,06 |
| **Team Health Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.02.2025 | | 10.000 | 6.998 | 0,20 |
| **TEGNA, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.03.2028 | | 4.000 | 3.751 | 0,11 |
| 4,750 % fällig am 15.03.2026 | | 2.000 | 1.923 | 0,05 |
| 5,000 % fällig am 15.09.2029 | | 7.500 | 7.114 | 0,20 |
| **Tenet Healthcare Corp.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.01.2030 | | 6.750 | 5.724 | 0,16 |
| 4,625 % fällig am 15.06.2028 | | 5.000 | 4.361 | 0,12 |
| 4,875 % fällig am 01.01.2026 | | 2.000 | 1.847 | 0,05 |
| 5,125 % fällig am 01.11.2027 | | 5.000 | 4.509 | 0,13 |
| 6,125 % fällig am 01.10.2028 | | 10.000 | 8.589 | 0,24 |
| 6,125 % fällig am 15.06.2030 | $ | 5.000 | $ 4.628 | 0,13 |
| 6,250 % fällig am 01.02.2027 | | 4.000 | 3.690 | 0,10 |
| 6,750 % fällig am 15.06.2023 | | 5.000 | 5.150 | 0,15 |
| **Terminix Co. LLC** | | | | |
| 7,450 % fällig am 15.08.2027 | | 3.500 | 3.928 | 0,11 |
| **TerraForm Power Operating LLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.01.2030 | | 2.500 | 2.146 | 0,06 |
| 5,000 % fällig am 31.01.2028 | | 7.500 | 6.807 | 0,19 |
| **TK Elevator U.S. Newco, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.07.2027 | | 4.950 | 4.422 | 0,13 |
| **TransDigm, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.01.2029 | | 8.750 | 7.064 | 0,20 |
| 5,500 % fällig am 15.11.2027 | | 10.000 | 8.517 | 0,24 |
| 6,250 % fällig am 15.03.2026 | | 6.000 | 5.802 | 0,16 |
| 6,375 % fällig am 15.06.2026 | | 2.000 | 1.874 | 0,05 |
| **Travel + Leisure Co.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 01.03.2030 | | 5.000 | 3.882 | 0,11 |
| 6,625 % fällig am 31.07.2026 | | 4.000 | 3.800 | 0,11 |
| **TriNet Group, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.03.2029 | | 5.000 | 4.126 | 0,12 |
| **Triumph Group, Inc.** | | | | |
| 8,875 % fällig am 01.06.2024 | | 4.022 | 4.056 | 0,12 |
| **Twilio, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.03.2029 | | 4.000 | 3.370 | 0,10 |
| 3,875 % fällig am 15.03.2031 | | 3.875 | 3.196 | 0,09 |
| **U.S. Foods, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 01.06.2030 | | 2.250 | 1.900 | 0,05 |
| 4,750 % fällig am 15.02.2029 | | 8.000 | 7.007 | 0,20 |
| 6,250 % fällig am 15.04.2025 | | 5.000 | 4.998 | 0,14 |
| **Uber Technologies, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.08.2029 | | 12.500 | 10.305 | 0,29 |
| **United Airlines, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.04.2026 | | 4.000 | 3.539 | 0,10 |
| 4,625 % fällig am 15.04.2029 | | 10.000 | 8.517 | 0,24 |
| **United Wholesale Mortgage LLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.11.2025 | | 2.000 | 1.717 | 0,05 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.05.2029 | | 10.000 | 8.402 | 0,24 |
| 5,125 % fällig am 15.02.2025 | | 5.000 | 4.715 | 0,13 |
| 6,625 % fällig am 01.06.2027 | | 7.000 | 6.678 | 0,19 |
| **Venture Global Calcasieu Pass LLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.08.2029 | | 3.250 | 2.852 | 0,08 |
| 3,875 % fällig am 01.11.2033 | | 2.500 | 2.070 | 0,06 |
| 4,125 % fällig am 15.08.2031 | | 3.350 | 2.873 | 0,08 |
| **Veritas U.S., Inc.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 01.09.2025 | | 4.000 | 3.010 | 0,09 |
| **Vertiv Group Corp.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.11.2028 | | 10.250 | 8.338 | 0,24 |
| **ViaSat, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.09.2025 | | 3.750 | 3.038 | 0,09 |
| 5,625 % fällig am 15.04.2027 | | 825 | 715 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 15.07.2028 | | 3.500 | 2.415 | 0,07 |
| **Victoria's Secret & Co.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.07.2029 | | 4.000 | 3.020 | 0,09 |
| **WESCO Distribution, Inc.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.06.2028 | | 7.500 | 7.436 | 0,21 |
| **Western Midstream Operating LP** | | | | |
| 5,450 % fällig am 01.04.2044 | | 2.000 | 1.666 | 0,05 |
| 5,750 % fällig am 01.02.2050 | | 12.000 | 9.672 | 0,27 |
| **White Cap Buyer LLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.10.2028 | | 7.250 | 5.810 | 0,17 |
| **White Cap Parent LLC (8,250 % bar oder 8,250 % PIK)** | | | | |
| 8,250 % fällig am 15.03.2026 (a) | | 3.000 | 2.502 | 0,07 |
| **WMG Acquisition Corp.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.08.2031 | € | 3.500 | 2.788 | 0,08 |
| 2,750 % fällig am 15.07.2028 | | 2.500 | 2.217 | 0,06 |
| 3,875 % fällig am 15.07.2030 | $ | 7.000 | 5.833 | 0,17 |
| **WR Grace Holdings LLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.06.2027 | | 5.000 | 4.357 | 0,12 |
| 5,625 % fällig am 15.08.2029 | | 6.850 | 5.060 | 0,14 |
| **WW International, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.04.2029 | | 5.000 | 3.337 | 0,09 |
| **Wyndham Hotels & Resorts, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.08.2028 | | 5.000 | 4.380 | 0,12 |
| **Wynn Las Vegas LLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 30.05.2023 | | 3.000 | 2.884 | 0,08 |
| 5,250 % fällig am 15.05.2027 | | 5.000 | 4.289 | 0,12 |
| 5,500 % fällig am 01.03.2025 | | 2.000 | 1.834 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Yum! Brands, Inc.** | | | |
| 3,625 % fällig am 15.03.2031 | $ 5.000 | $ 4.212 | 0,12 |
| 4,625 % fällig am 31.01.2032 | 2.000 | 1.773 | 0,05 |
| 6,875 % fällig am 15.11.2037 | 2.000 | 2.034 | 0,06 |
| **Zayo Group Holdings, Inc.** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.03.2027 | 5.000 | 4.157 | 0,12 |
| 6,125 % fällig am 01.03.2028 | 5.000 | 3.624 | 0,10 |
| **ZoomInfo Technologies LLC** | | | |
| 3,875 % fällig am 01.02.2029 | 5.500 | 4.616 | 0,13 |
| | | 2.017.837 | 57,25 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | |
| **RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.** | | | |
| 5,416 % fällig am 16.11.2025 | 4.327 | 4.047 | 0,12 |
| **Team Health Holdings, Inc.** | | | |
| 4,416 % fällig am 06.02.2024 | 11.844 | 10.580 | 0,30 |
| **U.S. Renal Care, Inc.** | | | |
| 6,688 % fällig am 26.06.2026 | 9.725 | 6.697 | 0,19 |
| **Welbilt, Inc.** | | | |
| 4,166 % fällig am 23.10.2025 | 4.000 | 3.950 | 0,11 |
| | | 25.274 | 0,72 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **NON-AGENCY-MBS** | | | |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | |
| 3,370 % fällig am 25.03.2036 ^ | 50 | 42 | 0,00 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | 1.142 | 798 | 0,03 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,922 % fällig am 19.10.2036 ^ | $ 362 | $ 230 | 0,01 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,872 % fällig am 19.03.2037 | 84 | 76 | 0,00 |
| **Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust** | | | |
| 3,990 % fällig am 25.02.2036 ^ | 91 | 81 | 0,00 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 1,316 % fällig am 25.05.2047 ^ | 29 | 4 | 0,00 |
| 1,446 % fällig am 25.05.2046 ^ | 76 | 62 | 0,00 |
| | | 1.293 | 0,04 |
| Summe USA | | 2.044.949 | 58,02 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **U.S. TREASURY BILLS** | | | |
| 0,074 % fällig am 08.09.2022 (c)(d) | 67.000 | 66.804 | 1,90 |
| 0,567 % fällig am 08.09.2022 (c)(d) | 32.400 | 32.305 | 0,92 |
| 1,051 % fällig am 08.09.2022 (c)(d) | 8.300 | 8.275 | 0,23 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 107.384 | 3,05 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | **$ 3.207.768** | **91,02** |
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (f)** | 1.219.084 | $ 10.411 | 0,30 |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (f)** | 3.637.652 | 35.558 | 1,01 |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)** | 18.226.836 | 181.320 | 5,14 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$ 227.289** | **6,45** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 8.443 | U.S. Treasury Notes, 3,000 % fällig am 30.06.2024 | $ (8.612) | $ 8.443 | $ 8.443 | 0,24 |
| NOM | 1,420 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 99.900 | U.S. Treasury Notes, 0,875 % fällig am 30.06.2026 | (102.150) | 99.900 | 99.904 | 2,83 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (110.762)** | **$ 108.343** | **$ 108.347** | **3,07** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-37 5-Year Index | 5,000 % | 20.12.2026 | $ 19.800 | $ (2.031) | (0,06) |
| CDX.HY-38 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2027 | 59.400 | (2.024) | (0,06) |
| | | | | $ (4.055) | (0,12) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | **$ (4.055)** | **(0,12)** |

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

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

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

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

### TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nenn-betrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 1,044 % | $ 15.900 | 20.03.2023 | $ (20) | $ (90) | $ (110) | 0,00 |
| JPM | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 1,044 | 2.500 | 20.09.2022 | (3) | (17) | (20) | 0,00 |
| MYC | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 1,044 | 40.500 | 20.09.2022 | (45) | (993) | (1.038) | (0,03) |
| | | | | | | | $ (68) | $ (1.100) | $ (1.168) | (0,03) |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | € | 228 | $ | 241 | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 48.412 | | 61.212 | 2.418 | 0 | 2.418 | 0,07 |
| BPS | 07.2022 | € | 2.388 | | 2.532 | 36 | 0 | 36 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 161 | | 197 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 25.772 | € | 24.337 | 0 | (330) | (330) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 1.670 | £ | 1.326 | 0 | (60) | (60) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | € | 4.118 | $ | 4.421 | 116 | 0 | 116 | 0,00 |
| HUS | 07.2022 | | 855.800 | | 922.891 | 28.196 | 0 | 28.196 | 0,80 |
| | 07.2022 | $ | 881.783 | € | 838.197 | 0 | (5.491) | (5.491) | (0,16) |
| | 08.2022 | CAD | 764 | $ | 596 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 838.197 | | 883.386 | 5.475 | 0 | 5.475 | 0,16 |
| MYI | 07.2022 | | 217 | | 228 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 25 | | 30 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 18.605 | € | 17.750 | 0 | (48) | (48) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 6.438 | £ | 5.310 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| RBC | 08.2022 | CAD | 2.166 | $ | 1.674 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | $ | 57.505 | £ | 47.251 | 0 | (120) | (120) | 0,00 |
| | 08.2022 | £ | 47.251 | $ | 57.532 | 120 | 0 | 120 | 0,00 |
| | | | | | | $ 36.380 | $ (6.054) | $ 30.326 | 0,86 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | CHF | 606 | $ | 608 | $ 0 | $ (25) | $ (25) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 14.599 | CHF | 13.951 | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CHF | 4 | $ | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 269 | CHF | 258 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | | 14.589 | | 13.964 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | CHF | 12.066 | $ | 12.702 | 99 | 0 | 99 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 14.251 | CHF | 13.670 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 12.702 | | 12.045 | 0 | (98) | (98) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | CHF | 2.824 | $ | 2.891 | 0 | (59) | (59) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 182 | | 190 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 7 | CHF | 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | CHF | 50 | $ | 52 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 128 | $ (212) | $ (84) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) ausschüttend 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 | 07.2022 | € | 2.405 | $ | 2.581 | $ 67 | $ 0 | $ 67 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | | 482.501 | | 507.517 | 3.086 | 0 | 3.086 | 0,09 |
| | 07.2022 | $ | 13.869 | € | 13.002 | 0 | (276) | (276) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 469.949 | | 445.991 | 0 | (2.826) | (2.826) | (0,08) |
| CBK | 07.2022 | € | 147 | $ | 156 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 7.738 | € | 7.207 | 0 | (203) | (203) | (0,01) |
| MBC | 07.2022 | € | 446.936 | $ | 470.173 | 2.925 | (2) | 2.923 | 0,08 |
| | 07.2022 | $ | 529.274 | € | 491.248 | 0 | (15.700) | (15.700) | (0,44) |
| | 08.2022 | | 470.036 | | 445.991 | 0 | (2.913) | (2.913) | (0,08) |
| SOG | 07.2022 | | 499.305 | | 464.553 | 0 | (13.638) | (13.638) | (0,39) |
| UAG | 07.2022 | | 422.933 | | 393.572 | 0 | (11.473) | (11.473) | (0,32) |
| | | | | | | $ 6.081 | $ (47.031) | $ (40.950) | (1,16) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Administrative GBP (Hedged) ausschüttend und Class E GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | £ | 103 | $ | 126 | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 287.752 | £ | 227.587 | 0 | (11.359) | (11.359) | (0,32) |
| BPS | 07.2022 | £ | 13.234 | $ | 16.037 | 13 | (48) | (35) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 4.153 | £ | 3.302 | 0 | (143) | (143) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | | 284.340 | | 225.414 | 0 | (10.586) | (10.586) | (0,30) |
| CBK | 07.2022 | | 360 | | 287 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | £ | 489 | $ | 601 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 989 | £ | 785 | 0 | (36) | (36) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | £ | 40.205 | $ | 49.444 | 617 | (1) | 616 | 0,02 |
| SCX | 07.2022 | | 9 | | 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | | 201.310 | | 244.994 | 513 | 0 | 513 | 0,01 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08.2022 | $ 245.108 | £ 201.310 | $ 0 | $ (510) | $ (510) | (0,02) |
| TOR | 07.2022 | 282.845 | 224.352 | 0 | (10.381) | (10.381) | (0,30) |
| | | | | $ 1.152 | $ (33.076) | $ (31.924) | (0,91) |

Zum 30. Juni 2022 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 Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | SGD 901 | $ 649 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 1.441 | SGD 1.975 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 08.2022 | 649 | 901 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | SGD 1.808 | $ 1.301 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 7 | SGD 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 1.301 | 1.808 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | SGD 73 | $ 53 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 40 | SGD 55 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | SGD 42 | $ 31 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 11 | SGD 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | 19 | 25 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 1.490 | 2.036 | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | SGD 105 | $ 76 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 1.542 | SGD 2.112 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| | | | | $ 3 | $ (77) | $ (74) | 0,00 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (43.874)** | **(1,24)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 3.495.471** | **99,18** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ 28.939** | **0,82** |
| **Nettovermögen** | **$ 3.524.410** | **100,00** |

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

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

**^ Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

**(b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

**(c) Nullkuponwertpapier.**

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

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

**(f) Mit dem Fonds verbunden.**

**(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(h) Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|
| Deutsche Bank AG 3,729 % fällig am 14.01.2032 | 11.01.2021 - 16.03.2021 | $ 6.946 | $ 5.269 | 0,15 |
| Diamond Foreign Asset Co, (9,000 % Cash or 9,000 % PIK) 9,000 % fällig am 22.04.2027 | 12.05.2021 | 66 | 65 | 0,00 |
| Diamond Offshore Drilling, Inc. | 12.05.2021 | 0 | 169 | 0,00 |
| Occidental Petroleum Corp, 6,125 % fällig am 01.01.2031 | 08.12.2020 | 1.250 | 1.270 | 0,04 |
| | | $ 8.262 | $ 6.773 | 0,19 |

**(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 62.714 und Barmittel in Höhe von USD 2.328 als Sicherheiten verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von USD 7.705 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 56.260 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 3.207.349 | $ 419 | $ 3.207.768 |
| Investmentfonds | 227.289 | 0 | 0 | 227.289 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 108.343 | 0 | 108.343 |
| Finanzderivate[3] | 0 | (47.929) | 0 | (47.929) |
| **Summen** | **$ 227.289** | **$ 3.267.763** | **$ 419** | **$ 3.495.471** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 4.998 | $ 4.666.725 | $ 11.498 | $ 4.683.221 |
| Investmentfonds | 417.716 | 0 | 0 | 417.716 |
| Finanzderivate[3] | 0 | 24.073 | 0 | 24.073 |
| **Summen** | **$ 422.714** | **$ 4.690.798** | **$ 11.498** | **$ 5.125.010** |

(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 2022:**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | (5,000) % | 23.05.2022 | TBD[1] | € (5.716) | $ (5.944) | (0,17) |
| | (1,650) | 23.05.2022 | TBD[1] | £ (1.620) | (1.963) | (0,05) |
| | (1,500) | 23.05.2022 | TBD[1] | € (1.699) | (1.774) | (0,05) |
| | (1,000) | 17.06.2022 | TBD[1] | $ (7.425) | (7.422) | (0,21) |
| | 0,850 | 23.06.2022 | TBD[1] | (2.403) | (2.404) | (0,07) |
| JML | (2,000) | 24.06.2022 | TBD[1] | £ (2.068) | (2.510) | (0,07) |
| | 1,400 | 17.06.2022 | 29.07.2022 | $ (2.878) | (2.879) | (0,08) |
| | 1,450 | 17.06.2022 | 29.07.2022 | (6.670) | (6.674) | (0,19) |
| | 1,500 | 17.06.2022 | 29.07.2022 | (20.317) | (20.329) | (0,58) |
| TDM | 1,750 | 17.06.2022 | TBD[1] | (4.442) | (4.445) | (0,13) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (56.344)** | **(1,60)** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (9.054) | $ 9.160 | $ 106 |
| BPS | (546) | 680 | 134 |
| BRC | (10.586) | 9.850 | (736) |
| CBK | (98) | 250 | 152 |
| DUB | 28 | 0 | 28 |
| JPM | (20) | 0 | (20) |
| MBC | 12.465 | (11.310) | 1.155 |
| MYC | (1.038) | 970 | (68) |
| MYI | 521 | (910) | (389) |
| RBC | (5) | 0 | (5) |
| SCX | (27) | 0 | (27) |
| SOG | (13.635) | 14.110 | 475 |
| TOR | (10.381) | 10.860 | 479 |
| UAG | (11.498) | 10.380 | (1.118) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 42,14 | 45,83 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 47,41 | 44,25 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 1,47 | 0,53 |
| Investmentfonds | 6,45 | 8,08 |
| Pensionsgeschäfte | 3,07 | k. A. |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,12) | (0,02) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (1,24) | 0,48 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (1,60) | (0,31) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Belgien | 0,24 | 0,25 |
| Bermuda | 0,40 | 0,33 |
| Kanada | 2,24 | 2,27 |
| Cayman-Inseln | 0,64 | 0,65 |
| Frankreich | 2,11 | 2,26 |
| Deutschland | 3,58 | 3,19 |
| Irland | 0,28 | 0,26 |
| Italien | 3,74 | 3,55 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,23 | 0,19 |
| Liberia | 0,23 | 0,19 |
| Luxemburg | 2,70 | 2,65 |
| Mauritius | k. A. | 0,13 |
| Multinational | 1,95 | 1,82 |
| Niederlande | 4,20 | 4,22 |
| Norwegen | 0,34 | 0,23 |
| Panama | 0,57 | 0,65 |
| Spanien | 1,28 | 1,19 |
| Schweden | 0,91 | 0,85 |
| Schweiz | 0,12 | 0,10 |
| Großbritannien | 4,19 | 4,19 |
| USA | 58,02 | 59,85 |
| Kurzfristige Instrumente | 3,05 | 1,59 |
| Investmentfonds | 6,45 | 8,08 |
| Pensionsgeschäfte | 3,07 | k. A. |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,12) | (0,02) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Total Return Swaps auf Indizes | (0,03) | 0,02 |
| Devisenterminkontrakte | 0,86 | (0,23) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (2,07) | 0,69 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 0,82 | 0,85 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Boral Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.05.2028 | $ | 1.600 | $ 1.506 | 0,01 |
| **CIMIC Finance Ltd.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 28.05.2029 | € | 4.300 | 3.240 | 0,03 |
| **GAIF Bond Issuer Pty. Ltd.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 14.12.2028 | AUD | 23.500 | 13.119 | 0,12 |
| **GTA Finance Co. Pty. Ltd.** | | | | |
| 2,200 % fällig am 26.08.2027 | | 7.200 | 4.206 | 0,04 |
| **Lendlease Finance Ltd.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 27.10.2027 | | 9.900 | 6.084 | 0,06 |
| **Macquarie University** | | | | |
| 3,500 % fällig am 07.09.2028 | | 250 | 159 | 0,00 |
| **Optus Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 20.06.2029 | € | 6.800 | 6.234 | 0,06 |
| **Pacific National Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 22.03.2028 | $ | 15.900 | 15.215 | 0,14 |
| **Qantas Airways Ltd.** | | | | |
| 3,150 % fällig am 27.09.2028 | AUD | 500 | 287 | 0,00 |
| **Santos Finance Ltd.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 14.09.2027 | $ | 8.200 | 7.716 | 0,07 |
| 5,250 % fällig am 13.03.2029 | | 17.200 | 16.604 | 0,15 |
| **Woodside Finance Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 04.03.2029 | | 26.390 | 25.419 | 0,23 |
| | | | 99.789 | 0,91 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Australia Government International Bond** | | | | |
| 1,000 % fällig am 21.11.2031 | AUD | 51.800 | 28.168 | 0,25 |
| 1,250 % fällig am 21.05.2032 | | 24.000 | 13.233 | 0,12 |
| 4,500 % fällig am 21.04.2033 | | 59.700 | 44.037 | 0,40 |
| | | | 85.438 | 0,77 |
| Summe Australien | | | 185.227 | 1,68 |
| **ÖSTERREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Erste Group Bank AG** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.10.2027 (f)(h) | € | 20.800 | 17.201 | 0,15 |
| 5,125 % fällig am 15.10.2025 (f)(h) | | 7.600 | 7.325 | 0,07 |
| Summe Österreich | | | 24.526 | 0,22 |
| **BELGIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Euroclear Bank S.A.** | | | | |
| 0,250 % fällig am 07.09.2022 | | 400 | 418 | 0,00 |
| **KBC Group NV** | | | | |
| 4,250 % fällig am 24.10.2025 (f)(h) | | 12.000 | 10.899 | 0,10 |
| **Sofina S.A.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 23.09.2028 | | 9.300 | 7.656 | 0,07 |
| Summe Belgien | | | 18.973 | 0,17 |
| **BERMUDA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **MAPS Ltd.** | | | | |
| 4,212 % fällig am 15.05.2043 | $ | 6.884 | 6.388 | 0,06 |
| **S-Jets Ltd.** | | | | |
| 3,967 % fällig am 15.08.2042 | | 13.649 | 12.016 | 0,11 |
| **START Ireland PLC** | | | | |
| 4,089 % fällig am 15.03.2044 | | 3.206 | 2.941 | 0,03 |
| | | | 21.345 | 0,20 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aircastle Ltd.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 26.01.2028 | | 6.400 | 5.296 | 0,05 |
| 4,250 % fällig am 15.06.2026 | | 3.050 | 2.826 | 0,02 |
| **Arch Capital Group Ltd.** | | | | |
| 3,635 % fällig am 30.06.2050 | | 2.760 | 2.152 | 0,02 |
| **Bacardi Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.07.2026 | $ | 1.350 | $ 1.245 | 0,01 |
| 4,450 % fällig am 15.05.2025 | | 10.410 | 10.317 | 0,09 |
| 4,700 % fällig am 15.05.2028 | | 26.330 | 26.033 | 0,24 |
| **Sompo International Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,700 % fällig am 15.10.2022 | | 4.200 | 4.216 | 0,04 |
| **Viking Cruises Ltd.** | | | | |
| 13,000 % fällig am 15.05.2025 | | 4.300 | 4.413 | 0,04 |
| | | | 56.498 | 0,51 |
| Summe Bermuda | | | 77.843 | 0,71 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Bradesco S.A.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 27.01.2023 | | 300 | 299 | 0,00 |
| **Banco BTG Pactual S.A.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 10.01.2025 | | 14.200 | 13.695 | 0,12 |
| 5,500 % fällig am 31.01.2023 | | 19.277 | 19.351 | 0,18 |
| **Banco Daycoval S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 13.12.2024 | | 17.370 | 16.719 | 0,15 |
| **Banco do Brasil S.A.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.01.2025 | | 11.763 | 11.571 | 0,10 |
| 4,750 % fällig am 20.03.2024 | | 1.500 | 1.492 | 0,01 |
| **Cielo USA, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 16.11.2022 | | 5.200 | 5.187 | 0,05 |
| **CSN Resources S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 08.04.2032 | | 8.100 | 6.176 | 0,06 |
| 7,625 % fällig am 17.04.2026 | | 1.636 | 1.657 | 0,02 |
| **Vale Overseas Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 10.11.2039 | | 2.300 | 2.453 | 0,02 |
| Summe Brasilien | | | 78.600 | 0,71 |
| **KANADA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Air Canada Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,300 % fällig am 15.07.2031 | | 2.572 | 2.345 | 0,02 |
| 3,600 % fällig am 15.09.2028 | | 5.976 | 5.670 | 0,05 |
| 3,750 % fällig am 15.06.2029 | | 2.843 | 2.688 | 0,02 |
| 4,125 % fällig am 15.11.2026 | | 3.562 | 3.328 | 0,03 |
| 5,250 % fällig am 01.10.2030 | | 4.057 | 4.061 | 0,04 |
| **Bank of Nova Scotia** | | | | |
| 4,900 % fällig am 04.06.2025 (f)(h) | | 21.800 | 20.268 | 0,18 |
| **Brookfield Finance, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 30.03.2051 | | 19.100 | 13.777 | 0,13 |
| 3,900 % fällig am 25.01.2028 | | 3.000 | 2.869 | 0,03 |
| 4,700 % fällig am 20.09.2047 | | 2.300 | 2.020 | 0,02 |
| 4,850 % fällig am 29.03.2029 | | 8.834 | 8.758 | 0,08 |
| **CI Financial Corp.** | | | | |
| 4,100 % fällig am 15.06.2051 | | 5.600 | 3.637 | 0,03 |
| **Enbridge, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.12.2026 | | 10.504 | 10.405 | 0,10 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028 | € | 29.600 | 28.670 | 0,26 |
| 4,850 % fällig am 17.04.2028 | $ | 100 | 100 | 0,00 |
| | | | 108.596 | 0,99 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Canada Government International Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 01.12.2048 | CAD | 500 | 358 | 0,00 |
| **Province of Ontario** | | | | |
| 2,050 % fällig am 02.06.2030 | | 11.700 | 7.929 | 0,07 |
| 2,600 % fällig am 02.06.2025 | | 151.500 | 114.719 | 1,04 |
| **Province of Quebec** | | | | |
| 1,900 % fällig am 01.09.2030 | | 4.500 | 3.007 | 0,03 |
| | | | 126.013 | 1,14 |
| Summe Kanada | | | 234.609 | 2,13 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd.** | | | | |
| 4,213 % fällig am 16.12.2041 | $ | 5.791 | 5.127 | 0,05 |
| **ECAF Ltd.** | | | | |
| 4,947 % fällig am 15.06.2040 | | 9.468 | 5.989 | 0,05 |
| **KDAC Aviation Finance Ltd.** | | | | |
| 4,212 % fällig am 15.12.2042 | $ | 5.626 | $ 4.557 | 0,04 |
| **METAL Cayman LLC** | | | | |
| 4,581 % fällig am 15.10.2042 | | 13.293 | 10.480 | 0,10 |
| **Sapphire Aviation Finance Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.03.2040 | | 9.451 | 7.901 | 0,07 |
| **Thunderbolt Aircraft Lease Ltd.** | | | | |
| 4,212 % fällig am 17.05.2032 | | 3.192 | 2.750 | 0,02 |
| | | | 36.804 | 0,33 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Alibaba Group Holding Ltd.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 09.02.2031 | | 8.100 | 6.706 | 0,06 |
| 4,400 % fällig am 06.12.2057 | | 8.200 | 6.748 | 0,06 |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | |
| 2,528 % fällig am 18.11.2027 | | 14.256 | 11.633 | 0,11 |
| 2,875 % fällig am 15.02.2025 | | 8.300 | 7.645 | 0,07 |
| 4,250 % fällig am 15.04.2026 | | 3.600 | 3.338 | 0,03 |
| 4,375 % fällig am 01.05.2026 | | 2.310 | 2.143 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2026 | | 18.600 | 18.070 | 0,16 |
| **Baidu, Inc.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 06.07.2022 | | 500 | 500 | 0,00 |
| **China Modern Dairy Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 14.07.2026 | | 9.400 | 8.192 | 0,07 |
| **CIFI Holdings Group Co. Ltd.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 12.04.2027 | | 4.100 | 2.225 | 0,02 |
| 6,450 % fällig am 07.11.2024 | | 5.500 | 3.539 | 0,03 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 12.07.2026 | | 8.900 | 4.179 | 0,04 |
| 3,125 % fällig am 22.10.2025 | | 11.750 | 5.787 | 0,05 |
| 3,875 % fällig am 22.10.2030 | | 3.700 | 1.563 | 0,01 |
| **Geely Automobile Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 25.01.2023 | | 11.600 | 11.592 | 0,11 |
| **Goodman HK Finance** | | | | |
| 4,375 % fällig am 19.06.2024 | | 3.500 | 3.520 | 0,03 |
| **KWG Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 01.09.2023 | | 1.700 | 436 | 0,00 |
| **MAF Global Securities Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 07.05.2024 | | 3.700 | 3.714 | 0,03 |
| **Melco Resorts Finance Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 06.06.2025 | | 31.560 | 23.631 | 0,22 |
| 5,250 % fällig am 26.04.2026 | | 17.850 | 12.616 | 0,12 |
| 5,375 % fällig am 04.12.2029 | | 9.227 | 5.583 | 0,05 |
| 5,625 % fällig am 17.07.2027 | | 11.555 | 7.762 | 0,07 |
| 5,750 % fällig am 21.07.2028 | | 2.600 | 1.677 | 0,02 |
| **MGM China Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 18.06.2025 | | 8.300 | 6.380 | 0,06 |
| 5,375 % fällig am 15.05.2024 | | 1.255 | 1.071 | 0,01 |
| 5,875 % fällig am 15.05.2026 | | 6.746 | 5.110 | 0,05 |
| **New Metro Global Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 02.05.2026 | | 2.000 | 925 | 0,01 |
| 6,800 % fällig am 05.08.2023 | | 4.900 | 3.357 | 0,03 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2023 | | 18.490 | 18.428 | 0,17 |
| **Powerlong Real Estate Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 30.04.2025 | | 14.500 | 2.320 | 0,02 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 28.03.2024 | | 14.500 | 14.439 | 0,13 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 2,550 % fällig am 08.03.2027 | | 1.000 | 730 | 0,01 |
| 3,100 % fällig am 08.03.2029 | | 1.500 | 1.064 | 0,01 |
| 3,250 % fällig am 08.08.2031 | | 1.300 | 861 | 0,01 |
| 3,800 % fällig am 08.01.2026 | | 3.900 | 3.131 | 0,03 |
| 5,125 % fällig am 08.08.2025 | | 12.200 | 10.255 | 0,09 |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028 | | 21.248 | 16.417 | 0,15 |
| **Sitka Holdings LLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 06.07.2026 | | 4.400 | 4.259 | 0,04 |
| **Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 23.01.2023 | | 6.914 | 6.920 | 0,06 |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,390 % fällig am 03.06.2030 | | 11.900 | 9.971 | 0,09 |
| 3,240 % fällig am 03.06.2050 | | 5.200 | 3.595 | 0,03 |
| 3,290 % fällig am 03.06.2060 | | 4.700 | 3.119 | 0,03 |
| 3,595 % fällig am 19.01.2028 | | 4.400 | 4.184 | 0,04 |
| 3,975 % fällig am 11.04.2029 | | 52.350 | 49.638 | 0,45 |
| **Tencent Music Entertainment Group** | | | | |
| 2,000 % fällig am 03.09.2030 | | 2.800 | 2.189 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Tingyi Cayman Islands Holding Corp.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 24.09.2025 | $ | 11.500 | $ 10.586 | 0,10 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.10.2024 | | 4.635 | 3.453 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2026 | | 20.557 | 14.269 | 0,13 |
| 5,500 % fällig am 01.10.2027 | | 17.265 | 11.198 | 0,10 |
| **Xiaomi Best Time International Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 14.07.2031 | | 1.900 | 1.473 | 0,01 |
| **Zhongsheng Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 13.01.2026 | | 7.100 | 6.620 | 0,06 |
| | | | 368.761 | 3,35 |
| Summe Cayman Inseln | | | 405.565 | 3,68 |
| **CHILE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Santander Chile** | | | | |
| 2,700 % fällig am 10.01.2025 | | 4.100 | 3.929 | 0,03 |
| **Celeo Redes Operacion Chile S.A.** | | | | |
| 5,200 % fällig am 22.06.2047 | | 3.255 | 2.979 | 0,03 |
| **Empresa Electrica Cochrane SpA** | | | | |
| 5,500 % fällig am 14.05.2027 | | 1.170 | 986 | 0,01 |
| Summe Chile | | | 7.894 | 0,07 |
| **CHINA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Amber Circle Funding Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 04.12.2022 | | 33.625 | 33.636 | 0,30 |
| **Bank of China Luxembourg S.A.** | | | | |
| 0,125 % fällig am 16.01.2023 | € | 11.800 | 12.291 | 0,11 |
| **Industrial & Commercial Bank of China Ltd.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 16.09.2022 | $ | 2.400 | 2.398 | 0,02 |
| **New Metro Global Ltd.** | | | | |
| 4,800 % fällig am 15.12.2024 | | 11.600 | 6.380 | 0,06 |
| **Shanghai Port Group BVI Development Co. Ltd.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 13.07.2030 | | 5.500 | 4.786 | 0,04 |
| 3,375 % fällig am 18.06.2029 | | 7.800 | 7.402 | 0,07 |
| **Sinopec Group Overseas Development Ltd.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 13.09.2022 | | 6.200 | 6.195 | 0,06 |
| **SPIC MTN Co. Ltd.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 27.07.2025 | | 7.900 | 7.397 | 0,07 |
| **State Grid Overseas Investment BVI Ltd.** | | | | |
| 0,797 % fällig am 05.08.2026 | € | 12.223 | 11.600 | 0,11 |
| 2,125 % fällig am 02.05.2030 | | 5.400 | 5.118 | 0,05 |
| **Yili Holding Investment Ltd.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 19.11.2025 | $ | 29.100 | 26.772 | 0,24 |
| | | | 123.975 | 1,13 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **China Development Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 27.10.2023 (d) | € | 5.800 | 5.959 | 0,05 |
| Summe China | | | 129.934 | 1,18 |
| **KOLUMBIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BanColombia S.A.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 29.01.2025 | $ | 2.500 | 2.308 | 0,02 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **GN Store Nord A/S** | | | | |
| 0,875 % fällig am 25.11.2024 | € | 13.800 | 13.661 | 0,12 |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | DKK | 9.009 | 1.041 | 0,01 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 4.229 | 468 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 103.974 | 11.488 | 0,10 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 9.578 | 1.035 | 0,01 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 7.114 | 823 | 0,01 |
| 4,125 % fällig am 15.04.2026 (f)(h) | € | 12.600 | 12.075 | 0,11 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 35.117 | 3.878 | 0,04 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 3.689 | 381 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | DKK | 7.122 | $ 825 | 0,01 |
| Summe Dänemark | | | 45.675 | 0,41 |
| **FINNLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Balder Finland Oyj** | | | | |
| 1,000 % fällig am 20.01.2029 | € | 14.100 | 9.304 | 0,09 |
| **Nokia Oyj** | | | | |
| 4,375 % fällig am 12.06.2027 | $ | 2.800 | 2.649 | 0,02 |
| **Nordea Bank Abp** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.03.2029 (f)(h) | | 4.000 | 2.956 | 0,03 |
| **SATO Oyj** | | | | |
| 1,375 % fällig am 24.02.2028 | € | 6.671 | 5.548 | 0,05 |
| Summe Finnland | | | 20.457 | 0,19 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Accor S.A.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 29.11.2028 | | 4.500 | 3.749 | 0,03 |
| **Altarea S.C.A.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 16.01.2030 | | 11.200 | 8.355 | 0,08 |
| 1,875 % fällig am 17.01.2028 | | 9.000 | 7.499 | 0,07 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 1,675 % fällig am 30.06.2027 | $ | 3.700 | 3.266 | 0,03 |
| 1,875 % fällig am 14.12.2027 | £ | 12.000 | 12.906 | 0,12 |
| 1,904 % fällig am 30.09.2028 | $ | 4.700 | 4.020 | 0,04 |
| 2,219 % fällig am 09.06.2026 | | 23.100 | 21.357 | 0,19 |
| 2,591 % fällig am 20.01.2028 | | 9.800 | 8.822 | 0,08 |
| 3,500 % fällig am 16.11.2027 | | 20.000 | 18.681 | 0,17 |
| 4,625 % fällig am 25.02.2031 (f)(h) | | 9.800 | 7.257 | 0,07 |
| 7,000 % fällig am 16.08.2028 (f)(h) | | 5.805 | 5.522 | 0,05 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 13.10.2046 (h) | € | 10.000 | 7.535 | 0,07 |
| **Bureau Veritas S.A.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 07.09.2023 | | 300 | 312 | 0,00 |
| 1,875 % fällig am 06.01.2025 | | 15.400 | 15.918 | 0,14 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 23.12.2027 (f)(h) | | 2.900 | 2.582 | 0,02 |
| 7,500 % fällig am 23.06.2026 (f)(h) | £ | 5.138 | 6.084 | 0,06 |
| **Holding d'Infrastructures de Transport SASU** | | | | |
| 1,475 % fällig am 18.01.2031 | € | 12.200 | 10.377 | 0,09 |
| 1,625 % fällig am 18.09.2029 | | 3.700 | 3.330 | 0,03 |
| **Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement** | | | | |
| 0,625 % fällig am 16.09.2028 | | 3.200 | 2.691 | 0,02 |
| **Indigo Group S.A.S.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 19.04.2028 | | 9.800 | 9.077 | 0,08 |
| **New Immo Holding S.A.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 26.11.2026 | | 2.800 | 2.558 | 0,02 |
| **Peugeot Invest** | | | | |
| 1,875 % fällig am 30.10.2026 | | 18.500 | 17.848 | 0,16 |
| **SEB S.A.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 16.06.2025 | | 6.900 | 6.926 | 0,06 |
| 2,375 % fällig am 25.11.2022 | | 1.900 | 1.989 | 0,02 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 25.01.2027 | | 4.400 | 4.070 | 0,04 |
| 1,488 % fällig am 14.12.2026 | $ | 13.400 | 11.840 | 0,11 |
| 4,000 % fällig am 12.01.2027 | | 2.000 | 1.905 | 0,02 |
| **TDF Infrastructure SASU** | | | | |
| 1,750 % fällig am 01.12.2029 | € | 9.100 | 7.876 | 0,07 |
| 2,500 % fällig am 07.04.2026 | | 7.300 | 7.226 | 0,07 |
| **Ubisoft Entertainment S.A.** | | | | |
| 0,878 % fällig am 24.11.2027 | | 18.600 | 16.066 | 0,15 |
| 1,289 % fällig am 30.01.2023 | | 6.500 | 6.798 | 0,06 |
| **Worldline S.A.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 13.09.2024 | | 9.600 | 9.816 | 0,09 |
| | | | 254.258 | 2,31 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Numericable Group S.A.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.07.2025 | | 4.250 | 4.083 | 0,04 |
| Summe Frankreich | | | 258.341 | 2,35 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bayer AG** | | | | |
| 0,050 % fällig am 12.01.2025 | € | 4.700 | $ 4.641 | 0,04 |
| 0,625 % fällig am 12.07.2031 | | 1.000 | 798 | 0,01 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 1,375 % fällig am 17.02.2032 | | 2.800 | 2.238 | 0,02 |
| 1,625 % fällig am 20.01.2027 | | 18.600 | 17.437 | 0,16 |
| 1,750 % fällig am 19.11.2030 | | 40.300 | 34.796 | 0,32 |
| 2,311 % fällig am 16.11.2027 | $ | 2.800 | 2.419 | 0,02 |
| 2,625 % fällig am 16.12.2024 | £ | 15.000 | 17.357 | 0,16 |
| 3,547 % fällig am 18.09.2031 | $ | 12.643 | 10.596 | 0,10 |
| 3,729 % fällig am 14.01.2032 (j) | | 11.235 | 8.456 | 0,08 |
| 3,961 % fällig am 26.11.2025 | | 600 | 580 | 0,01 |
| **Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide** | | | | |
| 1,625 % fällig am 09.07.2024 | € | 9.200 | 9.319 | 0,08 |
| 1,875 % fällig am 31.03.2028 | | 9.700 | 8.901 | 0,08 |
| 2,125 % fällig am 09.07.2027 | | 14.700 | 14.034 | 0,13 |
| **Hamburg Commercial Bank AG** | | | | |
| 0,500 % fällig am 22.09.2026 | | 100 | 94 | 0,00 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK)** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2025 (b) | | 300 | 274 | 0,00 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.09.2026 (b) | | 19.800 | 17.219 | 0,16 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** | | | | |
| 0,375 % fällig am 15.03.2023 | | 4.600 | 4.814 | 0,04 |
| **Sixt SE** | | | | |
| 1,750 % fällig am 09.12.2024 | | 19.170 | 19.607 | 0,18 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 1,875 % fällig am 31.01.2024 | | 7.200 | 7.484 | 0,07 |
| 2,500 % fällig am 31.07.2026 | | 6.700 | 6.795 | 0,06 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 12.02.2025 (d) | | 11.750 | 11.408 | 0,10 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2024 | | 9.200 | 9.429 | 0,08 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** | | | | |
| 1,125 % fällig am 04.04.2024 | | 5.500 | 5.648 | 0,05 |
| 1,375 % fällig am 20.01.2025 | | 2.600 | 2.632 | 0,02 |
| 1,500 % fällig am 19.06.2026 | | 11.500 | 11.311 | 0,10 |
| **Vonovia SE** | | | | |
| 0,250 % fällig am 01.09.2028 | | 7.600 | 6.184 | 0,06 |
| Summe Deutschland | | | 234.471 | 2,13 |
| **GUERNSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Amdocs Ltd.** | | | | |
| 2,538 % fällig am 15.06.2030 | $ | 5.975 | 5.039 | 0,05 |
| **Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.11.2024 | | 2.861 | 2.836 | 0,03 |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 29.07.2026 | € | 16.900 | 14.220 | 0,13 |
| 3,000 % fällig am 29.03.2025 | | 2.700 | 2.489 | 0,02 |
| **Sirius Real Estate Ltd.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 22.06.2026 | | 8.500 | 7.686 | 0,07 |
| 1,750 % fällig am 24.11.2028 | | 10.100 | 8.187 | 0,07 |
| Summe Guernsey, Kanalinseln | | | 40.457 | 0,37 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Huarong Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 30.09.2023 | $ | 17.000 | 16.201 | 0,14 |
| **Lenovo Group Ltd.** | | | | |
| 3,421 % fällig am 02.11.2030 | | 6.400 | 5.455 | 0,05 |
| | | | 21.656 | 0,19 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Airport Authority Hong Kong** | | | | |
| 2,100 % fällig am 08.03.2026 (f) | | 2.550 | 2.318 | 0,02 |
| 2,400 % fällig am 08.03.2028 (f) | | 2.350 | 2.030 | 0,02 |
| 3,450 % fällig am 21.02.2029 | | 5.500 | 5.354 | 0,05 |
| | | | 9.702 | 0,09 |
| Summe Hongkong | | | 31.358 | 0,28 |
| **INDIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Adani Transmission Step-One Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 21.05.2036 | | 18.288 | 15.431 | 0,14 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Bharti Airtel Ltd.** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 10.06.2025 | $ | 5.000 | $ | 4.983 | 0,05 |
| **ReNew Power Pvt Ltd.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 05.03.2027 | | 8.300 | | 7.605 | 0,07 |
| **Shriram Transport Finance Co. Ltd.** | | | | | |
| 5,950 % fällig am 24.10.2022 | | 19.900 | | 19.683 | 0,18 |
| | | | | 47.702 | 0,44 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Export-Import Bank of India** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.02.2028 | | 300 | | 287 | 0,00 |
| Summe Indien | | | | 47.989 | 0,44 |
| **INDONESIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Bank Mandiri Persero Tbk PT** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 11.04.2024 | | 9.100 | | 9.051 | 0,08 |
| **Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT** | | | | | |
| 4,625 % fällig am 20.07.2023 | | 11.900 | | 11.975 | 0,11 |
| **Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 30.06.2030 | | 1.000 | | 822 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 30.06.2050 | | 7.800 | | 5.439 | 0,05 |
| 4,125 % fällig am 15.05.2027 | | 6.900 | | 6.640 | 0,06 |
| 4,875 % fällig am 17.07.2049 | | 700 | | 546 | 0,00 |
| 6,150 % fällig am 21.05.2048 | | 2.300 | | 2.110 | 0,02 |
| | | | | 36.583 | 0,33 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia** | | | | | |
| 2,800 % fällig am 23.06.2030 | | 6.600 | | 5.793 | 0,05 |
| 4,450 % fällig am 20.02.2029 | | 800 | | 794 | 0,01 |
| | | | | 6.587 | 0,06 |
| Summe Indonesien | | | | 43.170 | 0,39 |
| **IRLAND** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | | |
| 1,150 % fällig am 29.10.2023 | | 11.310 | | 10.784 | 0,10 |
| 1,650 % fällig am 29.10.2024 | | 2.900 | | 2.681 | 0,02 |
| 2,193 % fällig am 29.09.2023 | | 4.900 | | 4.834 | 0,04 |
| 2,450 % fällig am 29.10.2026 | | 3.200 | | 2.789 | 0,03 |
| 2,875 % fällig am 14.08.2024 | | 3.300 | | 3.146 | 0,03 |
| 3,150 % fällig am 15.02.2024 | | 6.200 | | 6.004 | 0,06 |
| 4,450 % fällig am 01.10.2025 | | 400 | | 387 | 0,00 |
| 4,450 % fällig am 03.04.2026 | | 5.475 | | 5.235 | 0,05 |
| 4,875 % fällig am 16.01.2024 | | 2.400 | | 2.389 | 0,02 |
| **AIB Group PLC** | | | | | |
| 4,263 % fällig am 10.04.2025 | | 11.300 | | 11.089 | 0,10 |
| **Bank of Ireland Group PLC** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.09.2025 (f)(h) | € | 9.109 | | 8.798 | 0,08 |
| **GE Capital UK Funding Unlimited Co.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 18.01.2033 | £ | 800 | | 1.078 | 0,01 |
| **Perrigo Finance Unlimited Co.** | | | | | |
| 4,400 % fällig am 15.06.2030 | $ | 10.050 | | 8.982 | 0,08 |
| 4,900 % fällig am 15.12.2044 | | 5.300 | | 3.833 | 0,04 |
| **SMBC Aviation Capital Finance DAC** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.07.2022 | | 1.300 | | 1.300 | 0,01 |
| 3,550 % fällig am 15.04.2024 | | 3.800 | | 3.700 | 0,03 |
| 4,125 % fällig am 15.07.2023 | | 6.600 | | 6.547 | 0,06 |
| **Zurich Finance Ireland Designated Activity Co.** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 02.05.2052 | | 8.400 | | 6.824 | 0,06 |
| Summe Irland | | | | 90.400 | 0,82 |
| **ITALIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Aeroporti di Roma SpA** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 02.02.2029 | € | 2.400 | | 2.104 | 0,02 |
| 1,750 % fällig am 30.07.2031 | | 11.700 | | 9.378 | 0,08 |
| 5,441 % fällig am 20.02.2023 | £ | 2.500 | | 3.069 | 0,03 |
| **AMCO - Asset Management Co. SpA** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 17.07.2023 | € | 35.900 | | 37.679 | 0,34 |
| **Atlantia SpA** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 03.02.2025 | | 14.100 | | 13.479 | 0,12 |
| 1,875 % fällig am 13.07.2027 | | 16.520 | | 14.090 | 0,13 |
| 1,875 % fällig am 12.02.2028 | | 1.600 | | 1.306 | 0,01 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 09.01.2026 | € | 27.200 | $ | 23.816 | 0,22 |
| 2,625 % fällig am 28.04.2025 | | 16.100 | | 14.953 | 0,13 |
| 3,625 % fällig am 24.09.2024 | | 8.925 | | 8.634 | 0,08 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 23.09.2029 | $ | 10.600 | | 9.457 | 0,09 |
| 5,017 % fällig am 26.06.2024 | | 5.900 | | 5.635 | 0,05 |
| 5,710 % fällig am 15.01.2026 | | 14.819 | | 14.140 | 0,13 |
| 5,875 % fällig am 01.09.2031 (f)(h) | € | 4.000 | | 3.268 | 0,03 |
| 7,750 % fällig am 11.01.2027 (f)(h) | | 22.042 | | 21.929 | 0,20 |
| **Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 09.10.2025 | | 2.800 | | 2.933 | 0,03 |
| **UniCredit SpA** | | | | | |
| 2,200 % fällig am 22.07.2027 | | 2.150 | | 2.054 | 0,02 |
| 5,459 % fällig am 30.06.2035 | $ | 4.194 | | 3.393 | 0,03 |
| 7,296 % fällig am 02.04.2034 | | 12.230 | | 11.250 | 0,10 |
| 7,500 % fällig am 03.06.2026 (f)(h) | € | 2.467 | | 2.387 | 0,02 |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | $ | 62.000 | | 64.227 | 0,58 |
| | | | | 269.181 | 2,44 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Italy Government International Bond** | | | | | |
| 6,875 % fällig am 27.09.2023 | | 10.700 | | 11.111 | 0,10 |
| Summe Italien | | | | 280.292 | 2,54 |
| **JAPAN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | | |
| 0,953 % fällig am 19.07.2025 | | 14.400 | | 13.451 | 0,12 |
| 1,538 % fällig am 20.07.2027 | | 9.500 | | 8.408 | 0,08 |
| 2,048 % fällig am 17.07.2030 | | 15.400 | | 12.573 | 0,11 |
| 3,195 % fällig am 18.07.2029 | | 5.600 | | 5.057 | 0,05 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | | |
| 1,979 % fällig am 08.09.2031 | | 7.100 | | 5.626 | 0,05 |
| 2,201 % fällig am 10.07.2031 | | 9.100 | | 7.392 | 0,07 |
| 2,721 % fällig am 16.07.2023 | | 13.550 | | 13.551 | 0,12 |
| **Nippon Life Insurance Co.** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 18.10.2042 | | 16.300 | | 16.353 | 0,15 |
| **Nissan Motor Co. Ltd.** | | | | | |
| 1,940 % fällig am 15.09.2023 | € | 16.640 | | 17.314 | 0,16 |
| 2,652 % fällig am 17.03.2026 | | 3.600 | | 3.520 | 0,03 |
| 3,043 % fällig am 15.09.2023 | $ | 3.100 | | 3.050 | 0,03 |
| 3,201 % fällig am 17.09.2028 | € | 4.700 | | 4.378 | 0,04 |
| 4,345 % fällig am 17.09.2027 | $ | 16.820 | | 15.453 | 0,14 |
| 4,810 % fällig am 17.09.2030 | | 6.550 | | 5.825 | 0,05 |
| **Nomura Holdings, Inc.** | | | | | |
| 1,851 % fällig am 16.07.2025 | | 25.950 | | 23.798 | 0,22 |
| 2,172 % fällig am 14.07.2028 | | 5.000 | | 4.217 | 0,04 |
| 2,679 % fällig am 16.07.2030 | | 1.800 | | 1.474 | 0,01 |
| 2,710 % fällig am 22.01.2029 | | 9.800 | | 8.374 | 0,08 |
| 3,103 % fällig am 16.01.2030 | | 4.500 | | 3.832 | 0,03 |
| **Panasonic Holdings Corp.** | | | | | |
| 2,536 % fällig am 19.07.2022 | | 6.600 | | 6.600 | 0,06 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | | |
| 2,440 % fällig am 18.06.2024 | | 11.500 | | 11.297 | 0,10 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | | |
| 0,465 % fällig am 30.05.2024 | € | 3.300 | | 3.344 | 0,03 |
| 2,130 % fällig am 08.07.2030 | $ | 3.500 | | 2.883 | 0,03 |
| 2,696 % fällig am 16.07.2024 | | 4.700 | | 4.575 | 0,04 |
| 2,750 % fällig am 15.01.2030 | | 2.600 | | 2.263 | 0,02 |
| 3,102 % fällig am 17.01.2023 | | 4.200 | | 4.200 | 0,04 |
| Summe Japan | | | | 208.808 | 1,90 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.07.2043 | £ | 10.640 | | 12.667 | 0,12 |
| 4,875 % fällig am 31.07.2043 | | 400 | | 483 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 31.07.2050 | | 7.782 | | 9.240 | 0,08 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 11.09.2025 | € | 33.900 | | 32.484 | 0,30 |
| 3,625 % fällig am 17.10.2022 | | 5.253 | | 5.462 | 0,05 |
| **Heathrow Funding Ltd.** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 12.07.2032 | | 2.800 | | 2.435 | 0,02 |
| **HSBC Bank Capital Funding Sterling LP** | | | | | |
| 5,844 % fällig am 05.11.2031 (f) | £ | 18.367 | | 25.612 | 0,23 |
| Summe Jersey, Kanalinseln | | | | 88.383 | 0,80 |
| **LUXEMBURG** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Altice Financing S.A.** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.08.2029 | € | 1.300 | $ | 1.029 | 0,01 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 16.07.2026 (d) | | 14.300 | | 12.159 | 0,11 |
| 0,375 % fällig am 15.04.2027 | | 2.400 | | 1.959 | 0,02 |
| 3,000 % fällig am 16.10.2029 | £ | 1.300 | | 1.332 | 0,01 |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | $ | 48.200 | | 44.674 | 0,40 |
| **Becton Dickinson Euro Finance SARL** | | | | | |
| 0,334 % fällig am 13.08.2028 | € | 4.500 | | 3.945 | 0,04 |
| 1,336 % fällig am 13.08.2041 | | 5.180 | | 3.421 | 0,03 |
| **Bevco Lux SARL** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 16.01.2030 | | 3.700 | | 3.060 | 0,03 |
| 1,500 % fällig am 16.09.2027 | | 23.000 | | 21.761 | 0,20 |
| **CK Hutchison Group Telecom Finance S.A.** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 17.04.2026 | | 3.600 | | 3.480 | 0,03 |
| 1,125 % fällig am 17.10.2028 | | 8.000 | | 7.179 | 0,06 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 27.01.2031 | | 10.500 | | 7.300 | 0,07 |
| 1,625 % fällig am 23.04.2027 | | 34.550 | | 28.897 | 0,26 |
| 1,750 % fällig am 14.01.2030 | | 10.900 | | 8.078 | 0,07 |
| 2,750 % fällig am 12.05.2026 | | 15.300 | | 14.253 | 0,13 |
| 2,750 % fällig am 22.01.2028 | £ | 2.100 | | 1.972 | 0,02 |
| **Cromwell Ereit Lux Finco SARL** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 19.11.2025 | € | 19.575 | | 16.751 | 0,15 |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.** | | | | | |
| 2,949 % fällig am 24.01.2024 | | 500 | | 170 | 0,00 |
| 3,125 % fällig am 17.11.2023 | | 1.800 | | 800 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 06.04.2024 | £ | 7.500 | | 3.074 | 0,03 |
| 4,950 % fällig am 19.07.2022 | $ | 4.000 | | 3.100 | 0,03 |
| 5,150 % fällig am 11.02.2026 | | 29.300 | | 9.522 | 0,09 |
| **Helvetia Europe S.A.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.09.2041 | € | 4.700 | | 4.091 | 0,04 |
| **Lincoln Financing SARL** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.04.2024 | | 3.300 | | 3.349 | 0,03 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 13.07.2026 | | 5.700 | | 5.351 | 0,05 |
| 1,625 % fällig am 15.07.2027 | | 41.500 | | 37.542 | 0,34 |
| 2,750 % fällig am 15.01.2030 | £ | 1.530 | | 1.603 | 0,01 |
| 3,250 % fällig am 13.11.2028 | € | 2.409 | | 2.276 | 0,02 |
| **NE Property BV** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 09.10.2026 | | 3.500 | | 3.076 | 0,03 |
| 2,000 % fällig am 20.01.2030 | | 7.000 | | 5.208 | 0,05 |
| 3,375 % fällig am 14.07.2027 | | 11.700 | | 10.548 | 0,09 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 29.10.2022 ^ | $ | 61.150 | | 4.280 | 0,04 |
| 5,250 % fällig am 23.05.2023 ^(h) | | 12.200 | | 854 | 0,01 |
| | | | | 276.094 | 2,51 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | | |
| **Delos Finance SARL** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 06.10.2023 | | 18.243 | | 18.060 | 0,16 |
| Summe Luxemburg | | | | 294.154 | 2,67 |
| **MAURITIUS** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Azure Power Solar Energy Pvt Ltd.** | | | | | |
| 5,650 % fällig am 24.12.2024 | | 2.800 | | 2.655 | 0,02 |
| **Greenko Investment Co.** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 16.08.2023 | | 5.600 | | 5.425 | 0,05 |
| **Greenko Power Ltd.** | | | | | |
| 4,300 % fällig am 13.12.2028 | | 4.594 | | 3.681 | 0,03 |
| **Greenko Solar Mauritius Ltd.** | | | | | |
| 5,550 % fällig am 29.01.2025 | | 15.400 | | 14.476 | 0,13 |
| 5,950 % fällig am 29.07.2026 | | 6.900 | | 6.167 | 0,06 |
| **India Green Energy Holdings** | | | | | |
| 5,375 % fällig am 29.04.2024 | | 9.900 | | 9.263 | 0,09 |
| Summe Mauritius | | | | 41.667 | 0,38 |
| | | **AKTIEN** | | | |
| **MEXIKO** | | | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | | |
| **Desarrolladora Homex S.A.B. de C.V. (c)** | | 427.064 | | 1 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Inbursa S.A.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 11.04.2027 | $ | 4.993 | $ 4.781 | 0,04 |
| **Banco Mercantil del Norte S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.01.2027 (f)(h) | | 11.300 | 9.379 | 0,09 |
| 6,625 % fällig am 24.01.2032 (f)(h) | | 9.600 | 7.858 | 0,07 |
| **BBVA Bancomer S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 30.09.2022 | | 10.950 | 10.988 | 0,10 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 2,750 % fällig am 21.04.2027 | € | 200 | 157 | 0,00 |
| 3,750 % fällig am 21.02.2024 | | 100 | 101 | 0,00 |
| 4,875 % fällig am 21.02.2028 | | 500 | 415 | 0,00 |
| 6,700 % fällig am 16.02.2032 | $ | 9.186 | 7.024 | 0,07 |
| 6,750 % fällig am 21.09.2047 | | 5.632 | 3.497 | 0,03 |
| **Trust Fibra Uno** | | | | |
| 4,869 % fällig am 15.01.2030 | | 1.900 | 1.610 | 0,02 |
| | | | 45.810 | 0,42 |
| Summe Mexiko | | | 45.811 | 0,42 |
| **MULTINATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Delta Air Lines, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 20.10.2025 | | 12.900 | 12.547 | 0,11 |
| 4,750 % fällig am 20.10.2028 | | 3.600 | 3.403 | 0,03 |
| Summe multinational | | | 15.950 | 0,14 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | |
| 4,375 % fällig am 22.09.2025 (f)(h) | € | 9.700 | 9.011 | 0,08 |
| **AerCap Holdings NV** | | | | |
| 5,875 % fällig am 10.10.2079 | $ | 4.000 | 3.432 | 0,03 |
| **ASR Nederland NV** | | | | |
| 3,375 % fällig am 02.05.2049 | € | 4.300 | 3.963 | 0,04 |
| 4,625 % fällig am 19.10.2027 (f)(h) | | 6.300 | 5.549 | 0,05 |
| **Atrium Finance Issuer BV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.09.2027 | | 12.300 | 10.409 | 0,09 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 3,100 % fällig am 29.06.2028 (f)(h) | | 1.600 | 1.261 | 0,01 |
| 4,375 % fällig am 29.06.2027 (f)(h) | | 19.800 | 18.262 | 0,17 |
| 4,625 % fällig am 29.12.2025 (f)(h) | | 5.400 | 5.205 | 0,05 |
| **CTP NV** | | | | |
| 0,500 % fällig am 21.06.2025 | | 9.400 | 8.383 | 0,08 |
| 1,250 % fällig am 21.06.2029 | | 12.100 | 8.839 | 0,08 |
| **Digital Dutch Finco BV** | | | | |
| 1,000 % fällig am 15.01.2032 | | 2.600 | 1.940 | 0,02 |
| 1,250 % fällig am 01.02.2031 | | 3.000 | 2.360 | 0,02 |
| **easyJet FinCo BV** | | | | |
| 1,875 % fällig am 03.03.2028 | | 120 | 101 | 0,00 |
| **Enel Finance International NV** | | | | |
| 1,875 % fällig am 12.07.2028 | $ | 600 | 504 | 0,00 |
| 2,650 % fällig am 10.09.2024 | | 2.050 | 1.987 | 0,02 |
| **IMCD NV** | | | | |
| 2,500 % fällig am 26.03.2025 | € | 4.700 | 4.585 | 0,04 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 0,375 % fällig am 29.09.2028 | | 4.300 | 3.822 | 0,03 |
| 4,875 % fällig am 16.05.2029 (f)(h) | $ | 26.700 | 21.878 | 0,20 |
| 5,750 % fällig am 16.11.2026 (f)(h) | | 12.000 | 10.990 | 0,10 |
| **JAB Holdings BV** | | | | |
| 1,000 % fällig am 20.12.2027 | € | 5.000 | 4.468 | 0,04 |
| 2,200 % fällig am 23.11.2030 | $ | 20.150 | 15.913 | 0,14 |
| 2,250 % fällig am 19.12.2039 | € | 4.800 | 3.281 | 0,03 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 0,125 % fällig am 13.09.2023 | | 6.340 | 6.478 | 0,06 |
| 2,875 % fällig am 24.10.2024 | $ | 1.020 | 978 | 0,01 |
| 7,375 % fällig am 29.05.2024 (f)(h) | € | 1.000 | 1.023 | 0,01 |
| **Prosus NV** | | | | |
| 1,539 % fällig am 03.08.2028 | | 3.700 | 3.069 | 0,03 |
| 2,031 % fällig am 03.08.2032 | | 25.780 | 18.687 | 0,17 |
| 3,832 % fällig am 08.02.2051 | $ | 5.300 | 3.202 | 0,03 |
| 4,027 % fällig am 03.08.2050 | | 3.800 | 2.366 | 0,02 |
| 4,193 % fällig am 19.01.2032 | | 3.800 | 3.038 | 0,03 |
| 4,987 % fällig am 19.01.2052 | | 3.500 | 2.519 | 0,02 |
| **Sagax Euro MTN NL BV** | | | | |
| 0,750 % fällig am 26.01.2028 | € | 5.800 | 4.673 | 0,04 |
| 1,625 % fällig am 24.02.2026 | | 5.900 | 5.628 | 0,05 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 3,375 % fällig am 16.04.2026 | € | 18.100 | $ 18.699 | 0,17 |
| 4,441 % fällig am 24.04.2023 | $ | 3.100 | 3.126 | 0,03 |
| 4,892 % fällig am 24.04.2025 | | 8.500 | 8.530 | 0,08 |
| 5,182 % fällig am 24.04.2028 | | 39.017 | 39.534 | 0,36 |
| **Volkswagen Financial Services NV** | | | | |
| 0,875 % fällig am 20.02.2025 | £ | 7.000 | 7.807 | 0,07 |
| 1,125 % fällig am 18.09.2023 | | 13.700 | 16.088 | 0,15 |
| 1,625 % fällig am 30.11.2022 | | 15.400 | 18.590 | 0,17 |
| 1,875 % fällig am 03.12.2024 | | 1.800 | 2.076 | 0,02 |
| **WPC Eurobond BV** | | | | |
| 1,350 % fällig am 15.04.2028 | € | 5.400 | 4.733 | 0,04 |
| | | | 316.987 | 2,88 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **EMF-NL Prime BV** | | | | |
| 0,352 % fällig am 17.04.2041 | | 580 | 576 | 0,01 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 1,052 % fällig am 17.10.2040 | | 281 | 294 | 0,00 |
| | | | 870 | 0,01 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **BNG Bank NV** | | | | |
| 2,375 % fällig am 16.03.2026 | $ | 9.300 | 9.028 | 0,08 |
| Summe Niederlande | | | 326.885 | 2,97 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Yara International ASA** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.06.2028 | | 19.300 | 18.502 | 0,17 |
| **PANAMA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco General S.A.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 07.08.2027 | | 5.150 | 4.889 | 0,04 |
| **Intercorp Financial Services, Inc.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 19.10.2027 | | 5.600 | 5.079 | 0,05 |
| | | | 9.968 | 0,09 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Carnival Corp.** | | | | |
| 3,750 % - 3,975 % fällig am 30.06.2025 | € | 14.073 | 13.646 | 0,12 |
| Summe Panama | | | 23.614 | 0,21 |
| **PERU** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco de Credito del Peru S.A.** | | | | |
| 4,650 % fällig am 17.09.2024 | PEN | 9.800 | 2.388 | 0,02 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,350 % fällig am 12.08.2040 | | 24.550 | 4.843 | 0,04 |
| 5,400 % fällig am 12.08.2034 | | 10.800 | 2.297 | 0,02 |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | | 53.150 | 12.785 | 0,12 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 54.830 | 12.766 | 0,12 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 | | 121.787 | 30.223 | 0,27 |
| 8,200 % fällig am 12.08.2026 | | 311.700 | 85.787 | 0,78 |
| | | | 148.701 | 1,35 |
| Summe Peru | | | 151.089 | 1,37 |
| **KATAR** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 4,400 % fällig am 16.04.2050 | $ | 11.300 | 10.813 | 0,10 |
| **RUMÄNIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Romania Government International Bond** | | | | |
| 1,375 % fällig am 02.12.2029 | € | 3.425 | 2.593 | 0,02 |
| 1,750 % fällig am 13.07.2030 | | 7.650 | 5.717 | 0,05 |
| 2,125 % fällig am 07.03.2028 | | 7.200 | 6.212 | 0,06 |
| 2,625 % fällig am 02.12.2040 | | 22.600 | 13.771 | 0,12 |
| 2,875 % fällig am 13.04.2042 | | 8.200 | 5.033 | 0,05 |
| Summe Rumänien | | | 33.326 | 0,30 |
| **RUSSLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **MMK International Capital DAC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 13.06.2024 | $ | 4.900 | $ 1.764 | 0,02 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Russia Government International Bond** | | | | |
| 7,650 % fällig am 10.04.2030 ^ | RUB | 2.389.000 | 3.927 | 0,03 |
| 8,500 % fällig am 17.09.2031 ^ | | 2.385.500 | 3.921 | 0,04 |
| | | | 7.848 | 0,07 |
| Summe Russland | | | 9.612 | 0,09 |
| **SAUDI-ARABIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Saudi Arabia Government International Bond** | | | | |
| 2,250 % fällig am 02.02.2033 | $ | 20.200 | 16.832 | 0,16 |
| 2,875 % fällig am 04.03.2023 | | 5.800 | 5.793 | 0,05 |
| Summe Saudi-Arabien | | | 22.625 | 0,21 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 18.09.2022 | | 18.500 | 18.484 | 0,17 |
| 3,500 % fällig am 10.10.2024 | | 8.700 | 8.602 | 0,08 |
| 3,500 % fällig am 18.09.2027 | | 18.720 | 17.971 | 0,16 |
| **Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.** | | | | |
| 1,832 % fällig am 10.09.2030 (h) | | 13.500 | 12.472 | 0,11 |
| **SP PowerAssets Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 26.09.2027 | | 2.400 | 2.321 | 0,02 |
| **United Overseas Bank Ltd.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 16.03.2031 (h) | | 3.500 | 3.171 | 0,03 |
| Summe Singapur | | | 63.021 | 0,57 |
| **SLOWAKEI** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Slovakia Government International Bond** | | | | |
| 1,875 % fällig am 09.03.2037 | € | 500 | 462 | 0,00 |
| **SLOWENIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Nova Kreditna Banka Maribor d.d.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 27.01.2025 | | 10.700 | 10.566 | 0,10 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AngloGold Ashanti Holdings PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 01.11.2028 | $ | 5.500 | 4.664 | 0,04 |
| 3,750 % fällig am 01.10.2030 | | 7.800 | 6.434 | 0,06 |
| **Growthpoint Properties International Pty. Ltd.** | | | | |
| 5,872 % fällig am 02.05.2023 | | 3.050 | 3.048 | 0,03 |
| | | | 14.146 | 0,13 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 10,500 % fällig am 21.12.2026 | ZAR | 1.385.100 | 89.532 | 0,81 |
| Summe Südafrika | | | 103.678 | 0,94 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Shinhan Bank Co. Ltd.** | | | | |
| 1,183 % fällig am 29.09.2025 | AUD | 7.200 | 4.456 | 0,04 |
| **Shinhan Financial Group Co. Ltd.** | | | | |
| 3,340 % fällig am 05.02.2030 (h) | $ | 3.000 | 2.902 | 0,03 |
| **SK Hynix, Inc.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 19.01.2024 | | 5.300 | 5.063 | 0,04 |
| Summe Südkorea | | | 12.421 | 0,11 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **SPANIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Abertis Infraestructuras S.A.** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 29.03.2029 | € | 4.700 | $ | 4.412 | 0,04 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (f)(h) | | 3.200 | | 3.221 | 0,03 |
| **Banco de Sabadell S.A.** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 11.03.2027 | | 3.600 | | 3.449 | 0,03 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 14.04.2026 | £ | 4.300 | | 4.702 | 0,04 |
| **Bankinter S.A.** | | | | | |
| 0,875 % fällig am 08.07.2026 | € | 7.600 | | 7.186 | 0,07 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 14.09.2028 (f)(h) | | 7.400 | | 5.349 | 0,05 |
| 5,875 % fällig am 09.10.2027 (f)(h) | | 23.000 | | 21.205 | 0,19 |
| Summe Spanien | | | | 49.524 | 0,45 |
| **SUPRANATIONAL** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 13.02.2025 | $ | 5.200 | | 4.994 | 0,05 |
| 1,625 % fällig am 27.09.2024 | | 500 | | 485 | 0,00 |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.11.2024 | £ | 15.350 | | 17.961 | 0,16 |
| Summe Supranational | | | | 23.440 | 0,21 |
| **SCHWEDEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Castellum AB** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 20.11.2023 | € | 4.300 | | 4.368 | 0,04 |
| **Fastighets AB Balder** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 29.01.2027 | | 4.500 | | 3.394 | 0,03 |
| **Sagax AB** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 30.01.2027 | | 4.200 | | 3.698 | 0,03 |
| 2,250 % fällig am 13.03.2025 | | 8.400 | | 8.352 | 0,08 |
| **Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 12.08.2027 (k) | | 18.600 | | 12.586 | 0,11 |
| 1,750 % fällig am 14.01.2025 | | 2.467 | | 1.894 | 0,02 |
| Summe Schweden | | | | 34.292 | 0,31 |
| **SCHWEIZ** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Credit Suisse AG** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (h) | $ | 95.950 | | 96.190 | 0,87 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.11.2029 | £ | 1.700 | | 1.711 | 0,02 |
| 2,593 % fällig am 11.09.2025 | $ | 18.030 | | 16.982 | 0,16 |
| 4,194 % fällig am 01.04.2031 | | 5.200 | | 4.606 | 0,04 |
| 4,207 % fällig am 12.06.2024 | | 31.150 | | 30.879 | 0,28 |
| 6,375 % fällig am 21.08.2026 (f)(h) | | 7.000 | | 5.801 | 0,05 |
| 7,125 % fällig am 29.07.2022 (f)(h) | | 1.700 | | 1.699 | 0,02 |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (f)(h) | | 20.600 | | 19.055 | 0,17 |
| 7,500 % fällig am 11.12.2023 (f)(h) | | 200 | | 191 | 0,00 |
| **UBS AG** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (h) | | 8.900 | | 8.898 | 0,08 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (h) | | 76.961 | | 77.191 | 0,70 |
| **UBS Group AG** | | | | | |
| 1,494 % fällig am 10.08.2027 | | 5.000 | | 4.379 | 0,04 |
| 2,746 % fällig am 11.02.2033 | | 3.300 | | 2.689 | 0,03 |
| 4,125 % fällig am 24.09.2025 | | 58.990 | | 58.610 | 0,53 |
| Summe Schweiz | | | | 328.881 | 2,99 |
| **THAILAND** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Bangkok Bank PCL** | | | | | |
| 3,466 % fällig am 23.09.2036 (h) | | 9.200 | | 7.710 | 0,07 |
| **TÜRKEI** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Turkish Airlines Pass-Through Trust** | | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.09.2028 | | 4.768 | | 3.967 | 0,04 |
| **UKRAINE** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Ukraine Government International Bond** | | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.09.2022 | $ | 7.600 | $ | 4.294 | 0,04 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **DAE Sukuk Difc Ltd.** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.02.2026 | | 8.600 | | 8.143 | 0,07 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Babcock International Group PLC** | | | | | |
| 1,375 % fällig am 13.09.2027 (k) | € | 3.100 | | 2.868 | 0,03 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (h) | $ | 8.000 | | 8.080 | 0,07 |
| **Barclays PLC** | | | | | |
| 2,645 % fällig am 24.06.2031 | | 8.000 | | 6.629 | 0,06 |
| 3,250 % fällig am 12.02.2027 | £ | 8.503 | | 9.696 | 0,09 |
| 4,375 % fällig am 12.01.2026 | $ | 9.860 | | 9.775 | 0,09 |
| 4,375 % fällig am 15.03.2028 (f)(h) | | 200 | | 154 | 0,00 |
| 7,125 % fällig am 15.06.2025 (f)(h) | £ | 13.600 | | 15.889 | 0,14 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (f)(h) | | 22.350 | | 26.757 | 0,24 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (f)(h) | $ | 700 | | 689 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 15.06.2024 (f)(h) | | 4.300 | | 4.235 | 0,04 |
| **BAT International Finance PLC** | | | | | |
| 1,668 % fällig am 25.03.2026 | | 5.990 | | 5.311 | 0,05 |
| **Broadgate Financing PLC** | | | | | |
| 4,851 % fällig am 05.04.2033 | £ | 49 | | 66 | 0,00 |
| **Cadent Finance PLC** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 22.09.2038 | | 300 | | 282 | 0,00 |
| 2,750 % fällig am 22.09.2046 | | 3.200 | | 2.785 | 0,03 |
| **Chanel Ceres PLC** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 31.07.2026 | € | 11.800 | | 11.312 | 0,10 |
| 1,000 % fällig am 31.07.2031 | | 6.800 | | 5.880 | 0,05 |
| **Connect Plus M25 Issuer PLC** | | | | | |
| 2,607 % fällig am 31.03.2039 | £ | 2.085 | | 2.362 | 0,02 |
| **Direct Line Insurance Group PLC** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 05.06.2032 | | 1.200 | | 1.262 | 0,01 |
| **DWR Cymru Financing UK PLC** | | | | | |
| 3,514 % fällig am 31.03.2030 | | 28 | | 45 | 0,00 |
| **Ferguson Finance PLC** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 02.06.2030 | $ | 4.300 | | 3.727 | 0,03 |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 17.02.2027 | € | 22.400 | | 7.026 | 0,06 |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC** | | | | | |
| 2,950 % fällig am 27.01.2029 | $ | 31.700 | | 9.510 | 0,09 |
| 3,000 % fällig am 29.06.2027 | | 7.800 | | 2.340 | 0,02 |
| 3,250 % fällig am 25.02.2030 | | 11.200 | | 3.360 | 0,03 |
| **Grainger PLC** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 24.04.2028 | £ | 1.800 | | 1.972 | 0,02 |
| **Greene King Finance PLC** | | | | | |
| 3,368 % fällig am 15.03.2036 | | 900 | | 902 | 0,01 |
| 4,064 % fällig am 15.03.2035 | | 4.795 | | 5.514 | 0,05 |
| 5,106 % fällig am 15.03.2034 | | 95 | | 118 | 0,00 |
| 5,318 % fällig am 15.09.2031 | | 236 | | 297 | 0,00 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 24.07.2027 | | 21.760 | | 23.753 | 0,22 |
| 2,357 % fällig am 18.08.2031 | $ | 6.600 | | 5.356 | 0,05 |
| 2,848 % fällig am 04.06.2031 | | 8.500 | | 7.190 | 0,06 |
| 3,973 % fällig am 22.05.2030 | | 9.500 | | 8.734 | 0,08 |
| 4,041 % fällig am 13.03.2028 | | 17.400 | | 16.538 | 0,15 |
| 4,292 % fällig am 12.09.2026 | | 2.500 | | 2.446 | 0,02 |
| 4,600 % fällig am 17.12.2030 (f)(h) | | 11.900 | | 9.177 | 0,08 |
| 5,875 % fällig am 28.09.2026 (f)(h) | £ | 335 | | 370 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 29.09.2023 (f)(h) | € | 4.744 | | 4.918 | 0,04 |
| 6,500 % fällig am 23.03.2028 (f)(h) | $ | 17.335 | | 15.742 | 0,14 |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 26.07.2026 | | 21.660 | | 20.328 | 0,18 |
| 3,875 % fällig am 26.07.2029 | | 11.840 | | 10.675 | 0,10 |
| **Informa PLC** | | | | | |
| 1,250 % fällig am 22.04.2028 | € | 9.200 | | 8.433 | 0,08 |
| 1,500 % fällig am 05.07.2023 | | 13.250 | | 13.631 | 0,12 |
| 2,125 % fällig am 06.10.2025 | | 20.190 | | 20.503 | 0,19 |
| 3,125 % fällig am 05.07.2026 | £ | 100 | | 117 | 0,00 |
| **InterContinental Hotels Group PLC** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 08.10.2024 | € | 15.000 | | 15.010 | 0,14 |
| 3,375 % fällig am 08.10.2028 | £ | 10.800 | $ | 11.975 | 0,11 |
| 3,875 % fällig am 28.11.2022 | | 800 | | 976 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **John Lewis PLC** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 18.12.2034 | | 2.800 | | 2.587 | 0,02 |
| 6,125 % fällig am 21.01.2025 | | 2.050 | | 2.574 | 0,02 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 02.04.2032 | $ | 25.600 | | 16.472 | 0,15 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 16.10.2024 | £ | 900 | | 1.051 | 0,01 |
| 4,947 % fällig am 27.06.2025 (f)(h) | € | 5.200 | | 5.118 | 0,05 |
| 5,125 % fällig am 27.12.2024 (f)(h) | £ | 3.200 | | 3.584 | 0,03 |
| 5,125 % fällig am 27.12.2024 (f)(h) | | 900 | | 1.008 | 0,01 |
| **M&G PLC** | | | | | |
| 6,340 % fällig am 19.12.2063 | | 500 | | 555 | 0,01 |
| **Market Bidco Finco PLC** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 04.11.2027 | € | 11.500 | | 9.582 | 0,09 |
| **Marks & Spencer PLC** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 19.05.2026 | £ | 6.900 | | 7.377 | 0,07 |
| 6,000 % fällig am 12.06.2025 | | 6.409 | | 7.600 | 0,07 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | | |
| 1,738 % fällig am 15.12.2030 | | 675 | | 776 | 0,01 |
| 6,013 % fällig am 15.12.2030 | | 445 | | 551 | 0,01 |
| **Nationwide Building Society** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 20.12.2024 (f)(h) | | 12.150 | | 14.011 | 0,13 |
| **NatWest Group PLC** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.11.2025 | € | 800 | | 796 | 0,01 |
| 4,269 % fällig am 22.03.2025 | $ | 8.800 | | 8.717 | 0,08 |
| 4,800 % fällig am 05.04.2026 | | 8.800 | | 8.782 | 0,08 |
| 4,892 % fällig am 18.05.2029 | | 8.625 | | 8.367 | 0,08 |
| 5,076 % fällig am 27.01.2030 | | 8.560 | | 8.387 | 0,08 |
| **Pinnacle Bidco PLC** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.02.2025 | € | 800 | | 757 | 0,01 |
| **Quadgas Finance PLC** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 17.09.2029 | £ | 300 | | 336 | 0,00 |
| **Rolls-Royce PLC** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 09.05.2028 | € | 300 | | 235 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 15.10.2027 | £ | 800 | | 917 | 0,01 |
| **Sage Group PLC** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 25.02.2031 | | 1.500 | | 1.489 | 0,01 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | | |
| 2,920 % fällig am 08.05.2026 | | 2.700 | | 3.139 | 0,03 |
| 3,625 % fällig am 14.01.2026 | | 5.600 | | 6.641 | 0,06 |
| 4,750 % fällig am 15.09.2025 | $ | 18.557 | | 18.346 | 0,17 |
| 6,750 % fällig am 24.06.2024 (f)(h) | £ | 15.950 | | 18.692 | 0,17 |
| **Santander UK PLC** | | | | | |
| 1,626 % fällig am 12.02.2027 | | 11.800 | | 14.318 | 0,13 |
| **Scottish Power UK PLC** | | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.05.2023 | | 500 | | 627 | 0,01 |
| **Society of Lloyd's** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.10.2024 | | 1.200 | | 1.449 | 0,01 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | | |
| 1,456 % fällig am 14.01.2027 | $ | 16.100 | | 14.217 | 0,13 |
| 2,819 % fällig am 30.01.2026 | | 2.300 | | 2.180 | 0,02 |
| 3,265 % fällig am 18.02.2036 | | 5.700 | | 4.610 | 0,04 |
| 3,603 % fällig am 12.01.2033 | | 5.900 | | 4.831 | 0,04 |
| 4,644 % fällig am 01.04.2031 | | 9.100 | | 8.683 | 0,08 |
| **Telereal Secured Finance PLC** | | | | | |
| 4,010 % fällig am 10.12.2033 | £ | 245 | | 298 | 0,00 |
| **Tesco Property Finance PLC** | | | | | |
| 5,411 % fällig am 13.07.2044 | | 184 | | 227 | 0,00 |
| 5,744 % fällig am 13.04.2040 | | 964 | | 1.235 | 0,01 |
| 5,801 % fällig am 13.10.2040 | | 2.643 | | 3.395 | 0,03 |
| **TP ICAP Finance PLC** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 18.11.2028 | | 5.900 | | 5.907 | 0,05 |
| 5,250 % fällig am 26.01.2024 | | 9.086 | | 10.929 | 0,10 |
| 5,250 % fällig am 29.05.2026 | | 16.900 | | 20.076 | 0,18 |
| **Virgin Money UK PLC** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 24.06.2025 | € | 6.700 | | 6.938 | 0,06 |
| 3,125 % fällig am 22.06.2025 | £ | 3.000 | | 3.540 | 0,03 |
| 3,375 % fällig am 24.04.2026 | | 3.647 | | 4.215 | 0,04 |
| 4,000 % fällig am 25.09.2026 | | 10.387 | | 12.203 | 0,11 |
| 4,000 % fällig am 03.09.2027 | | 11.282 | | 13.085 | 0,12 |
| 9,250 % fällig am 08.06.2024 (f)(h) | | 5.514 | | 6.631 | 0,06 |
| **Weir Group PLC** | | | | | |
| 2,200 % fällig am 13.05.2026 | $ | 8.500 | | 7.484 | 0,07 |
| | | | | 650.240 | 5,90 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Canary Wharf Finance PLC** | | | | |
| 5,952 % fällig am 22.10.2037 | £ | 55 | $ 80 | 0,00 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 2,193 % fällig am 18.06.2039 | $ | 986 | 968 | 0,01 |
| **Newgate Funding PLC** | | | | |
| 1,578 % fällig am 01.12.2050 | £ | 140 | 160 | 0,00 |
| | | | 1.208 | 0,01 |
| Summe Großbritannien | | | 651.448 | 5,91 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **AASET Trust** | | | | |
| 3,967 % fällig am 16.05.2042 | $ | 3.763 | 3.129 | 0,03 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,524 % fällig am 25.12.2034 | | 1.073 | 992 | 0,01 |
| 2,569 % fällig am 25.05.2035 | | 1.900 | 1.826 | 0,02 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,794 % fällig am 25.01.2037 | | 4.072 | 3.281 | 0,03 |
| **Ameriquest Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,209 % fällig am 25.03.2036 | | 339 | 336 | 0,00 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,329 % fällig am 25.01.2036 | | 2.971 | 2.956 | 0,03 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 2,364 % fällig am 25.08.2032 | | 102 | 96 | 0,00 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,344 % fällig am 25.10.2035 | | 125 | 125 | 0,00 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.08.2036 | | 7.252 | 2.693 | 0,02 |
| **GSAMP Trust** | | | | |
| 1,794 % fällig am 25.01.2037 | | 1.585 | 1.539 | 0,01 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | |
| 1,814 % fällig am 25.04.2037 | | 5.068 | 3.514 | 0,03 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 1,834 % fällig am 25.10.2036 | | 1.514 | 1.491 | 0,01 |
| **L2L Education Loan Trust** | | | | |
| 1,664 % fällig am 15.06.2031 | | 1.770 | 1.769 | 0,02 |
| **Labrador Aviation Finance Ltd.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 15.01.2042 | | 14.140 | 12.678 | 0,12 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 2,424 % fällig am 25.10.2035 | | 145 | 145 | 0,00 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.12.2036 | | 4.583 | 3.314 | 0,03 |
| 2,674 % fällig am 25.06.2035 | | 5.335 | 5.220 | 0,05 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,344 % fällig am 25.12.2034 | | 1.916 | 1.815 | 0,02 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 2,674 % fällig am 25.04.2035 | | 1.800 | 1.719 | 0,02 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.11.2034 | | 247 | 235 | 0,00 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.01.2037 | | 4.839 | 3.020 | 0,03 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | | |
| 2,084 % fällig am 25.12.2035 | | 411 | 360 | 0,00 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 2,284 % fällig am 25.11.2035 | | 1.067 | 1.061 | 0,01 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 2,204 % fällig am 25.12.2035 | | 508 | 494 | 0,00 |
| 2,299 % fällig am 25.01.2035 | | 103 | 96 | 0,00 |
| **SLM Private Credit Student Loan Trust** | | | | |
| 2,069 % fällig am 16.12.2041 | | 1.836 | 1.772 | 0,02 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 1,964 % fällig am 25.06.2036 | | 160 | 160 | 0,00 |
| 2,084 % fällig am 25.06.2036 | | 4.436 | 4.284 | 0,04 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 2,244 % fällig am 25.01.2036 | | 4.001 | 3.813 | 0,03 |
| | | | 63.933 | 0,58 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **FINANZWERTE** | | | | |
| **Stearns Holdings LLC 'B' (c)** | | 1.508.783 | 0 | 0,00 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **7-Eleven, Inc.** | | | | |
| 1,800 % fällig am 10.02.2031 | $ | 9.150 | $ 7.152 | 0,06 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **AES Corp.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 15.07.2025 | | 9.500 | 8.928 | 0,08 |
| 3,950 % fällig am 15.07.2030 | | 6.000 | 5.429 | 0,05 |
| **Alaska Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,800 % fällig am 15.02.2029 | | 8.604 | 8.506 | 0,08 |
| **Alexandria Real Estate Equities, Inc.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 15.01.2026 | | 12.150 | 12.178 | 0,11 |
| **Allegion U.S. Holding Co., Inc.** | | | | |
| 3,550 % fällig am 01.10.2027 | | 9.800 | 9.020 | 0,08 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 2,200 % fällig am 02.11.2028 | | 800 | 652 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 01.11.2031 | | 12.265 | 13.611 | 0,12 |
| **American Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.04.2030 | | 2.238 | 2.034 | 0,02 |
| 3,150 % fällig am 15.08.2033 | | 9.348 | 8.291 | 0,08 |
| 3,200 % fällig am 15.12.2029 | | 10.372 | 9.505 | 0,09 |
| 3,250 % fällig am 15.04.2030 | | 1.680 | 1.408 | 0,01 |
| 3,350 % fällig am 15.04.2031 | | 8.149 | 7.505 | 0,07 |
| 3,375 % fällig am 01.11.2028 | | 9.076 | 8.151 | 0,07 |
| 3,500 % fällig am 15.08.2033 | | 12.259 | 10.236 | 0,09 |
| 3,575 % fällig am 15.07.2029 | | 2.141 | 1.992 | 0,02 |
| 3,600 % fällig am 22.03.2029 | | 1.002 | 930 | 0,01 |
| 3,600 % fällig am 15.04.2031 | | 4.466 | 3.920 | 0,04 |
| 3,650 % fällig am 15.08.2030 | | 1.453 | 1.358 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 15.01.2027 | | 2.494 | 2.297 | 0,02 |
| 4,100 % fällig am 15.07.2029 | | 1.096 | 954 | 0,01 |
| **American Campus Communities Operating Partnership LP** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.04.2023 | | 7.150 | 7.159 | 0,07 |
| **American Electric Power Co., Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.02.2062 | | 6.200 | 4.907 | 0,04 |
| 4,300 % fällig am 01.12.2028 | | 3.600 | 3.511 | 0,03 |
| **American Homes 4 Rent LP** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.02.2028 | | 500 | 478 | 0,00 |
| 4,900 % fällig am 15.02.2029 | | 9.200 | 8.977 | 0,08 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028 | € | 17.900 | 15.683 | 0,14 |
| 1,000 % fällig am 15.01.2032 | | 14.300 | 11.124 | 0,10 |
| 1,375 % fällig am 04.04.2025 | | 800 | 806 | 0,01 |
| 1,450 % fällig am 15.09.2026 | $ | 5.900 | 5.165 | 0,05 |
| 1,875 % fällig am 15.10.2030 | | 4.800 | 3.739 | 0,03 |
| 1,950 % fällig am 22.05.2026 | € | 8.800 | 8.776 | 0,08 |
| 2,100 % fällig am 15.06.2030 | $ | 6.500 | 5.212 | 0,05 |
| 2,300 % fällig am 15.09.2031 | | 3.900 | 3.093 | 0,03 |
| 2,400 % fällig am 15.03.2025 | | 3.800 | 3.595 | 0,03 |
| 2,950 % fällig am 15.01.2025 | | 29.670 | 28.672 | 0,26 |
| 3,125 % fällig am 15.01.2027 | | 5.900 | 5.481 | 0,05 |
| 3,375 % fällig am 15.10.2026 | | 500 | 473 | 0,00 |
| 3,800 % fällig am 15.08.2029 | | 13.134 | 12.068 | 0,11 |
| 3,950 % fällig am 15.03.2029 | | 600 | 559 | 0,01 |
| **American Transmission Systems, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.09.2044 | | 1.539 | 1.486 | 0,01 |
| **Anheuser-Busch Cos. LLC** | | | | |
| 4,900 % fällig am 01.02.2046 | | 12.800 | 12.055 | 0,11 |
| **Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.** | | | | |
| 4,600 % fällig am 15.04.2048 | | 8.400 | 7.560 | 0,07 |
| 5,450 % fällig am 23.01.2039 | | 7.000 | 7.130 | 0,06 |
| 5,550 % fällig am 23.01.2049 | | 700 | 716 | 0,01 |
| **Antares Holdings LP** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.01.2027 | | 5.800 | 4.637 | 0,04 |
| 3,950 % fällig am 15.07.2026 | | 3.500 | 3.043 | 0,03 |
| **Ares Capital Corp.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.06.2027 | | 8.500 | 7.102 | 0,06 |
| **Ares Finance Co. LLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.06.2030 | | 15.600 | 13.847 | 0,13 |
| **Ashtead Capital, Inc.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 12.08.2026 | | 1.400 | 1.224 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 01.05.2028 | | 7.041 | 6.362 | 0,06 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 3,550 % fällig am 15.09.2055 | | 19.608 | 14.724 | 0,13 |
| 3,650 % fällig am 15.09.2059 | | 15.243 | 11.450 | 0,10 |
| 4,850 % fällig am 25.05.2047 (j) | CAD | 3.400 | 2.273 | 0,02 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.11.2027 | $ | 8.302 | 7.334 | 0,07 |
| 3,875 % fällig am 01.05.2023 | | 2.043 | 2.026 | 0,02 |
| 4,375 % fällig am 30.01.2024 | $ | 13.999 | $ 13.758 | 0,12 |
| 5,500 % fällig am 15.12.2024 | | 2.600 | 2.579 | 0,02 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,580 % fällig am 08.08.2029 | € | 12.000 | 10.658 | 0,10 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 1,898 % fällig am 23.07.2031 | $ | 4.200 | 3.360 | 0,03 |
| 1,949 % fällig am 27.10.2026 | € | 3.000 | 3.038 | 0,03 |
| 2,144 % fällig am 23.07.2024 | $ | 35.600 | 35.514 | 0,32 |
| 2,551 % fällig am 04.02.2028 | | 26.100 | 23.757 | 0,22 |
| 2,687 % fällig am 22.04.2032 | | 3.400 | 2.857 | 0,03 |
| 3,550 % fällig am 05.03.2024 | | 3.300 | 3.291 | 0,03 |
| 4,271 % fällig am 23.07.2029 | | 2.300 | 2.212 | 0,02 |
| 4,300 % fällig am 28.01.2025 (f) | | 27.900 | 23.366 | 0,21 |
| **Bank of America N.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.10.2036 | | 7.150 | 7.824 | 0,07 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | |
| 2,726 % fällig am 25.03.2031 | | 6.500 | 5.155 | 0,05 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** | | | | |
| 2,839 % fällig am 15.12.2023 | | 6.900 | 6.865 | 0,06 |
| 4,250 % fällig am 15.12.2025 | | 400 | 395 | 0,00 |
| 4,375 % fällig am 15.12.2028 | | 22.680 | 22.109 | 0,20 |
| **Becton Dickinson and Co.** | | | | |
| 0,034 % fällig am 13.08.2025 | € | 2.300 | 2.229 | 0,02 |
| **Berry Global, Inc.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 15.01.2025 | | 9.900 | 9.531 | 0,09 |
| 1,500 % fällig am 15.01.2027 | | 9.100 | 8.319 | 0,08 |
| 4,875 % fällig am 15.07.2026 | $ | 3.100 | 2.964 | 0,03 |
| **Blackstone Private Credit Fund** | | | | |
| 2,350 % fällig am 22.11.2024 | | 13.100 | 12.053 | 0,11 |
| **BlueScope Finance Americas LLC** | | | | |
| 4,625 % fällig am 25.05.2023 | | 26.530 | 26.663 | 0,24 |
| **Boeing Co.** | | | | |
| 1,433 % fällig am 04.02.2024 | | 12.300 | 11.759 | 0,11 |
| 2,196 % fällig am 04.02.2026 | | 33.500 | 30.248 | 0,27 |
| 3,250 % fällig am 01.02.2028 | | 4.400 | 3.936 | 0,04 |
| 5,150 % fällig am 01.05.2030 | | 50.650 | 48.661 | 0,44 |
| **Boston Scientific Corp.** | | | | |
| 0,625 % fällig am 01.12.2027 | € | 7.060 | 6.520 | 0,06 |
| 2,650 % fällig am 01.06.2030 | $ | 15.900 | 13.889 | 0,13 |
| **British Airways Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,300 % fällig am 15.06.2034 | | 12.529 | 11.197 | 0,10 |
| 3,350 % fällig am 15.12.2030 | | 921 | 804 | 0,01 |
| 3,800 % fällig am 20.03.2033 | | 76 | 72 | 0,00 |
| 4,125 % fällig am 20.03.2033 | | 76 | 69 | 0,00 |
| 4,250 % fällig am 15.05.2034 | | 722 | 697 | 0,01 |
| 4,625 % fällig am 20.12.2025 | | 830 | 819 | 0,01 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 15.02.2031 | | 12.900 | 10.377 | 0,09 |
| 2,600 % fällig am 15.02.2033 | | 3.300 | 2.541 | 0,02 |
| 3,187 % fällig am 15.11.2036 | | 34.991 | 26.648 | 0,24 |
| 3,469 % fällig am 15.04.2034 | | 18.649 | 15.203 | 0,14 |
| 3,500 % fällig am 15.02.2041 | | 9.200 | 6.954 | 0,06 |
| 4,150 % fällig am 15.11.2030 | | 1.529 | 1.402 | 0,01 |
| 4,300 % fällig am 15.11.2032 | | 8.300 | 7.549 | 0,07 |
| 4,926 % fällig am 15.05.2037 | | 17.568 | 15.775 | 0,14 |
| **Camden Property Trust** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.09.2024 | | 800 | 789 | 0,01 |
| **Cameron LNG LLC** | | | | |
| 3,402 % fällig am 15.01.2038 | | 4.300 | 3.665 | 0,03 |
| 3,701 % fällig am 15.01.2039 | | 9.625 | 8.132 | 0,07 |
| **Cantor Fitzgerald LP** | | | | |
| 4,500 % fällig am 14.04.2027 | | 100 | 96 | 0,00 |
| 4,875 % fällig am 01.05.2024 | | 3.500 | 3.518 | 0,03 |
| **Carlyle Holdings Finance LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 30.03.2043 | | 100 | 95 | 0,00 |
| **CDW LLC** | | | | |
| 3,569 % fällig am 01.12.2031 | | 6.500 | 5.382 | 0,05 |
| **Centene Corp.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 15.07.2028 | | 3.800 | 3.180 | 0,03 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.01.2029 | | 17.920 | 14.740 | 0,13 |
| 2,300 % fällig am 01.02.2032 | | 11.000 | 8.335 | 0,08 |
| 3,500 % fällig am 01.06.2041 | | 9.200 | 6.454 | 0,06 |
| 3,500 % fällig am 01.03.2042 | | 8.300 | 5.773 | 0,05 |
| 3,700 % fällig am 01.04.2051 | | 6.800 | 4.614 | 0,04 |
| 3,750 % fällig am 15.02.2028 | | 9.900 | 9.152 | 0,08 |
| 3,900 % fällig am 01.06.2052 | | 1.700 | 1.183 | 0,01 |
| 4,400 % fällig am 01.12.2061 | | 750 | 541 | 0,00 |
| 4,800 % fällig am 01.03.2050 | | 8.800 | 6.990 | 0,06 |
| 5,125 % fällig am 01.07.2049 | | 9.300 | 7.716 | 0,07 |
| 5,375 % fällig am 01.04.2038 | | 6.300 | 5.610 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Cheniere Corpus Christi Holdings LLC** | | | | | |
| 3,700 % fällig am 15.11.2029 | $ | 9.000 | $ | 8.241 | 0,07 |
| 5,125 % fällig am 30.06.2027 | | 13.132 | | 13.191 | 0,12 |
| 7,000 % fällig am 30.06.2024 | | 4.678 | | 4.851 | 0,04 |
| **Choice Hotels International, Inc.** | | | | | |
| 3,700 % fällig am 01.12.2029 | | 700 | | 631 | 0,01 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | | |
| 2,572 % fällig am 03.06.2031 (j) | | 24.700 | | 20.784 | 0,19 |
| **Citrix Systems, Inc.** | | | | | |
| 3,300 % fällig am 01.03.2030 | | 2.500 | | 2.441 | 0,02 |
| **Cleveland Electric Illuminating Co.** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.04.2028 | | 2.965 | | 2.793 | 0,03 |
| **Constellation Energy Generation LLC** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.10.2041 | | 2.500 | | 2.426 | 0,02 |
| **Corporate Office Properties LP** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.03.2026 | | 5.200 | | 4.720 | 0,04 |
| **CoStar Group, Inc.** | | | | | |
| 2,800 % fällig am 15.07.2030 | | 5.200 | | 4.334 | 0,04 |
| **Crown Castle International Corp.** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.01.2031 | | 12.500 | | 10.151 | 0,09 |
| 3,100 % fällig am 15.11.2029 | | 12.805 | | 11.317 | 0,10 |
| 3,250 % fällig am 15.01.2051 | | 5.400 | | 3.885 | 0,04 |
| 3,800 % fällig am 15.02.2028 | | 3.765 | | 3.556 | 0,03 |
| 4,300 % fällig am 15.02.2029 | | 8.000 | | 7.690 | 0,07 |
| 4,450 % fällig am 15.02.2026 | | 24.933 | | 24.708 | 0,22 |
| **Crown Castle Towers LLC** | | | | | |
| 4,241 % fällig am 15.07.2048 | | 5.800 | | 5.640 | 0,05 |
| **CVS Pass-Through Trust** | | | | | |
| 4,704 % fällig am 10.01.2036 | | 220 | | 211 | 0,00 |
| 5,926 % fällig am 10.01.2034 | | 2.053 | | 2.109 | 0,02 |
| 6,036 % fällig am 10.12.2028 | | 1.264 | | 1.297 | 0,01 |
| 7,507 % fällig am 10.01.2032 | | 1.359 | | 1.482 | 0,01 |
| 8,353 % fällig am 10.07.2031 | | 249 | | 285 | 0,00 |
| **DAE Funding LLC** | | | | | |
| 1,550 % fällig am 01.08.2024 | | 19.866 | | 18.623 | 0,17 |
| 1,625 % fällig am 15.02.2024 | | 19.500 | | 18.479 | 0,17 |
| 3,375 % fällig am 20.03.2028 | | 24.600 | | 21.673 | 0,20 |
| **Daimler Trucks Finance North America LLC** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 13.12.2024 | | 2.900 | | 2.729 | 0,02 |
| 2,000 % fällig am 14.12.2026 | | 7.510 | | 6.754 | 0,06 |
| **Dell International LLC** | | | | | |
| 4,900 % fällig am 01.10.2026 | | 11.904 | | 11.933 | 0,11 |
| 5,300 % fällig am 01.10.2029 | | 4.500 | | 4.441 | 0,04 |
| 5,850 % fällig am 15.07.2025 | | 4.297 | | 4.436 | 0,04 |
| 6,020 % fällig am 15.06.2026 | | 31.099 | | 32.337 | 0,29 |
| 6,100 % fällig am 15.07.2027 | | 5.052 | | 5.302 | 0,05 |
| **Delta Air Lines, Inc.** | | | | | |
| 2,900 % fällig am 28.10.2024 | | 18.442 | | 17.078 | 0,16 |
| 3,750 % fällig am 28.10.2029 | | 18.900 | | 15.010 | 0,14 |
| 7,000 % fällig am 01.05.2025 | | 9.100 | | 9.223 | 0,08 |
| 7,375 % fällig am 15.01.2026 | | 1.730 | | 1.732 | 0,02 |
| **Devon Energy Corp.** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.09.2024 | | 5.664 | | 5.782 | 0,05 |
| **Discovery Communications LLC** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 20.09.2024 | £ | 6.400 | | 7.600 | 0,07 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.12.2026 | $ | 3.100 | | 2.436 | 0,02 |
| 5,750 % fällig am 01.12.2028 | | 7.100 | | 5.270 | 0,05 |
| **DTE Electric Co.** | | | | | |
| 1,900 % fällig am 01.04.2028 | | 4.700 | | 4.193 | 0,04 |
| **Duke Energy Carolinas LLC** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 30.09.2042 | | 122 | | 109 | 0,00 |
| **Edison International** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.12.2026 (f) | | 3.900 | | 3.113 | 0,03 |
| **Energy Transfer LP** | | | | | |
| 4,400 % fällig am 15.03.2027 | | 6.745 | | 6.540 | 0,06 |
| 5,150 % fällig am 01.02.2043 | | 2.294 | | 1.958 | 0,02 |
| 5,150 % fällig am 15.03.2045 | | 7.503 | | 6.429 | 0,06 |
| 5,300 % fällig am 01.04.2044 | | 4.130 | | 3.590 | 0,03 |
| 5,300 % fällig am 15.04.2047 | | 675 | | 586 | 0,01 |
| 5,350 % fällig am 15.05.2045 | | 7.181 | | 6.267 | 0,06 |
| 5,400 % fällig am 01.10.2047 | | 200 | | 176 | 0,00 |
| 6,050 % fällig am 01.06.2041 | | 2.480 | | 2.386 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 15.04.2049 | | 600 | | 583 | 0,01 |
| 7,500 % fällig am 01.07.2038 | | 5.734 | | 6.153 | 0,06 |
| 7,600 % fällig am 01.02.2024 | | 14.400 | | 15.007 | 0,14 |
| **Entergy Louisiana LLC** | | | | | |
| 3,780 % fällig am 01.04.2025 | | 25.100 | | 24.854 | 0,23 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Enterprise Products Operating LLC** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 16.08.2077 | $ | 11.975 | $ | 9.549 | 0,09 |
| 5,250 % fällig am 16.08.2077 | | 4.739 | | 3.941 | 0,04 |
| 5,375 % fällig am 15.02.2078 | | 5.614 | | 4.436 | 0,04 |
| **EPR Properties** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.04.2025 | | 4.420 | | 4.338 | 0,04 |
| 4,500 % fällig am 01.06.2027 | | 6.440 | | 5.835 | 0,05 |
| 4,750 % fällig am 15.12.2026 | | 4.425 | | 4.162 | 0,04 |
| 4,950 % fällig am 15.04.2028 | | 1.986 | | 1.829 | 0,02 |
| **Essex Portfolio LP** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 01.05.2023 | | 950 | | 947 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 01.04.2025 | | 1.400 | | 1.371 | 0,01 |
| 3,625 % fällig am 01.05.2027 | | 4.000 | | 3.871 | 0,04 |
| **Exelon Corp.** | | | | | |
| 4,050 % fällig am 15.04.2030 | | 3.540 | | 3.401 | 0,03 |
| **Expedia Group, Inc.** | | | | | |
| 2,950 % fällig am 15.03.2031 | | 6.550 | | 5.217 | 0,05 |
| 3,250 % fällig am 15.02.2030 | | 7.000 | | 5.845 | 0,05 |
| 3,800 % fällig am 15.02.2028 | | 10.805 | | 9.858 | 0,09 |
| 6,250 % fällig am 01.05.2025 | | 983 | | 1.014 | 0,01 |
| **Fells Point Funding Trust** | | | | | |
| 3,046 % fällig am 31.01.2027 | | 10.150 | | 9.368 | 0,09 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | | |
| 0,125 % fällig am 03.12.2022 | € | 12.450 | | 13.008 | 0,12 |
| **FirstEnergy Transmission LLC** | | | | | |
| 4,550 % fällig am 01.04.2049 | $ | 2.083 | | 1.681 | 0,02 |
| **Fiserv, Inc.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.07.2031 | £ | 800 | | 875 | 0,01 |
| **Flex Intermediate Holdco LLC** | | | | | |
| 3,363 % fällig am 30.06.2031 | $ | 34.000 | | 27.799 | 0,25 |
| **Ford Foundation** | | | | | |
| 2,815 % fällig am 01.06.2070 | | 1.600 | | 1.104 | 0,01 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | | |
| 0,324 % fällig am 15.11.2023 | € | 1.033 | | 1.044 | 0,01 |
| 0,346 % fällig am 01.12.2024 | | 3.187 | | 3.110 | 0,03 |
| 2,330 % fällig am 25.11.2025 | | 5.450 | | 5.060 | 0,05 |
| 3,021 % fällig am 06.03.2024 | | 13.290 | | 13.354 | 0,12 |
| 3,250 % fällig am 15.09.2025 | | 1.400 | | 1.345 | 0,01 |
| 4,535 % fällig am 06.03.2025 | £ | 6.900 | | 7.862 | 0,07 |
| **Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.10.2025 | $ | 16.350 | | 15.457 | 0,14 |
| **Freedom Mortgage Corp.** | | | | | |
| 8,125 % fällig am 15.11.2024 | | 6.741 | | 5.823 | 0,05 |
| 8,250 % fällig am 15.04.2025 | | 5.571 | | 4.697 | 0,04 |
| **Freeport Minerals Corp.** | | | | | |
| 9,500 % fällig am 01.06.2031 | | 300 | | 384 | 0,00 |
| **FS KKR Capital Corp.** | | | | | |
| 1,650 % fällig am 12.10.2024 | | 12.300 | | 10.952 | 0,10 |
| 2,625 % fällig am 15.01.2027 | | 5.400 | | 4.545 | 0,04 |
| **Georgia Power Co.** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.03.2051 | | 200 | | 147 | 0,00 |
| **GLP Capital LP** | | | | | |
| 3,350 % fällig am 01.09.2024 | | 4.000 | | 3.838 | 0,03 |
| 4,000 % fällig am 15.01.2031 | | 3.700 | | 3.197 | 0,03 |
| 5,300 % fällig am 15.01.2029 | | 14.724 | | 14.097 | 0,13 |
| 5,375 % fällig am 15.04.2026 | | 5.600 | | 5.491 | 0,05 |
| 5,750 % fällig am 01.06.2028 | | 13.430 | | 13.140 | 0,12 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | | |
| 2,383 % fällig am 21.07.2032 | | 4.100 | | 3.319 | 0,03 |
| 2,581 % fällig am 15.05.2026 | | 14.800 | | 14.458 | 0,13 |
| 3,125 % fällig am 25.07.2029 | £ | 5.100 | | 5.738 | 0,05 |
| 4,223 % fällig am 01.05.2029 | $ | 19.400 | | 18.666 | 0,17 |
| **Goodman U.S. Finance Four LLC** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.10.2037 | | 7.182 | | 6.648 | 0,06 |
| **Goodman U.S. Finance Three LLC** | | | | | |
| 3,700 % fällig am 15.03.2028 | | 12.875 | | 12.337 | 0,11 |
| **GSK Consumer Healthcare Capital U.S. LLC** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 24.03.2032 | | 500 | | 463 | 0,00 |
| **Guardian Life Global Funding** | | | | | |
| 1,100 % fällig am 23.06.2025 | | 3.000 | | 2.772 | 0,03 |
| **Gulfstream Natural Gas System LLC** | | | | | |
| 4,600 % fällig am 15.09.2025 | | 4.560 | | 4.565 | 0,04 |
| **Hanover Insurance Group, Inc.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.04.2026 | | 740 | | 738 | 0,01 |
| **HCA, Inc.** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.06.2029 | | 3.100 | | 2.830 | 0,03 |
| 4,500 % fällig am 15.02.2027 | | 3.800 | | 3.657 | 0,03 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Highwoods Realty LP** | | | | | |
| 2,600 % fällig am 01.02.2031 | $ | 6.800 | $ | 5.595 | 0,05 |
| 3,050 % fällig am 15.02.2030 | | 3.200 | | 2.758 | 0,03 |
| 4,200 % fällig am 15.04.2029 | | 4.000 | | 3.754 | 0,03 |
| **Host Hotels & Resorts LP** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.12.2029 | | 4.700 | | 3.983 | 0,04 |
| 3,500 % fällig am 15.09.2030 | | 2.600 | | 2.224 | 0,02 |
| 3,875 % fällig am 01.04.2024 | | 8.200 | | 8.106 | 0,07 |
| 4,000 % fällig am 15.06.2025 | | 1.625 | | 1.591 | 0,01 |
| **Hudson Pacific Properties LP** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.01.2030 | | 2.325 | | 2.026 | 0,02 |
| **Hyatt Hotels Corp.** | | | | | |
| 2,563 % fällig am 01.10.2023 | | 9.600 | | 9.584 | 0,09 |
| **Hyundai Capital America** | | | | | |
| 0,875 % fällig am 14.06.2024 | | 12.010 | | 11.236 | 0,10 |
| 1,500 % fällig am 15.06.2026 | | 10.200 | | 9.040 | 0,08 |
| **Infor, Inc.** | | | | | |
| 1,450 % fällig am 15.07.2023 | | 7.100 | | 6.911 | 0,06 |
| 1,750 % fällig am 15.07.2025 | | 4.700 | | 4.352 | 0,04 |
| **Integris Baptist Medical Center, Inc.** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.08.2050 | | 8.300 | | 7.079 | 0,06 |
| **Intercontinental Exchange, Inc.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.09.2060 | | 9.450 | | 6.398 | 0,06 |
| 3,750 % fällig am 01.12.2025 | | 600 | | 595 | 0,01 |
| **International Flavors & Fragrances, Inc.** | | | | | |
| 1,832 % fällig am 15.10.2027 | | 11.100 | | 9.573 | 0,09 |
| **Ipalco Enterprises, Inc.** | | | | | |
| 3,700 % fällig am 01.09.2024 | | 2.858 | | 2.828 | 0,03 |
| 4,250 % fällig am 01.05.2030 | | 200 | | 186 | 0,00 |
| **Jackson National Life Global Funding** | | | | | |
| 2,650 % fällig am 21.06.2024 | | 600 | | 585 | 0,01 |
| **Jersey Central Power & Light Co.** | | | | | |
| 4,300 % fällig am 15.01.2026 | | 280 | | 277 | 0,00 |
| 4,700 % fällig am 01.04.2024 | | 3.800 | | 3.826 | 0,03 |
| **JetBlue Pass-Through Trust** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.05.2034 | | 992 | | 925 | 0,01 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | | |
| 2,069 % fällig am 01.06.2029 | | 6.600 | | 5.682 | 0,05 |
| 2,074 % fällig am 23.07.2024 | | 14.100 | | 14.044 | 0,13 |
| 2,301 % fällig am 15.10.2025 | | 32.500 | | 30.982 | 0,28 |
| 2,545 % fällig am 08.11.2032 | | 10.000 | | 8.319 | 0,08 |
| 2,580 % fällig am 22.04.2032 | | 11.700 | | 9.855 | 0,09 |
| 2,739 % fällig am 15.10.2030 | | 35.800 | | 31.266 | 0,28 |
| 3,702 % fällig am 06.05.2030 | | 9.300 | | 8.659 | 0,08 |
| 3,782 % fällig am 01.02.2028 | | 3.569 | | 3.430 | 0,03 |
| 3,797 % fällig am 23.07.2024 | | 7.500 | | 7.476 | 0,07 |
| **Kilroy Realty LP** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.11.2032 | | 1.100 | | 860 | 0,01 |
| **Kinder Morgan, Inc.** | | | | | |
| 7,420 % fällig am 15.02.2037 | | 3.500 | | 3.737 | 0,03 |
| 8,050 % fällig am 15.10.2030 | | 36 | | 41 | 0,00 |
| **KKR Financial Holdings LLC** | | | | | |
| 5,400 % fällig am 23.05.2033 | | 10.400 | | 10.451 | 0,09 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.07.2027 | £ | 6.150 | | 7.442 | 0,07 |
| **Las Vegas Sands Corp.** | | | | | |
| 2,900 % fällig am 25.06.2025 | $ | 6.900 | | 6.163 | 0,06 |
| 3,200 % fällig am 08.08.2024 | | 129.950 | | 122.891 | 1,12 |
| 3,500 % fällig am 18.08.2026 | | 27.800 | | 24.198 | 0,22 |
| **Lazard Group LLC** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 11.03.2029 | | 4.968 | | 4.747 | 0,04 |
| **Lehman Brothers Holdings, Inc.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 23.12.2010 ^ | | 900 | | 4 | 0,00 |
| 5,259 % fällig am 12.06.2013 ^ | € | 2.807 | | 19 | 0,00 |
| 6,875 % fällig am 02.05.2018 ^ | $ | 3.000 | | 13 | 0,00 |
| **Leidos, Inc.** | | | | | |
| 2,300 % fällig am 15.02.2031 | | 2.034 | | 1.622 | 0,01 |
| **Level 3 Financing, Inc.** | | | | | |
| 3,400 % fällig am 01.03.2027 | | 3.300 | | 2.849 | 0,03 |
| 3,625 % fällig am 15.01.2029 | | 700 | | 541 | 0,00 |
| 3,875 % fällig am 15.11.2029 | | 4.000 | | 3.311 | 0,03 |
| **Liberty Mutual Group, Inc.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 23.05.2059 | € | 2.900 | | 2.742 | 0,02 |
| 4,569 % fällig am 01.02.2029 | $ | 800 | | 788 | 0,01 |
| **Magallanes, Inc.** | | | | | |
| 3,755 % fällig am 15.03.2027 | | 1.500 | | 1.408 | 0,01 |
| 4,279 % fällig am 15.03.2032 | | 5.050 | | 4.518 | 0,04 |
| 5,141 % fällig am 15.03.2052 | | 9.090 | | 7.642 | 0,07 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Marriott International, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.10.2032 | $ | 11.240 | $ 9.709 | 0,09 |
| 3,600 % fällig am 15.04.2024 | | 4.500 | 4.461 | 0,04 |
| 4,150 % fällig am 01.12.2023 | | 3.900 | 3.916 | 0,04 |
| 4,625 % fällig am 15.06.2030 | | 12.041 | 11.556 | 0,10 |
| 5,750 % fällig am 01.05.2025 | | 401 | 416 | 0,00 |
| **MassMutual Global Funding** | | | | |
| 2,500 % fällig am 17.10.2022 | | 5.136 | 5.131 | 0,05 |
| 3,400 % fällig am 08.03.2026 | | 3.700 | 3.625 | 0,03 |
| **MetLife Capital Trust** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.12.2067 | | 3.282 | 3.546 | 0,03 |
| **MetLife, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.03.2028 (f) | | 7.400 | 6.876 | 0,06 |
| **Metropolitan Edison Co.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.03.2023 | | 6.900 | 6.856 | 0,06 |
| 4,000 % fällig am 15.04.2025 | | 6.300 | 6.205 | 0,06 |
| **Mid-America Apartments LP** | | | | |
| 1,100 % fällig am 15.09.2026 | | 2.600 | 2.286 | 0,02 |
| 3,600 % fällig am 01.06.2027 | | 1.925 | 1.852 | 0,02 |
| 3,950 % fällig am 15.03.2029 | | 10.910 | 10.428 | 0,09 |
| **Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC** | | | | |
| 4,100 % fällig am 15.05.2028 | | 17.140 | 16.741 | 0,15 |
| **Midwest Connector Capital Co. LLC** | | | | |
| 3,900 % fällig am 01.04.2024 | | 30.282 | 29.737 | 0,27 |
| **Mileage Plus Holdings LLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 20.06.2027 | | 7.900 | 7.788 | 0,07 |
| **Mississippi Power Co.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 30.03.2028 | | 100 | 97 | 0,00 |
| 4,250 % fällig am 15.03.2042 | | 2.600 | 2.272 | 0,02 |
| **Monongahela Power Co.** | | | | |
| 3,550 % fällig am 15.05.2027 | | 6.873 | 6.545 | 0,06 |
| 4,100 % fällig am 15.04.2024 | | 2.737 | 2.737 | 0,02 |
| 5,400 % fällig am 15.12.2043 | | 150 | 149 | 0,00 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 0,000 % fällig am 02.04.2032 (j) | | 46.900 | 29.290 | 0,27 |
| **MPH Acquisition Holdings LLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.09.2028 | | 5.000 | 4.464 | 0,04 |
| **MPT Operating Partnership LP** | | | | |
| 0,993 % fällig am 15.10.2026 | € | 5.300 | 4.574 | 0,04 |
| 3,500 % fällig am 15.03.2031 | $ | 1.800 | 1.424 | 0,01 |
| 3,692 % fällig am 05.06.2028 | £ | 21.562 | 22.725 | 0,21 |
| 4,625 % fällig am 01.08.2029 | $ | 10.300 | 9.058 | 0,08 |
| **National Fuel Gas Co.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 01.03.2031 | | 3.700 | 3.007 | 0,03 |
| **National Health Investors, Inc.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.02.2031 | | 1.800 | 1.383 | 0,01 |
| **Nationwide Financial Services, Inc.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 30.11.2049 | | 8.800 | 7.177 | 0,07 |
| **Nationwide Mutual Insurance Co.** | | | | |
| 9,375 % fällig am 15.08.2039 | | 200 | 274 | 0,00 |
| **Netflix, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.06.2030 | € | 29.473 | 26.737 | 0,24 |
| 3,875 % fällig am 15.11.2029 | | 26.450 | 25.016 | 0,23 |
| 4,625 % fällig am 15.05.2029 | | 6.000 | 5.932 | 0,05 |
| **Neuberger Berman Group LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2027 | $ | 12.200 | 12.198 | 0,11 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,800 % fällig am 01.12.2077 | | 140 | 115 | 0,00 |
| 5,650 % fällig am 01.05.2079 | | 500 | 440 | 0,00 |
| **NGPL PipeCo LLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.08.2027 | | 8.855 | 8.769 | 0,08 |
| **Nissan Motor Acceptance Co. LLC** | | | | |
| 1,850 % fällig am 16.09.2026 | | 15.000 | 12.654 | 0,11 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | | |
| 2,924 % fällig am 28.09.2022 | | 1.550 | 1.545 | 0,01 |
| **NVR, Inc.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.05.2030 | | 28.840 | 24.875 | 0,23 |
| **Oaktree Specialty Lending Corp.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 25.02.2025 | | 2.000 | 1.897 | 0,02 |
| **Omega Healthcare Investors, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.01.2026 | | 4.200 | 4.164 | 0,04 |
| **OneMain Finance Corp.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.11.2029 | | 2.100 | 1.706 | 0,02 |
| 6,875 % fällig am 15.03.2025 | | 5.400 | 5.129 | 0,05 |
| **ONEOK, Inc.** | | | | |
| 4,350 % fällig am 15.03.2029 | | 21.030 | 19.803 | 0,18 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Oracle Corp.** | | | | |
| 3,850 % fällig am 01.04.2060 | $ | 1.800 | $ 1.237 | 0,01 |
| 4,100 % fällig am 25.03.2061 (j) | | 6.600 | 4.683 | 0,04 |
| **Organon & Co.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 30.04.2028 | € | 2.300 | 2.021 | 0,02 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.02.2031 | $ | 500 | 383 | 0,00 |
| 2,950 % fällig am 01.03.2026 ^ | | 6.700 | 6.096 | 0,06 |
| 3,000 % fällig am 15.06.2028 | | 16.330 | 14.088 | 0,13 |
| 3,150 % fällig am 01.01.2026 | | 10.399 | 9.536 | 0,09 |
| 3,250 % fällig am 15.06.2023 ^ | | 6.961 | 6.864 | 0,06 |
| 3,300 % fällig am 15.03.2027 ^ | | 11.935 | 10.703 | 0,10 |
| 3,300 % fällig am 01.12.2027 ^ | | 15.869 | 13.870 | 0,13 |
| 3,400 % fällig am 15.08.2024 ^ | | 9.676 | 9.307 | 0,08 |
| 3,450 % fällig am 01.07.2025 | | 5.877 | 5.533 | 0,05 |
| 3,500 % fällig am 15.06.2025 ^ | | 13.400 | 12.703 | 0,12 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2050 | | 900 | 603 | 0,01 |
| 3,750 % fällig am 15.02.2024 ^ | | 3.683 | 3.602 | 0,03 |
| 3,750 % fällig am 01.07.2028 | | 100 | 88 | 0,00 |
| 3,750 % fällig am 15.08.2042 ^ | | 3.300 | 2.239 | 0,02 |
| 3,850 % fällig am 15.11.2023 ^ | | 5.177 | 5.110 | 0,05 |
| 3,950 % fällig am 01.12.2047 ^ | | 2.400 | 1.667 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 01.12.2046 ^ | | 100 | 70 | 0,00 |
| 4,200 % fällig am 01.06.2041 | | 2.173 | 1.595 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 01.08.2023 | | 6.300 | 6.267 | 0,06 |
| 4,250 % fällig am 15.03.2046 ^ | | 100 | 73 | 0,00 |
| 4,300 % fällig am 15.03.2045 ^ | | 300 | 219 | 0,00 |
| 4,450 % fällig am 15.04.2042 ^ | | 8.543 | 6.429 | 0,06 |
| 4,500 % fällig am 15.12.2041 ^ | | 3.400 | 2.506 | 0,02 |
| 4,650 % fällig am 01.08.2028 | | 1.600 | 1.484 | 0,01 |
| 5,900 % fällig am 15.06.2032 | | 5.900 | 5.710 | 0,05 |
| **Pacific Life Global Funding** | | | | |
| 1,200 % fällig am 24.06.2025 | | 8.100 | 7.447 | 0,07 |
| **Pactiv Evergreen Group Issuer LLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.10.2028 | | 1.700 | 1.447 | 0,01 |
| **Pennsylvania Electric Co.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.03.2028 | | 2.189 | 2.033 | 0,02 |
| 3,600 % fällig am 01.06.2029 | | 6.770 | 6.390 | 0,06 |
| 4,150 % fällig am 15.04.2025 | | 2.205 | 2.170 | 0,02 |
| 6,150 % fällig am 01.10.2038 | | 4.415 | 4.758 | 0,04 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | | |
| 3,350 % fällig am 01.11.2029 | | 17.110 | 15.584 | 0,14 |
| **PetSmart, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.02.2028 | | 3.200 | 2.778 | 0,03 |
| **Physicians Realty LP** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.01.2028 | | 11.870 | 11.329 | 0,10 |
| 4,300 % fällig am 15.03.2027 | | 7.400 | 7.259 | 0,07 |
| **Pioneer Natural Resources Co.** | | | | |
| 7,200 % fällig am 15.01.2028 | | 2.500 | 2.751 | 0,03 |
| **Plains All American Pipeline LP** | | | | |
| 6,700 % fällig am 15.05.2036 | | 300 | 299 | 0,00 |
| **Principal Life Global Funding** | | | | |
| 3,000 % fällig am 18.04.2026 | | 5.700 | 5.446 | 0,05 |
| **Progress Energy, Inc.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.03.2031 | | 750 | 877 | 0,01 |
| **Protective Life Corp.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 15.01.2030 | | 21.300 | 19.511 | 0,18 |
| **Provident Funding Associates LP** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.06.2025 | | 4.100 | 3.695 | 0,03 |
| **Realty Income Corp.** | | | | |
| 2,200 % fällig am 15.06.2028 | | 5.000 | 4.389 | 0,04 |
| 4,625 % fällig am 01.11.2025 | | 8.600 | 8.732 | 0,08 |
| 4,875 % fällig am 01.06.2026 | | 3.471 | 3.544 | 0,03 |
| **Regency Centers LP** | | | | |
| 2,950 % fällig am 15.09.2029 | | 4.900 | 4.312 | 0,04 |
| **Reliance Standard Life Global Funding** | | | | |
| 2,750 % fällig am 21.01.2027 | | 6.100 | 5.669 | 0,05 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | | |
| 8,200 % fällig am 06.04.2028 | | 4.075 | 4.240 | 0,04 |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | | 3.071 | 3.185 | 0,03 |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027 | | 189 | 202 | 0,00 |
| **Rockies Express Pipeline LLC** | | | | |
| 4,800 % fällig am 15.05.2030 | | 6.600 | 5.506 | 0,05 |
| **S&P Global, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.05.2029 | | 13.610 | 13.472 | 0,12 |
| 4,750 % fällig am 01.08.2028 | | 6.600 | 6.713 | 0,06 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.03.2028 | | 5.700 | 5.488 | 0,05 |
| 4,500 % fällig am 15.05.2030 | $ | 5.000 | $ 4.797 | 0,04 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 5,000 % fällig am 15.03.2027 | | 1.800 | 1.808 | 0,02 |
| 5,625 % fällig am 15.04.2023 | | 25.575 | 25.825 | 0,23 |
| 5,750 % fällig am 15.05.2024 | | 7.355 | 7.507 | 0,07 |
| **Sabra Health Care LP** | | | | |
| 3,200 % fällig am 01.12.2031 | | 4.050 | 3.219 | 0,03 |
| **Sammons Financial Group, Inc.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 12.05.2027 | | 700 | 681 | 0,01 |
| **San Diego Gas & Electric Co.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.06.2047 | | 100 | 85 | 0,00 |
| 4,100 % fällig am 15.06.2049 | | 3.400 | 3.022 | 0,03 |
| **Santander Holdings USA, Inc.** | | | | |
| 2,490 % fällig am 06.01.2028 | | 4.600 | 4.064 | 0,04 |
| 3,244 % fällig am 05.10.2026 | | 2.500 | 2.346 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 07.06.2024 | | 9.500 | 9.342 | 0,08 |
| 4,500 % fällig am 17.07.2025 | | 4.000 | 3.967 | 0,04 |
| **SBA Tower Trust** | | | | |
| 1,884 % fällig am 15.07.2050 | | 25.500 | 23.572 | 0,21 |
| 2,836 % fällig am 15.01.2050 | | 7.009 | 6.770 | 0,06 |
| **Sempra Energy** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.04.2052 | | 4.100 | 3.296 | 0,03 |
| **SL Green Realty Corp.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.12.2022 | | 21.400 | 21.430 | 0,19 |
| **SLM Corp.** | | | | |
| 4,200 % fällig am 29.10.2025 | | 6.200 | 5.628 | 0,05 |
| **Southern California Edison Co.** | | | | |
| 0,700 % fällig am 01.08.2023 | | 11.000 | 10.665 | 0,10 |
| 2,250 % fällig am 01.06.2030 | | 1.110 | 933 | 0,01 |
| 2,500 % fällig am 01.06.2031 | | 4.631 | 3.893 | 0,04 |
| 2,750 % fällig am 01.02.2032 | | 6.400 | 5.413 | 0,05 |
| 2,950 % fällig am 01.02.2051 | | 6.400 | 4.351 | 0,04 |
| 3,450 % fällig am 01.02.2052 | | 5.800 | 4.328 | 0,04 |
| 3,650 % fällig am 01.06.2051 | | 4.300 | 3.345 | 0,03 |
| 3,900 % fällig am 01.12.2041 | | 450 | 366 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 01.04.2047 | | 7.100 | 5.773 | 0,05 |
| 4,125 % fällig am 01.03.2048 | | 3.755 | 3.097 | 0,03 |
| 5,625 % fällig am 01.02.2036 | | 2.053 | 2.075 | 0,02 |
| 5,950 % fällig am 01.02.2038 | | 1.490 | 1.545 | 0,01 |
| 6,650 % fällig am 01.04.2029 | | 10.800 | 11.559 | 0,10 |
| **Southern Co.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 15.09.2081 | € | 2.800 | 2.008 | 0,02 |
| **Southern Co. Gas Capital Corp.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 15.01.2031 | $ | 11.390 | 9.016 | 0,08 |
| 3,250 % fällig am 15.06.2026 | | 1.100 | 1.057 | 0,01 |
| 4,400 % fällig am 30.05.2047 | | 600 | 525 | 0,00 |
| 5,875 % fällig am 15.03.2041 | | 1.920 | 2.025 | 0,02 |
| **Southwest Airlines Co.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.06.2027 | | 7.600 | 7.676 | 0,07 |
| **Southwest Airlines Co. Pass-Through Trust** | | | | |
| 6,650 % fällig am 01.08.2022 | | 97 | 97 | 0,00 |
| **Spirit AeroSystems, Inc.** | | | | |
| 3,850 % fällig am 15.06.2026 | | 5.200 | 4.462 | 0,04 |
| **Spirit Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,100 % fällig am 01.10.2029 | | 2.625 | 2.519 | 0,02 |
| **Spirit Realty LP** | | | | |
| 3,200 % fällig am 15.01.2027 | | 4.800 | 4.411 | 0,04 |
| 3,200 % fällig am 15.02.2031 | | 2.245 | 1.883 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 15.07.2029 | | 1.000 | 916 | 0,01 |
| 4,450 % fällig am 15.09.2026 | | 6.100 | 6.010 | 0,05 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.11.2022 | | 6.200 | 6.246 | 0,06 |
| **Sprint Corp.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.09.2023 | | 4.300 | 4.446 | 0,04 |
| **Sprint Spectrum Co. LLC** | | | | |
| 4,738 % fällig am 20.09.2029 | | 10.656 | 10.666 | 0,10 |
| 5,152 % fällig am 20.09.2029 | | 4.000 | 4.036 | 0,04 |
| **Standard Industries, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 21.11.2026 | € | 18.450 | 15.148 | 0,14 |
| **STORE Capital Corp.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 18.11.2030 | $ | 2.000 | 1.632 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 15.03.2028 | | 800 | 782 | 0,01 |
| 4,625 % fällig am 15.03.2029 | | 2.100 | 2.051 | 0,02 |
| **Stryker Corp.** | | | | |
| 1,950 % fällig am 15.06.2030 | | 9.650 | 8.024 | 0,07 |
| **Synchrony Financial** | | | | |
| 3,950 % fällig am 01.12.2027 | | 5.200 | 4.745 | 0,04 |
| **Systems Energy Resources, Inc.** | | | | |
| 2,140 % fällig am 09.12.2025 | | 17.300 | 16.079 | 0,15 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | |
| 1,500 % fällig am 15.02.2026 | $ 10.600 | $ 9.591 | 0,09 |
| 2,050 % fällig am 15.02.2028 | 13.940 | 12.116 | 0,11 |
| 2,250 % fällig am 15.11.2031 | 16.100 | 13.082 | 0,12 |
| 2,550 % fällig am 15.02.2031 | 4.600 | 3.875 | 0,04 |
| 3,300 % fällig am 15.02.2051 | 2.200 | 1.607 | 0,01 |
| 3,875 % fällig am 15.04.2030 | 13.200 | 12.331 | 0,11 |
| **TD SYNNEX Corp.** | | | |
| 1,750 % fällig am 09.08.2026 | 5.950 | 5.250 | 0,05 |
| 2,375 % fällig am 09.08.2028 | 10.000 | 8.441 | 0,08 |
| **Teachers Insurance & Annuity Association of America** | | | |
| 4,375 % fällig am 15.09.2054 | 18.200 | 17.860 | 0,16 |
| **Time Warner Entertainment Co. LP** | | | |
| 8,375 % fällig am 15.03.2023 | 11.512 | 11.849 | 0,11 |
| 8,375 % fällig am 15.07.2033 | 400 | 463 | 0,00 |
| **Times Square Hotel Trust** | | | |
| 8,528 % fällig am 01.08.2026 | 5.263 | 5.416 | 0,05 |
| **Trans-Allegheny Interstate Line Co.** | | | |
| 3,850 % fällig am 01.06.2025 | 1.157 | 1.139 | 0,01 |
| **U.S. Airways Pass-Through Trust** | | | |
| 4,625 % fällig am 03.12.2026 | 45 | 42 | 0,00 |
| 5,900 % fällig am 01.04.2026 | 1.142 | 1.139 | 0,01 |
| **UDR, Inc.** | | | |
| 3,000 % fällig am 15.08.2031 | 7.100 | 6.074 | 0,06 |
| **United Airlines Pass-Through Trust** | | | |
| 2,700 % fällig am 01.11.2033 | 6.995 | 5.985 | 0,05 |
| 2,875 % fällig am 07.04.2030 | 533 | 488 | 0,00 |
| 3,450 % fällig am 01.06.2029 | 710 | 662 | 0,01 |
| 3,450 % fällig am 07.01.2030 | 2.364 | 2.054 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 01.09.2031 | 16.419 | 15.036 | 0,14 |
| 3,700 % fällig am 01.09.2031 | 5.462 | 4.842 | 0,04 |
| 4,000 % fällig am 11.10.2027 | 1.933 | 1.822 | 0,02 |
| 4,150 % fällig am 11.10.2025 | 1.838 | 1.806 | 0,02 |
| 4,150 % fällig am 25.02.2033 | 10.440 | 9.838 | 0,09 |
| 4,300 % fällig am 15.02.2027 | 1.821 | 1.744 | 0,02 |
| 4,550 % fällig am 25.02.2033 | 1.036 | 929 | 0,01 |
| 5,875 % fällig am 15.04.2029 | 7.184 | 7.071 | 0,06 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | |
| 5,125 % fällig am 15.02.2025 | 1.928 | 1.818 | 0,02 |
| **Venture Global Calcasieu Pass LLC** | | | |
| 3,875 % fällig am 01.11.2033 | 7.800 | 6.458 | 0,06 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | |
| 2,100 % fällig am 22.03.2028 | 1.400 | 1.245 | 0,01 |
| 2,296 % fällig am 20.03.2026 | 1.400 | 1.378 | 0,01 |
| 2,355 % fällig am 15.03.2032 | 5.022 | 4.168 | 0,04 |
| 2,511 % fällig am 15.05.2025 | 6.800 | 6.763 | 0,06 |
| **VICI Properties LP** | | | |
| 3,875 % fällig am 15.02.2029 | 7.400 | 6.379 | 0,06 |
| 4,250 % fällig am 01.12.2026 | 5.200 | 4.760 | 0,04 |
| 4,500 % fällig am 15.01.2028 | 4.200 | 3.835 | 0,03 |
| 4,625 % fällig am 01.12.2029 | 2.825 | 2.531 | 0,02 |
| 4,950 % fällig am 15.02.2030 | 3.875 | 3.679 | 0,03 |
| 5,125 % fällig am 15.05.2032 | 2.100 | 1.983 | 0,02 |
| 5,750 % fällig am 01.02.2027 | 2.000 | 1.901 | 0,02 |
| **VMware, Inc.** | | | |
| 1,000 % fällig am 15.08.2024 | 15.000 | 14.047 | 0,13 |
| 3,900 % fällig am 21.08.2027 | 7.900 | 7.590 | 0,07 |
| 4,500 % fällig am 15.05.2025 | 4.400 | 4.416 | 0,04 |
| 4,700 % fällig am 15.05.2030 | 19.415 | 18.740 | 0,17 |
| **Walt Disney Co.** | | | |
| 2,200 % fällig am 13.01.2028 | 5.959 | 5.407 | 0,05 |
| **WEA Finance LLC** | | | |
| 3,750 % fällig am 17.09.2024 | 8.000 | 7.727 | 0,07 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | |
| 2,393 % fällig am 02.06.2028 | 11.500 | 10.308 | 0,09 |
| 3,196 % fällig am 17.06.2027 | 5.800 | 5.501 | 0,05 |
| 3,584 % fällig am 22.05.2028 | 7.000 | 6.647 | 0,06 |
| **West Virginia United Health System Obligated Group** | | | |
| 3,129 % fällig am 01.06.2050 | 1.500 | 1.099 | 0,01 |
| **Westinghouse Air Brake Technologies Corp.** | | | |
| 4,400 % fällig am 15.03.2024 | 8.860 | 8.881 | 0,08 |
| 4,950 % fällig am 15.09.2028 | 8.150 | 7.879 | 0,07 |
| **Weyerhaeuser Co.** | | | |
| 4,000 % fällig am 15.11.2029 | 4.820 | 4.562 | 0,04 |
| 6,875 % fällig am 15.12.2033 | 649 | 730 | 0,01 |
| 6,950 % fällig am 01.10.2027 | 3.404 | 3.749 | 0,03 |
| 7,350 % fällig am 01.07.2026 | 12.350 | 13.685 | 0,12 |
| 7,375 % fällig am 15.03.2032 | 2.889 | 3.346 | 0,03 |
| **Yellowstone Energy LP** | | | |
| 5,750 % fällig am 31.12.2026 | $ 4.908 | $ 5.061 | 0,05 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | |
| 1,164 % fällig am 15.11.2027 | € 4.320 | 3.964 | 0,04 |
| 1,414 % fällig am 13.12.2022 | 10.200 | 10.704 | 0,10 |
| 2,425 % fällig am 13.12.2026 | 4.500 | 4.548 | 0,04 |
| | | 3.374.326 | 30,63 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | |
| **Advantage Sales & Marketing, Inc.** | | | |
| 6,166 % fällig am 28.10.2027 | $ 12.017 | 11.082 | 0,10 |
| **Arches Buyer, Inc.** | | | |
| 4,916 % fällig am 06.12.2027 | 24.010 | 21.969 | 0,20 |
| **Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC** | | | |
| 3,845 % fällig am 01.12.2027 | 11.009 | 10.490 | 0,10 |
| **Caesars Resort Collection LLC** | | | |
| 5,166 % fällig am 21.07.2025 | 15.818 | 15.289 | 0,14 |
| **Catalent Pharma Solutions, Inc.** | | | |
| 3,625 % fällig am 22.02.2028 | 1.489 | 1.471 | 0,01 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | |
| 3,420 % fällig am 01.02.2027 | 4.683 | 4.480 | 0,04 |
| **Chobani LLC** | | | |
| 5,166 % fällig am 25.10.2027 | 491 | 449 | 0,00 |
| **CommScope, Inc.** | | | |
| 4,916 % fällig am 06.04.2026 | 4.571 | 4.129 | 0,04 |
| **Cornerstone Building Brands, Inc.** | | | |
| 4,574 % fällig am 12.04.2028 | 33.264 | 27.754 | 0,25 |
| **E.W. Scripps Co.** | | | |
| 4,416 % fällig am 07.01.2028 | 3.315 | 3.145 | 0,03 |
| **FinCo LLC** | | | |
| 4,166 % fällig am 27.06.2025 | 7.220 | 6.892 | 0,06 |
| **GIP II Blue Holding LP** | | | |
| 6,750 % fällig am 29.09.2028 | 12.100 | 11.745 | 0,11 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | |
| 3,374 % fällig am 22.06.2026 | 256 | 246 | 0,00 |
| **INEOS Finance PLC** | | | |
| 2,500 % fällig am 01.04.2024 | € 11.203 | 11.211 | 0,10 |
| **IQVIA, Inc.** | | | |
| 2,000 % fällig am 07.03.2024 | 1.000 | 1.006 | 0,01 |
| **Level 3 Financing, Inc.** | | | |
| 3,416 % fällig am 01.03.2027 | $ 13.297 | 12.355 | 0,11 |
| **MH Sub LLC** | | | |
| 5,416 % fällig am 13.09.2024 | 20.383 | 19.279 | 0,18 |
| **Nielsen Finance LLC** | | | |
| 3,190 % fällig am 04.10.2023 | 1.337 | 1.331 | 0,01 |
| **Parexel International Corp.** | | | |
| 4,883 % fällig am 15.11.2028 | 1.696 | 1.602 | 0,02 |
| **RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.** | | | |
| 5,416 % fällig am 16.11.2025 | 6.144 | 5.746 | 0,05 |
| **Reynolds Group Holdings, Inc.** | | | |
| 5,166 % fällig am 24.09.2028 | 695 | 650 | 0,01 |
| **Scientific Games Holdings LP** | | | |
| 4,000 % fällig am 04.04.2029 | € 1.000 | 960 | 0,01 |
| 4,175 % fällig am 04.04.2029 | $ 1.500 | 1.390 | 0,01 |
| **SkyMiles IP Ltd.** | | | |
| 4,813 % fällig am 20.10.2027 | 12.200 | 12.115 | 0,11 |
| **Sotera Health Holdings LLC** | | | |
| 4,416 % fällig am 11.12.2026 | 8.600 | 8.192 | 0,08 |
| **SS&C Technologies, Inc.** | | | |
| 3,416 % fällig am 16.04.2025 | 6.175 | 5.901 | 0,05 |
| **Standard Industries, Inc.** | | | |
| 3,788 % fällig am 22.09.2028 | 20 | 19 | 0,00 |
| **Trans Union LLC** | | | |
| 3,916 % fällig am 01.12.2028 | 2.165 | 2.071 | 0,02 |
| **U.S. Foods, Inc.** | | | |
| 4,325 % fällig am 22.11.2028 | 8.358 | 7.975 | 0,07 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | |
| 4,416 % fällig am 15.03.2024 | 3.160 | 3.109 | 0,03 |
| **USI, Inc.** | | | |
| 5,500 % fällig am 02.12.2026 | 1.950 | 1.851 | 0,02 |
| **White Cap Buyer LLC** | | | |
| 5,275 % fällig am 19.10.2027 | 1.491 | 1.374 | 0,01 |
| | | 217.278 | 1,98 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010** | | | |
| 6,725 % fällig am 01.04.2035 | $ 100 | $ 106 | 0,00 |
| 7,350 % fällig am 01.07.2035 | 500 | 546 | 0,00 |
| **Metropolitan Transportation Authority, New York Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | |
| 6,814 % fällig am 15.11.2040 | 8.700 | 10.548 | 0,10 |
| **Municipal Electric Authority of Georgia Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | |
| 6,637 % fällig am 01.04.2057 | 193 | 227 | 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 | 2.344 | 0,02 |
| **State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020** | | | |
| 1,258 % fällig am 01.07.2025 | 25.400 | 23.778 | 0,22 |
| 1,705 % fällig am 01.07.2027 | 17.100 | 15.482 | 0,14 |
| | | 53.031 | 0,48 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | |
| 1,416 % fällig am 25.10.2046 | 6.840 | 5.100 | 0,05 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | |
| 2,496 % fällig am 20.09.2034 | 1 | 1 | 0,00 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 2,667 % fällig am 25.01.2035 | 325 | 312 | 0,00 |
| 2,817 % fällig am 25.02.2034 | 5 | 5 | 0,00 |
| 2,854 % fällig am 25.11.2034 | 132 | 122 | 0,00 |
| 3,064 % fällig am 25.08.2035 ^ | 41 | 39 | 0,00 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | |
| 1,944 % fällig am 25.06.2046 ^ | 2.439 | 2.145 | 0,02 |
| 3,232 % fällig am 25.11.2036 ^ | 425 | 261 | 0,00 |
| **BWAY Mortgage Trust** | | | |
| 2,809 % fällig am 10.03.2033 | 344 | 335 | 0,00 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | |
| 3,442 % fällig am 25.02.2037 | 10 | 10 | 0,00 |
| **Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates** | | | |
| 1,854 % fällig am 25.10.2035 | 77 | 72 | 0,00 |
| 1,904 % fällig am 25.01.2035 | 108 | 103 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | |
| 3,790 % fällig am 25.09.2035 | 12 | 12 | 0,00 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | |
| 1,822 % fällig am 20.07.2046 ^ | 4.709 | 3.625 | 0,03 |
| 1,826 % fällig am 25.08.2035 ^ | 1.912 | 1.648 | 0,02 |
| 2,184 % fällig am 25.02.2037 | 40 | 33 | 0,00 |
| 2,244 % fällig am 25.08.2035 ^ | 536 | 467 | 0,01 |
| 2,324 % fällig am 25.12.2035 ^ | 1.348 | 1.263 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.04.2047 ^ | 593 | 412 | 0,00 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 1,985 % fällig am 20.02.2036 ^ | 22 | 18 | 0,00 |
| 2,084 % fällig am 25.05.2035 | 5 | 4 | 0,00 |
| 2,711 % fällig am 25.11.2034 | 20 | 19 | 0,00 |
| 2,818 % fällig am 25.01.2036 ^ | 209 | 194 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.10.2034 | 440 | 419 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.07.2035 | 42 | 26 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 ^ | 290 | 239 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2037 ^ | 28 | 17 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | |
| 2,857 % fällig am 25.06.2033 | 4 | 4 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,593 % fällig am 25.07.2033 | 3 | 3 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.12.2033 | 14 | 13 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | |
| 3,222 % fällig am 26.06.2037 | 5.325 | 5.141 | 0,05 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Trust** | | | |
| 3,089 % fällig am 27.05.2037 | 3.908 | 2.703 | 0,03 |
| **Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,764 % fällig am 25.07.2047 | 456 | 411 | 0,00 |
| **GSC Capital Corp. Mortgage Trust** | | | |
| 1,984 % fällig am 25.05.2036 ^ | 455 | 432 | 0,01 |
| **GSMPS Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,974 % fällig am 25.01.2036 | 2.109 | 1.768 | 0,02 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,933 % fällig am 25.09.2035 | 1 | 1 | 0,00 |
| 3,760 % fällig am 25.04.2032 | 109 | 95 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,802 % fällig am 19.08.2037 | $ 4.867 | $ 4.371 | 0,04 |
| 1,817 % fällig am 19.12.2036 | 3.296 | 2.898 | 0,03 |
| 2,179 % fällig am 19.04.2034 | 6 | 6 | 0,00 |
| 2,292 % fällig am 20.06.2035 | 1.658 | 1.547 | 0,02 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | |
| 2,124 % fällig am 25.03.2035 | 320 | 275 | 0,00 |
| **Impac CMB Trust** | | | |
| 2,324 % fällig am 25.03.2035 | 211 | 199 | 0,00 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,917 % fällig am 25.03.2036 | 782 | 637 | 0,01 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | |
| 5,843 % fällig am 26.05.2037 | 245 | 209 | 0,00 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | |
| 2,553 % fällig am 25.07.2035 | 21 | 20 | 0,00 |
| **Lehman Mortgage Trust** | | | |
| 5,750 % fällig am 25.02.2037 ^ | 1.492 | 1.196 | 0,01 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | |
| 3,052 % fällig am 21.11.2034 | 7 | 7 | 0,00 |
| **MASTR Alternative Loan Trust** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.02.2034 | 17 | 16 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | |
| 2,284 % fällig am 25.06.2028 | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,742 % fällig am 25.01.2029 | 123 | 120 | 0,00 |
| 2,820 % fällig am 25.02.2035 | 20 | 19 | 0,00 |
| 2,968 % fällig am 25.05.2033 | 2 | 2 | 0,00 |
| 3,235 % fällig am 25.05.2036 | 335 | 305 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 ^ | 39 | 23 | 0,00 |
| **MortgageIT Trust** | | | |
| 2,364 % fällig am 25.12.2034 | 106 | 104 | 0,00 |
| **NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates** | | | |
| 2,074 % fällig am 25.02.2035 ^ | 262 | 231 | 0,00 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | |
| 1,976 % fällig am 25.08.2035 | 191 | 164 | 0,00 |
| 2,044 % fällig am 25.04.2046 | 5.477 | 1.737 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | 2.922 | 2.421 | 0,02 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | |
| 6,500 % fällig am 25.04.2037 ^ | 2.124 | 717 | 0,01 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | |
| 1,995 % fällig am 20.05.2035 | 165 | 149 | 0,00 |
| 2,077 % fällig am 20.05.2034 | 576 | 548 | 0,01 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,051 % fällig am 25.04.2035 | 206 | 200 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | |
| 1,936 % fällig am 25.03.2046 | 197 | 192 | 0,00 |
| 2,004 % fällig am 25.07.2046 ^ | 185 | 143 | 0,00 |
| 2,044 % fällig am 25.04.2036 | 128 | 114 | 0,00 |
| 2,044 % fällig am 25.05.2036 | 9 | 8 | 0,00 |
| 2,095 % fällig am 19.07.2035 | 2 | 1 | 0,00 |
| 2,184 % fällig am 25.02.2036 ^ | 27 | 25 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,362 % fällig am 25.07.2033 | 188 | 182 | 0,00 |
| 3,394 % fällig am 25.06.2033 | 2 | 2 | 0,00 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | |
| 2,140 % fällig am 25.09.2037 | 328 | 318 | 0,00 |
| **Towd Point Mortgage Trust** | | | |
| 2,750 % fällig am 25.06.2057 | 5.500 | 5.374 | 0,05 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 1,476 % fällig am 25.08.2046 | 6 | 6 | 0,00 |
| 1,572 % fällig am 25.11.2041 | 169 | 157 | 0,00 |
| 1,994 % fällig am 25.05.2034 | 1.801 | 1.790 | 0,02 |
| 2,164 % fällig am 25.12.2045 | 5 | 5 | 0,00 |
| 2,244 % fällig am 25.01.2045 | 15 | 14 | 0,00 |
| 2,798 % fällig am 25.03.2035 | 59 | 59 | 0,00 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 1,316 % fällig am 25.11.2046 ^ | 2.199 | 1.830 | 0,02 |
| 2,004 % fällig am 25.06.2037 | 3.503 | 3.264 | 0,03 |
| **Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 3,639 % fällig am 25.06.2033 | 74 | 74 | 0,00 |
| **Wells Fargo Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,164 % fällig am 25.03.2037 ^ | 1.292 | 1.140 | 0,01 |
| 3,411 % fällig am 25.07.2037 ^ | 161 | 145 | 0,00 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 3,260 % fällig am 25.08.2036 ^ | 327 | 310 | 0,00 |
| | | 60.747 | 0,55 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae** | | | |
| 1,001 % fällig am 25.07.2037 | $ 2 | $ 2 | 0,00 |
| 1,356 % fällig am 25.09.2042 | 21 | 21 | 0,00 |
| 1,523 % fällig am 01.06.2043 | 9 | 9 | 0,00 |
| 1,524 % fällig am 01.10.2044 | 6 | 6 | 0,00 |
| 1,557 % fällig am 01.12.2034 | 23 | 24 | 0,00 |
| 1,916 % fällig am 01.01.2037 | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,974 % fällig am 25.05.2042 | 6 | 6 | 0,00 |
| 2,003 % fällig am 01.02.2037 | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,035 % fällig am 01.10.2037 | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,042 % fällig am 01.10.2036 | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,073 % fällig am 01.03.2037 | 25 | 25 | 0,00 |
| 2,231 % fällig am 01.03.2037 | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,250 % fällig am 01.01.2037 | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,451 % fällig am 01.09.2037 | 2 | 2 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.04.2032 | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,531 % fällig am 01.04.2037 | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,608 % fällig am 01.09.2037 | 1 | 1 | 0,00 |
| 3,057 % fällig am 25.09.2027 | 763 | 752 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.05.2036 | 308 | 329 | 0,00 |
| 6,625 % fällig am 15.11.2030 | 17.025 | 21.053 | 0,19 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 1,153 % fällig am 25.08.2029 (a) | 3.000 | 172 | 0,00 |
| 1,524 % fällig am 25.02.2045 | 19 | 19 | 0,00 |
| 1,944 % fällig am 01.01.2037 | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,008 % fällig am 01.10.2038 | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,221 % fällig am 01.06.2037 | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,307 % fällig am 01.03.2037 | 2 | 2 | 0,00 |
| 2,315 % fällig am 01.03.2036 | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,410 % fällig am 01.04.2037 | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,660 % fällig am 01.03.2036 | 1 | 1 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 01.01.2040 | 33 | 34 | 0,00 |
| 5,992 % fällig am 25.11.2055 | 6.002 | 3.674 | 0,03 |
| **Ginnie Mae, TBA** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 3.000 | 2.988 | 0,03 |
| **Small Business Administration** | | | |
| 4,720 % fällig am 01.02.2024 | 13 | 13 | 0,00 |
| 5,240 % fällig am 01.08.2023 | 13 | 13 | 0,00 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.06.2042 - 01.10.2046 | 38.845 | 37.119 | 0,34 |
| 3,500 % fällig am 01.10.2045 | 3.612 | 3.534 | 0,03 |
| 4,000 % fällig am 01.05.2030 - 01.11.2041 | 229 | 234 | 0,00 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.07.2052 | 39.000 | 33.857 | 0,31 |
| 3,000 % fällig am 01.08.2052 | 8.600 | 8.003 | 0,07 |
| 3,500 % fällig am 01.07.2052 | 119.522 | 114.903 | 1,04 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 519.500 | 511.645 | 4,65 |
| | | 738.444 | 6,70 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | |
| 1,375 % fällig am 15.11.2040 | 149.120 | 107.454 | 0,97 |
| 1,750 % fällig am 15.08.2041 | 81.800 | 62.254 | 0,56 |
| 1,875 % fällig am 15.02.2041 | 297.100 | 233.136 | 2,12 |
| 1,875 % fällig am 15.11.2051 | 164.371 | 123.381 | 1,12 |
| 2,000 % fällig am 15.11.2041 | 189.400 | 150.499 | 1,37 |
| 2,250 % fällig am 15.05.2041 | 68.000 | 56.769 | 0,51 |
| 2,250 % fällig am 15.08.2046 | 220 | 178 | 0,00 |
| 2,250 % fällig am 15.02.2052 | 70.400 | 57.959 | 0,53 |
| 2,375 % fällig am 15.02.2042 | 53.700 | 45.553 | 0,41 |
| 2,500 % fällig am 15.02.2045 | 28.750 | 24.406 | 0,22 |
| 2,750 % fällig am 15.11.2047 | 1.133 | 1.015 | 0,01 |
| 2,875 % fällig am 15.11.2046 | 1.461 | 1.333 | 0,01 |
| 2,875 % fällig am 15.05.2049 | 6.555 | 6.115 | 0,06 |
| 2,875 % fällig am 15.05.2052 | 77.200 | 72.936 | 0,66 |
| 3,000 % fällig am 15.05.2045 | 32.725 | 30.381 | 0,28 |
| 3,000 % fällig am 15.02.2048 | 40.992 | 38.641 | 0,35 |
| 3,125 % fällig am 15.05.2048 | 29.360 | 28.428 | 0,26 |
| 3,250 % fällig am 15.05.2042 | 28.100 | 27.433 | 0,25 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | |
| 2,875 % fällig am 15.05.2032 | 96.812 | 95.738 | 0,87 |
| **U.S. Treasury STRIPS** | | | |
| 0,000 % fällig am 15.05.2043 (d) | 25 | 12 | 0,00 |
| | | 1.163.621 | 10,56 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ GENS |
|---|---|---|---|
| **OPTIONSSCHEINE** | | | |
| **Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31. Dezember 2060** | 7.228 | $ 0 | 0,00 |
| Summe USA | | 5.671.380 | 51,48 |

| | PARI (000S) | | |
|---|---|---|---|
| **JUNGFERNINSELN (BRITISCH)** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Champion Path Holdings Ltd.** | | | |
| 4,500 % fällig am 27.01.2026 | $ 9.900 | 6.287 | 0,06 |
| 4,850 % fällig am 27.01.2028 | 13.700 | 8.051 | 0,07 |
| **CLP Power Hong Kong Financing Ltd.** | | | |
| 2,125 % fällig am 30.06.2030 | 16.900 | 14.286 | 0,13 |
| **Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.** | | | |
| 6,125 % fällig am 15.05.2029 | 3.800 | 3.889 | 0,03 |
| **JMH Co. Ltd.** | | | |
| 2,500 % fällig am 09.04.2031 | 4.900 | 4.167 | 0,04 |
| Summe Jungferninseln (Britisch) | | 36.680 | 0,33 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | |
| **Future Diamond Ltd.** | | | |
| 0,363 % fällig am 22.09.2022 | 7.500 | 7.006 | 0,06 |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | |
| 59,492 % fällig am 31.10.2022 (d)(e) | ARS 164.110 | 527 | 0,01 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 7.533 | 0,07 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | **$10.566.768** | **95,91** |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (g)** | 3.787.451 | 32.155 | 0,29 |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (g)** | 11.356.637 | 96.986 | 0,88 |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (g)** | 3.637.652 | 35.558 | 0,33 |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)** | 34.240.786 | 340.627 | 3,09 |
| **PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (g)** | 329.257 | 4.478 | 0,04 |
| | | 509.804 | 4,63 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g)** | 2.587.040 | 255.980 | 2,32 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$ 765.784** | **6,95** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 476 | U.S. Treasury Notes, 3,000 % fällig am 30.06.2024 | $ (486) | $ 476 | $ 476 | 0,00 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (486)** | **$ 476** | **$ 476** | **0,00** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month SOFR December Futures | Long | 03.2024 | 3.580 | $ 7.048 | 0,06 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Long | 09.2022 | 390 | 3.200 | 0,03 |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 3.134 | (4.263) | (0,04) |
| Euro-Schatz September Futures | Long | 09.2022 | 2.096 | (721) | (0,01) |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 989 | 680 | 0,01 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 369 | (615) | (0,01) |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2022 | 455 | (1.697) | (0,01) |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 770 | (1.172) | (0,01) |
| | | | | $ 2.460 | 0,02 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 2.460** | **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 – SCHUTZKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Toll Brothers Finance Corp. | (1,000) % | 20.06.2024 | $ 23.500 | $ 317 | 0,00 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| AES Corp. | 5,000 % | 20.12.2025 | $ 7.900 | $ (604) | (0,01) |
| AES Corp. | 5,000 | 20.06.2026 | 2.400 | (183) | 0,00 |
| Airbus Group Finance BV | 1,000 | 20.12.2025 | € 10.300 | (131) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.12.2023 | $ 12.100 | (142) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.12.2024 | 7.600 | (114) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.12.2025 | 2.000 | (27) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.06.2026 | 68.000 | (1.270) | (0,01) |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.12.2026 | 1.300 | (32) | 0,00 |
| Atlantia SpA | 1,000 | 20.12.2025 | € 1.800 | (40) | 0,00 |
| Auchan Holding S.A. | 1,000 | 20.12.2027 | 300 | (14) | 0,00 |
| Bank of America Corp. | 1,000 | 20.12.2022 | $ 16.000 | (74) | 0,00 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 | 20.12.2022 | 63.800 | (995) | (0,01) |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 | 20.06.2023 | 7.100 | 127 | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.06.2023 | 7.300 | (57) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.06.2026 | 1.000 | (41) | 0,00 |
| BP Capital Markets PLC | 1,000 | 20.12.2025 | € 6.800 | (116) | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.12.2024 | 23.900 | (119) | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.12.2025 | 6.000 | (63) | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.12.2027 | 500 | (9) | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.06.2028 | 20.400 | (779) | (0,01) |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.12.2028 | 1.100 | (41) | 0,00 |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20.12.2024 | $ 5.000 | (398) | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2023 | 12.050 | 0 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2023 | 42.850 | 2.050 | 0,02 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2024 | 32.050 | 199 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2024 | 27.900 | 331 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2026 | 18.750 | (593) | (0,01) |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2026 | 2.000 | (79) | 0,00 |
| General Motors Co. | 5,000 | 20.12.2026 | 5.300 | (552) | (0,01) |
| Hess Corp. | 1,000 | 20.06.2026 | 7.000 | (104) | 0,00 |
| International Lease Finance Corp. | 5,000 | 20.12.2023 | 6.100 | (438) | 0,00 |
| Lennar Corp. | 5,000 | 20.12.2026 | 3.200 | (315) | 0,00 |
| MetLife, Inc. | 1,000 | 20.12.2022 | 15.800 | (262) | 0,00 |
| MetLife, Inc. | 1,000 | 20.12.2023 | 11.000 | 441 | 0,00 |
| NextEra Energy Capital Holdings, Inc. | 1,000 | 20.06.2026 | 11.300 | (143) | 0,00 |

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Rolls-Royce PLC | 1,000 % | 20.06.2024 | € 25.300 | $ (780) | (0,01) |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.12.2024 | 55.700 | (3.188) | (0,03) |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.06.2025 | 800 | 64 | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.12.2025 | 2.300 | 10 | 0,00 |
| Sherwin-Williams Co. | 1,000 | 20.12.2022 | $ 17.800 | (292) | 0,00 |
| Southwest Airlines Co. | 1,000 | 20.12.2026 | 3.100 | (61) | 0,00 |
| Stellantis NV | 5,000 | 20.06.2026 | € 16.100 | (1.860) | (0,02) |
| Stellantis NV | 5,000 | 20.12.2026 | 8.800 | (920) | (0,01) |
| Syngenta Finance NV | 1,000 | 20.06.2028 | 2.600 | (140) | 0,00 |
| Telefonica Emisiones S.A. | 1,000 | 20.06.2026 | 17.000 | (179) | 0,00 |
| Telefonica Emisiones S.A. | 1,000 | 20.06.2028 | 7.800 | (225) | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 | 20.12.2024 | 63.700 | 218 | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 | 20.12.2027 | 4.700 | (149) | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 | 20.06.2028 | 7.300 | (341) | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20.12.2022 | $ 3.000 | (44) | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20.06.2026 | 1.900 | (50) | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20.06.2027 | 4.300 | (51) | 0,00 |
| Vodafone Group PLC | 1,000 | 20.06.2023 | € 26.100 | (9) | 0,00 |
| Vodafone Group PLC | 1,000 | 20.06.2024 | 12.700 | (4) | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 | 20.12.2026 | 4.100 | (240) | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 | 20.06.2028 | 11.100 | (739) | (0,01) |
| | | | | **$ (13.567)** | **(0,12)** |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Crossover 37 5-Year Index | 5,000 % | 20.06.2027 | € 12.900 | $ (591) | (0,01) |
| iTraxx Europe Main 37 10-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 497.500 | (6.429) | (0,05) |
| | | | | **$ (7.020)** | **(0,06)** |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 % | 21.09.2027 | £ 73.200 | $ (2.547) | (0,02) |
| Erhalt[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2032 | 18.600 | 817 | 0,01 |
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 1,060 | 21.02.2052 | 7.700 | (2.227) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 1,101 | 21.02.2052 | 7.700 | (2.143) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 1,175 | 28.02.2052 | 10.300 | (2.660) | (0,02) |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 15.12.2023 | ¥ 910.000 | 16 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 15.09.2024 | 1.829.900 | 40 | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 18.12.2029 | 5.198.520 | (1.605) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,300 | 20.03.2028 | 7.992.900 | 114 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 | 15.06.2027 | $ 276.600 | 15.464 | 0,14 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 | 15.06.2027 | 355.500 | 15.502 | 0,14 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,859 | 17.02.2032 | 20.500 | 1.498 | 0,01 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,160 | 02.01.2025 | BRL 308.200 | (1.665) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,224 | 04.01.2027 | 447.900 | (3.029) | (0,03) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,245 | 04.01.2027 | 119.000 | (779) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,572 | 04.01.2027 | 37.000 | (179) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,715 | 04.01.2027 | 55.200 | (226) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,235 | 04.03.2025 | CAD 49.900 | (2.342) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,275 | 03.03.2025 | 20.800 | (915) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,276 | 03.03.2025 | 52.500 | (2.307) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,500 | 17.06.2030 | 334.800 | (25.611) | (0,23) |
| Zahlung[4] | 3-Month USD-LIBOR | 1,270 | 04.11.2023 | $ 492.700 | (2.180) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 12.04.2027 | € 88.900 | (4.089) | (0,04) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,700 | 11.04.2027 | 20.800 | (915) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 13.05.2027 | 62.700 | (2.028) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.05.2027 | 28.000 | (912) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 1,000 | 19.09.2023 | HUF 37.770.400 | (9.346) | (0,09) |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 1,250 | 19.09.2023 | 16.157.700 | (4.556) | (0,04) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,400 | 05.03.2026 | MXN 1.762.000 | (10.279) | (0,09) |
| Zahlung | UKRPI | 3,530 | 15.10.2031 | £ 60.800 | (9.211) | (0,08) |
| | | | | | $ (58.300) | (0,53) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (78.570)** | **(0,71)** |

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

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

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

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

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

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

### OPTIONSKAUF

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,000 % | 15.03.2023 | 53.270 | $ 6.064 | $ 25.143 | 0,23 |
| JPM | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,000 | 15.03.2023 | 35.260 | 3.891 | 16.642 | 0,15 |
| | | | | | | | $ 9.955 | $ 41.785 | 0,38 |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/-verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 % | 20.07.2022 | 25.100 | $ (38) | $ (19) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Crossover 36 5-Year Index | Verkauf | 5,250 | 20.07.2022 | 10.200 | (106) | (203) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 78.200 | (222) | (256) | (0,01) |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 28.100 | (51) | (12) | 0,00 |
| BRC | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 7.100 | (65) | (79) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 31.600 | (143) | (68) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,600 | 17.08.2022 | 10.200 | (25) | (18) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 10.800 | (16) | (8) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 20.800 | (40) | (24) | 0,00 |
| GST | Call - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Kauf | 0,700 | 17.08.2022 | 11.300 | (12) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,300 | 17.08.2022 | 32.700 | (73) | (52) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 95,000 | 17.08.2022 | 8.000 | (97) | (122) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 16.400 | (146) | (183) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 15.300 | (47) | (57) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,250 | 20.07.2022 | 13.800 | (22) | (8) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,350 | 17.08.2022 | 21.800 | (50) | (29) | 0,00 |
| | | | | | | $ (1.153) | $ (1.139) | (0,01) |

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,175 % | 15.03.2023 | 159.840 | $ (5.929) | $ (38.395) | (0,35) |
| CBK | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,600 | 07.07.2022 | 21.000 | (80) | (11) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,000 | 07.07.2022 | 21.000 | (80) | (16) | 0,00 |
| DUB | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,350 | 08.08.2022 | 31.200 | (122) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,550 | 08.08.2022 | 31.200 | (121) | (622) | (0,01) |
| GLM | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,870 | 02.11.2022 | 1.846.800 | (3.743) | (19) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,270 | 02.11.2022 | 1.846.800 | (3.743) | (42.330) | (0,38) |
| JPM | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,175 | 15.03.2023 | 105.770 | (3.823) | (25.406) | (0,23) |
| MYC | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,570 | 05.07.2022 | 21.500 | (76) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,970 | 05.07.2022 | 21.500 | (76) | (6) | 0,00 |
| | | | | | | | $ (17.793) | $ (106.809) | (0,97) |

#### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SAL | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | $ 99,156 | 07.07.2022 | 20.900 | $ (150) | $ (132) | 0,00 |

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2026 | $ 1.100 | $ (38) | $ (21) | $ (59) | 0,00 |
| | Italy Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 14.500 | (304) | 535 | 231 | 0,00 |
| | Italy Government International Bond | 1,000 | 20.06.2025 | 14.200 | (395) | 478 | 83 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 8.800 | (505) | (6.083) | (6.588) | (0,06) |
| BRC | Huarong Finance Co. Ltd. | 1,000 | 20.12.2024 | 23.000 | (471) | (295) | (766) | (0,01) |

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Italy Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 13.500 | $ (294) | $ 509 | $ 215 | 0,00 |
| | Italy Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 19.100 | 54 | 277 | 331 | 0,01 |
| | Italy Government International Bond | 1,000 | 20.06.2025 | 49.700 | (1.207) | 1.497 | 290 | 0,00 |
| | NextEra Energy Capital Holdings, Inc. | 1,000 | 20.12.2025 | 7.800 | 170 | (81) | 89 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 31.400 | (1.186) | 254 | (932) | (0,01) |
| CBK | Intrum AB | 5,000 | 20.12.2024 | € 3.000 | 286 | (278) | 8 | 0,00 |
| | Italy Government International Bond | 1,000 | 20.06.2025 | $ 11.100 | (270) | 335 | 65 | 0,00 |
| DUB | Saudi Arabia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2025 | 5.700 | (5) | 93 | 88 | 0,00 |
| FBF | Italy Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 3.000 | 7 | 45 | 52 | 0,00 |
| | Italy Government International Bond | 1,000 | 20.06.2025 | 13.000 | (201) | 374 | 173 | 0,00 |
| GLM | Italy Government International Bond | 1,000 | 20.06.2025 | 44.900 | (502) | 1.343 | 841 | 0,01 |
| GST | Intrum AB | 5,000 | 20.12.2024 | € 34.400 | 4.118 | (4.023) | 95 | 0,00 |
| | Saudi Arabia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2025 | $ 5.700 | (7) | 95 | 88 | 0,00 |
| | Saudi Arabia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 1.400 | 33 | (14) | 19 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 5.700 | (229) | 60 | (169) | 0,00 |
| JLN | Intrum AB | 5,000 | 20.12.2024 | € 10.000 | 1.189 | (1.161) | 28 | 0,00 |
| JPM | Hochtief AG | 5,000 | 20.12.2025 | 29.400 | 6.791 | (4.179) | 2.612 | 0,03 |
| | NextEra Energy Capital Holdings, Inc. | 1,000 | 20.06.2024 | $ 16.300 | 223 | (27) | 196 | 0,00 |
| | NextEra Energy Capital Holdings, Inc. | 1,000 | 20.12.2024 | 8.100 | 112 | (11) | 101 | 0,00 |
| | Saudi Arabia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2025 | 7.600 | (1) | 119 | 118 | 0,00 |
| | Southern Co. | 1,000 | 20.12.2022 | 23.000 | 285 | (124) | 161 | 0,00 |
| MYC | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 15.800 | (978) | (343) | (1.321) | (0,01) |
| | Brookfield Asset Management, Inc. | 1,000 | 20.06.2025 | 7.900 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | Consolidated Edison Co. of New York, Inc. | 1,000 | 20.12.2024 | 16.500 | 322 | (8) | 314 | 0,01 |
| | Pioneer Natural Resources Co. | 1,000 | 20.06.2025 | 8.400 | (408) | 528 | 120 | 0,00 |
| MYI | Intrum AB | 5,000 | 20.12.2024 | € 2.700 | 311 | (304) | 7 | 0,00 |
| | | | | | $ 6.900 | $ (10.431) | $ (3.531) | (0,03) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 % | 5,000 % | 20.12.2023 | $ 5.800 | $ 676 | $ (415) | $ 261 | 0,00 |
| CBK | CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2023 | 8.000 | 828 | (467) | 361 | 0,01 |
| DUB | iTraxx Japan 37 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | ¥ 6.424.322 | 1.002 | (1.022) | (20) | 0,00 |
| GST | CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2023 | $ 24.000 | 2.849 | (1.767) | 1.082 | 0,01 |
| | iTraxx Japan 37 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | ¥ 6.875.570 | 1.070 | (1.091) | (21) | 0,00 |
| JPM | CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2023 | $ 44.300 | 5.449 | (3.454) | 1.995 | 0,02 |
| | iTraxx Japan 37 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | ¥ 7.802.000 | 1.221 | (1.245) | (24) | 0,00 |
| MYC | CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2023 | $ 6.600 | 784 | (487) | 297 | 0,00 |
| | | | | | $ 13.879 | $ (9.948) | $ 3.931 | 0,04 |

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

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

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | $ | 10.888 | AUD | 15.662 | $ 0 | $ (118) | $ (118) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 15.662 | $ | 10.891 | 119 | 0 | 119 | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | CAD | 15.518 | | 12.228 | 198 | 0 | 198 | 0,00 |
| | 07.2022 | HUF | 280.025 | | 775 | 39 | 0 | 39 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 18.569 | AUD | 26.748 | 0 | (175) | (175) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 30.198 | CHF | 28.857 | 0 | (55) | (55) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 19.682 | DKK | 138.380 | 0 | (228) | (228) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.434 | € | 2.301 | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 15.304 | £ | 12.098 | 0 | (611) | (611) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 5.455 | PEN | 20.421 | 0 | (87) | (87) | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 241.530 | $ | 15.884 | 1.159 | 0 | 1.159 | 0,01 |
| | 08.2022 | AUD | 26.748 | | 18.573 | 176 | 0 | 176 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 138.099 | | 19.682 | 233 | 0 | 233 | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 328.651 | | 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 12.564 | NOK | 119.629 | 0 | (445) | (445) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 5.887 | PEN | 22.000 | 0 | (120) | (120) | 0,00 |
| | 09.2022 | PEN | 60.000 | $ | 15.534 | 0 | (155) | (155) | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 38.927 | | 2.452 | 105 | 0 | 105 | 0,00 |
| | 12.2022 | PEN | 47.353 | | 12.398 | 122 | 0 | 122 | 0,00 |
| | 01.2023 | | 7.411 | | 1.951 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CAD | 7.461 | | 5.852 | 75 | (7) | 68 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 24.378 | | 25.852 | 366 | 0 | 366 | 0,00 |
| | 07.2022 | HUF | 900.520 | | 2.361 | 4 | (10) | (6) | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 27.630 | | 1.375 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.131 | AUD | 1.618 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07.2022 | $ | 3.407 | CAD | 4.415 | $ 16 | $ 0 | $ 16 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 99.139 | € | 93.387 | 0 | (1.508) | (1.508) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 42.038 | £ | 33.598 | 0 | (1.234) | (1.234) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 4 | HUF | 1.635 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.026 | ¥ | 139.600 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.759 | MXN | 57.710 | 101 | 0 | 101 | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 8.276 | $ | 529 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 4.394 | IDR | 64.790.076 | 0 | (68) | (68) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 629 | INR | 49.063 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 08.2022 | ZAR | 262.179 | $ | 16.420 | 486 | 0 | 486 | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 1.355 | MXN | 27.630 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 106.148 | $ | 6.618 | 221 | 0 | 221 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | £ | 5.132 | | 6.278 | 46 | 0 | 46 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 24.441 | £ | 19.972 | 0 | (186) | (186) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 3.929 | ¥ | 532.957 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 532.092 | $ | 3.929 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 4.816 | IDR | 71.283.716 | 0 | (56) | (56) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 8.660 | NOK | 84.743 | 0 | (75) | (75) | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 40.257 | $ | 2.508 | 82 | 0 | 82 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | PEN | 112.098 | | 28.541 | 8 | (934) | (926) | (0,01) |
| | 07.2022 | $ | 11.846 | BRL | 58.941 | 0 | (575) | (575) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 13.780 | PEN | 51.496 | 0 | (249) | (249) | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 134.753 | $ | 8.974 | 763 | 0 | 763 | 0,01 |
| | 08.2022 | PEN | 74.421 | | 19.054 | 0 | (468) | (468) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 27.570 | PEN | 104.785 | 92 | (192) | (100) | 0,00 |
| | 09.2022 | PEN | 94.323 | $ | 24.704 | 39 | 0 | 39 | 0,00 |
| | 10.2022 | | 150.000 | | 37.704 | 0 | (1.373) | (1.373) | (0,01) |
| | 10.2022 | $ | 19.259 | MXN | 404.321 | 433 | 0 | 433 | 0,00 |
| | 12.2022 | PEN | 317.460 | $ | 79.086 | 256 | (3.505) | (3.249) | (0,03) |
| | 03.2023 | | 4.335 | | 1.120 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | CHF | 28.684 | | 30.198 | 236 | 0 | 236 | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK | 37.746 | | 5.589 | 283 | 0 | 283 | 0,00 |
| | 07.2022 | PLN | 1.549 | | 355 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 30.198 | CHF | 28.637 | 0 | (234) | (234) | 0,00 |
| | 12.2022 | ZAR | 184.084 | $ | 11.716 | 659 | 0 | 659 | 0,01 |
| | 02.2023 | | 13.423 | | 804 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | $ | 789 | PEN | 3.042 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN | 29.851 | $ | 7.955 | 130 | 0 | 130 | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 380 | MXN | 7.676 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 10.2022 | | 28.608 | | 585.580 | 0 | (88) | (88) | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 48.708 | $ | 3.034 | 99 | 0 | 99 | 0,00 |
| | 05.2023 | | 23.592 | | 1.412 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | $ | 314 | AUD | 457 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 457 | $ | 314 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 102 | | 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | KRW | 166.393 | | 131 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | SGD | 950 | | 691 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 6.427 | IDR | 94.539.843 | 0 | (113) | (113) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 20.795 | PEN | 77.440 | 0 | (495) | (495) | (0,01) |
| MBC | 07.2022 | AUD | 47.575 | $ | 32.945 | 230 | 0 | 230 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 1.908.143 | | 2.057.734 | 62.867 | 0 | 62.867 | 0,57 |
| | 07.2022 | MXN | 55.073 | | 2.702 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 59.200 | AUD | 85.959 | 0 | (90) | (90) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 11.197 | CAD | 14.137 | 0 | (237) | (237) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.932.165 | € | 1.836.688 | 27 | (12.027) | (12.000) | (0,11) |
| | 07.2022 | | 5.841 | £ | 4.686 | 0 | (150) | (150) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 85.959 | $ | 59.208 | 86 | 0 | 86 | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 1.810.584 | | 1.908.198 | 11.826 | 0 | 11.826 | 0,11 |
| | 08.2022 | $ | 31.538 | CLP | 26.427.431 | 0 | (3.527) | (3.527) | (0,03) |
| | 08.2022 | | 28.226 | COP | 116.484.309 | 0 | (470) | (470) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 2.837 | IDR | 41.589.276 | 0 | (59) | (59) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | CHF | 1 | $ | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK | 129.693 | | 19.242 | 1.009 | 0 | 1.009 | 0,01 |
| | 07.2022 | € | 667 | | 701 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 169.900 | | 1.250 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | SGD | 13 | | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.702 | CAD | 2.207 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 281 | CHF | 269 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 4.128 | DKK | 29.042 | 0 | (45) | (45) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.278 | € | 1.218 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 13.599 | £ | 11.203 | 21 | (14) | 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 75 | SEK | 767 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 28.983 | $ | 4.128 | 46 | 0 | 46 | 0,00 |
| | 08.2022 | KRW | 215.362 | | 169 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 5.438 | IDR | 80.231.058 | 0 | (83) | (83) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.055 | INR | 82.404 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| RBC | 07.2022 | CAD | 8.136 | $ | 6.392 | 85 | 0 | 85 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 29.728 | CAD | 38.222 | 0 | (98) | (98) | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 38.224 | $ | 29.728 | 97 | 0 | 97 | 0,00 |
| | 09.2022 | MXN | 791.472 | | 38.465 | 0 | (301) | (301) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | $ | 2.384 | AUD | 3.466 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 3.399 | PEN | 12.844 | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 39.945 | $ | 2.632 | 198 | 0 | 198 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08.2022 | AUD | 3.466 | $ | 2.384 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 4.242 | PEN | 15.842 | 0 | (89) | (89) | 0,00 |
| | 09.2022 | ZAR | 167.868 | $ | 10.858 | 683 | 0 | 683 | 0,01 |
| | 11.2022 | $ | 2.885 | COP | 12.262.091 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 12.2022 | PEN | 30.818 | $ | 7.360 | 0 | (635) | (635) | (0,01) |
| SOG | 07.2022 | $ | 37.789 | £ | 31.051 | 0 | (79) | (79) | 0,00 |
| | 08.2022 | £ | 31.051 | $ | 37.806 | 79 | 0 | 79 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 13.307 | NOK | 130.506 | 0 | (87) | (87) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | BRL | 58.941 | $ | 11.397 | 126 | 0 | 126 | 0,00 |
| | 07.2022 | CAD | 169.510 | | 132.714 | 1.306 | 0 | 1.306 | 0,01 |
| | 07.2022 | £ | 515.118 | | 649.419 | 23.834 | 0 | 23.834 | 0,22 |
| | 07.2022 | ¥ | 737.501 | | 5.810 | 382 | 0 | 382 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 609 | AUD | 885 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 89.724 | CAD | 115.428 | 17 | (258) | (241) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 650 | HUF | 234.154 | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 885 | $ | 609 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 115.436 | | 89.724 | 256 | (17) | 239 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 11.307 | BRL | 58.941 | 0 | (134) | (134) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | AUD | 87.577 | $ | 62.556 | 2.333 | 0 | 2.333 | 0,02 |
| | 07.2022 | HUF | 4.428.898 | | 12.629 | 990 | 0 | 990 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 4.526 | ZAR | 72.830 | 0 | (89) | (89) | 0,00 |
| | 09.2022 | MXN | 265.941 | $ | 13.346 | 321 | 0 | 321 | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 117.129 | | 7.400 | 341 | 0 | 341 | 0,00 |
| | | | | | | $ 113.848 | $ (32.040) | $ 81.808 | 0,74 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) ausschüttend und Investor AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | AUD | 3.921 | $ | 2.726 | $ 30 | $ 0 | $ 30 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2.106 | AUD | 3.030 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 2.726 | | 3.921 | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | AUD | 4.637 | $ | 3.219 | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 3.235 | AUD | 4.494 | 0 | (145) | (145) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 3.220 | | 4.637 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | AUD | 21 | $ | 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 938 | AUD | 1.308 | 0 | (39) | (39) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | AUD | 1.555 | $ | 1.119 | 50 | 0 | 50 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | | 614 | | 431 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 3.213 | AUD | 4.471 | 0 | (138) | (138) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | | 2.106 | | 3.030 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | AUD | 4.010 | $ | 2.757 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 2.758 | AUD | 4.010 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | | 3.063 | | 4.288 | 0 | (114) | (114) | 0,00 |
| | | | | | | $ 120 | $ (541) | $ (421) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional CAD (Hedged) ausschüttend und Investor 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 | 07.2022 | $ | 81 | CAD | 102 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CAD | 2 | $ | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 80 | CAD | 102 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | | 1 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 81 | | 103 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | | | | | | $ 0 | $ (4) | $ (4) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend, Investor CHF (Hedged) ausschüttend, Administrative CHF (Hedged) thesaurierend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend und Class W CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | CHF | 253 | $ | 254 | $ 0 | $ (11) | $ (11) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 290.699 | CHF | 277.790 | 0 | (534) | (534) | (0,01) |
| BPS | 07.2022 | CHF | 15.175 | $ | 15.594 | 5 | (262) | (257) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 4.832 | CHF | 4.634 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | | 290.500 | | 278.060 | 0 | (53) | (53) | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | CHF | 269.795 | $ | 284.034 | 2.219 | 0 | 2.219 | 0,02 |
| | 07.2022 | $ | 279.530 | CHF | 268.121 | 536 | 0 | 536 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 284.034 | | 269.348 | 0 | (2.201) | (2.201) | (0,02) |
| JPM | 07.2022 | | 92 | | 90 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | CHF | 115 | $ | 117 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 471 | CHF | 452 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SCX | 07.2022 | CHF 1.999 | $ 2.057 | $ 0 | $ (31) | $ (31) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 28.053 | CHF 26.647 | 0 | (219) | (219) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | CHF 890 | $ 908 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 6.889 | CHF 6.594 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | $ 2.772 | $ (3.336) | $ (564) | (0,01) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional CZK (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 | 07.2022 | CZK 16.679 | $ 700 | $ 0 | $ (5) | $ (5) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | 446.471 | 18.975 | 105 | 0 | 105 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ 25.224 | CZK 582.323 | 0 | (612) | (612) | (0,01) |
| GLM | 07.2022 | 165 | 3.823 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | CZK 446.471 | $ 18.974 | 104 | 0 | 104 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 26.639 | CZK 616.508 | 0 | (582) | (582) | (0,01) |
| MBC | 07.2022 | CZK 457.587 | $ 19.440 | 100 | 0 | 100 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 23.657 | CZK 548.605 | 0 | (470) | (470) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | CZK 22.970 | $ 985 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | | | | $ 324 | $ (1.672) | $ (1.348) | (0,01) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) ausschüttend, Class E EUR (Currency Exposure) ausschüttend und H Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | AUD 743 | $ 516 | $ 6 | $ 0 | $ 6 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 517 | AUD 743 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | AUD 1.269 | $ 881 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 07.2022 | € 82 | 87 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 126 | AUD 175 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07.2022 | 434 | CAD 545 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07.2022 | 3.713 | € 3.458 | 0 | (97) | (97) | 0,00 |
| | 07.2022 | 8.569 | £ 6.803 | 0 | (308) | (308) | (0,01) |
| | 08.2022 | 881 | AUD 1.269 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | € 44.259 | $ 46.552 | 282 | 0 | 282 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 123 | AUD 179 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 283 | CAD 359 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07.2022 | 689 | CHF 661 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | 6.504 | € 6.144 | 0 | (81) | (81) | 0,00 |
| | 07.2022 | 1.152 | ¥ 149.321 | 0 | (53) | (53) | 0,00 |
| | 08.2022 | 46.195 | € 43.840 | 0 | (278) | (278) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | € 416 | $ 447 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 99 | ¥ 13.227 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | AUD 15 | $ 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 10 | AUD 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | € 20 | $ 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 1.318 | AUD 1.826 | 0 | (63) | (63) | 0,00 |
| | 07.2022 | 354 | CAD 448 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07.2022 | 80 | € 77 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 479 | £ 380 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 07.2022 | 108 | NZD 165 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07.2022 | 68 | SEK 669 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| RBC | 07.2022 | 434 | CAD 558 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | AUD 113 | $ 78 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 78 | AUD 113 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | £ 7.183 | $ 8.741 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 37.680 | € 35.057 | 0 | (1.029) | (1.029) | (0,01) |
| | 08.2022 | 8.745 | £ 7.183 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | AUD 29 | $ 20 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 3.825 | CAD 4.886 | 0 | (38) | (38) | 0,00 |
| | 08.2022 | 20 | AUD 29 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 328 | $ (2.037) | $ (1.709) | (0,02) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class R EUR (Hedged) ausschüttend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend, Class W EUR (Hedged) thesaurierend und Class W EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | € 4.129 | $ 4.367 | $ 51 | $ 0 | $ 51 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 3.000 | € 2.795 | 0 | (79) | (79) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | € 1.066.999 | $ 1.122.423 | 6.928 | 0 | 6.928 | 0,06 |
| | 07.2022 | $ 33.487 | € 31.788 | 0 | (254) | (254) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08.2022 | $ 1.060.572 | € 1.006.505 | $ 0 | $ (6.377) | $ (6.377) | (0,06) |
| CBK | 07.2022 | € 1.558 | $ 1.663 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 21.581 | € 20.100 | 0 | (567) | (567) | (0,01) |
| MBC | 07.2022 | € 1.030.862 | $ 1.084.306 | 6.671 | (81) | 6.590 | 0,06 |
| | 07.2022 | $ 1.140.528 | € 1.057.616 | 0 | (34.843) | (34.843) | (0,31) |
| | 08.2022 | 1.060.769 | 1.006.505 | 0 | (6.574) | (6.574) | (0,06) |
| SOG | 07.2022 | 1.135.831 | 1.056.776 | 0 | (31.025) | (31.025) | (0,28) |
| UAG | 07.2022 | 972.372 | 904.868 | 0 | (26.378) | (26.378) | (0,24) |
| | | | | $ 13.685 | $ (106.178) | $ (92.493) | (0,84) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) ausschüttend, Administrative GBP (Hedged) ausschüttend, Class E GBP (Hedged) ausschüttend, Class R GBP (Hedged) ausschüttend, Class W GBP (Hedged) thesaurierend und Class W GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | £ 24.791 | $ 31.196 | $ 1.088 | $ 0 | $ 1.088 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ 609.850 | £ 482.328 | 0 | (24.086) | (24.086) | (0,22) |
| BPS | 07.2022 | £ 54.845 | $ 67.275 | 715 | (46) | 669 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ 9.069 | £ 7.289 | 2 | (220) | (218) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | £ 3.160 | $ 3.866 | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 609.848 | £ 483.453 | 0 | (22.718) | (22.718) | (0,21) |
| CBK | 07.2022 | £ 10.034 | $ 12.597 | 411 | 0 | 411 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | 30.732 | 37.835 | 512 | 0 | 512 | 0,01 |
| MYI | 07.2022 | 3.073 | 3.713 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 1.100 | 1.351 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 24.277 | £ 19.320 | 0 | (815) | (815) | (0,01) |
| SOG | 07.2022 | £ 432.047 | $ 525.801 | 1.102 | 0 | 1.102 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ 526.046 | £ 432.047 | 0 | (1.094) | (1.094) | (0,01) |
| TOR | 07.2022 | 605.874 | 480.578 | 0 | (22.236) | (22.236) | (0,20) |
| | | | | $ 3.873 | $ (71.235) | $ (67.362) | (0,61) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | $ 13.461 | NOK 127.056 | $ 0 | $ (601) | $ (601) | (0,01) |
| BRC | 07.2022 | NOK 120.701 | $ 12.312 | 95 | 0 | 95 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ 13.461 | NOK 126.807 | 0 | (627) | (627) | (0,01) |
| | 08.2022 | 12.312 | 120.648 | 0 | (94) | (94) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | 198 | 1.851 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | NOK 2.425 | $ 257 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | 3.838 | 382 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 0 | NOK 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 30 | 298 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | 13.318 | 125.578 | 0 | (607) | (607) | (0,01) |
| | | | | $ 107 | $ (1.947) | $ (1.840) | (0,02) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional PLN (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | PLN 107.906 | $ 25.157 | $ 1.155 | $ 0 | $ 1.155 | 0,01 |
| CBK | 07.2022 | $ 8.370 | PLN 36.010 | 0 | (360) | (360) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | 8.370 | 35.839 | 0 | (398) | (398) | (0,01) |
| UAG | 07.2022 | 8.401 | 36.058 | 0 | (381) | (381) | 0,00 |
| | | | | $ 1.155 | $ (1.139) | $ 16 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | SEK 340 | $ 34 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | 45.125 | 4.407 | 11 | (8) | 3 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | 1.139.133 | 112.103 | 940 | 0 | 940 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ 112.103 | SEK 1.138.189 | 0 | (925) | (925) | (0,01) |
| MBC | 07.2022 | SEK 18.553 | $ 1.835 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 825 | SEK 8.055 | 0 | (39) | (39) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | SEK 2.930 | $ 300 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | 1.498 | 148 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 6.483 | 656 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 128.177 | SEK 1.252.582 | 0 | (5.943) | (5.943) | (0,05) |
| SOG | 07.2022 | 115.276 | 1.131.707 | 0 | (4.838) | (4.838) | (0,05) |
| TOR | 07.2022 | 123.363 | 1.207.655 | 0 | (5.514) | (5.514) | (0,05) |
| | | | | $ 1.017 | $ (17.267) | $ (16.250) | (0,15) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend, Class E SGD (Hedged) ausschüttend und Class W SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | SGD 6.335 | $ 4.559 | $ 7 | $ 0 | $ 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 9.570 | SGD 13.112 | 0 | (148) | (148) | 0,00 |
| | 08.2022 | 4.559 | 6.335 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | SGD 12.705 | $ 9.145 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 34 | SGD 48 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 9.145 | 12.706 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | SGD 648 | $ 469 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 716 | SGD 984 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | 1.200 | 1.647 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 9.704 | 13.262 | 0 | (175) | (175) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | SGD 167 | $ 121 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 10.046 | SGD 13.756 | 0 | (162) | (162) | 0,00 |
| | | | | $ 28 | $ (533) | $ (505) | 0,00 |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **$ (166.567)** | **(1,51)** |

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ GENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.07.2052 (i) | $ 46.600 | $ (40.455) | (0,37) |
| 2,000 % fällig am 01.08.2052 | 159.700 | (138.489) | (1,25) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (178.944)** | **(1,62)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 10.911.407** | **99,04** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ 105.900** | **0,96** |
| **Nettovermögen** | | **$ 11.017.307** | **100,00** |

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

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

**^** **Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a)** **Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

**(b)** **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

**(c)** **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

**(d)** **Nullkuponwertpapier.**

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

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

**(g)** **Mit dem Fonds verbunden.**

**(h)** **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(i)** **Zum 30. Juni 2022 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.**

**(j)** **Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeits-datum | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| AT&T, Inc. | 4,850 % | 25.05.2047 | 17.05.2017 - 09.04.2019 | $ 2.530 | $ 2.273 | 0,02 |
| Citigroup, Inc. | 2,572 | 03.06.2031 | 26.05.2020 - 09.07.2020 | 25.069 | 20.784 | 0,19 |
| Deutsche Bank AG | 3,729 | 14.01.2032 | 21.01.2021 | 11.265 | 8.456 | 0,08 |
| Morgan Stanley | 0,000 | 02.04.2032 | 11.02.2020 | 40.632 | 29.290 | 0,27 |
| Oracle Corp. | 4,100 | 25.03.2061 | 24.03.2021 - 26.03.2021 | 6.838 | 4.683 | 0,04 |
| | | | | $ 86.334 | $ 65.486 | 0,60 |

**(k)** **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 5.009 als Sicherheiten verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von USD 200.176 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 190.890 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 10.558.032 | $ 8.735 | $ 10.566.768 |
| Investmentfonds | 509.804 | 255.980 | 0 | 765.784 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 476 | 0 | 476 |
| Finanzderivate[3] | (1.783) | (240.894) | 0 | (242.677) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (178.944) | 0 | (178.944) |
| **Summen** | **$ 508.022** | **$ 10.394.650** | **$ 8.735** | **$ 10.911.407** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 1 | $ 16.258.039 | $ 25.151 | $ 16.283.191 |
| Investmentfonds | 1.100.873 | 0 | 0 | 1.100.873 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 4.429 | 0 | 4.429 |
| Finanzderivate[3] | (17.710) | (6.413) | 0 | (24.123) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (224.962) | 0 | (224.962) |
| **Summen** | **$ 1.083.164** | **$ 16.031.093** | **$ 25.151** | **$ 17.139.408** |

(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 2022:**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | (1,750) % | 23.05.2022 | TBD[1] | € (2.752 ) | $ (2.873) | (0,02) |
| JML | (1,100 ) | 29.03.2022 | TBD[1] | (2.891 ) | (3.010) | (0,03) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (5.883)** | **(0,05)** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ (20) | $ 0 | $ (20) |
| BOA | (30.383) | 30.340 | (43) |
| BPS | (14.236) | 15.160 | 924 |
| BRC | (24.428) | 22.780 | (1.648) |
| CBK | (6.282) | 5.370 | (912) |
| DUB | 930 | (1.910) | (980) |
| FBF | 225 | (250) | (25) |
| GLM | (41.347) | 43.490 | 2.143 |
| GST | 1.041 | (1.320) | (279) |
| JLN | 28 | 0 | 28 |
| JPM | (5.041) | 5.040 | (1) |
| MBC | 23.113 | (21.480) | 1.633 |
| MYC | (655) | (985) | (1.640) |
| MYI | 902 | (870) | 32 |
| RBC | (219) | 280 | 61 |
| RYL | (5) | 0 | (5) |
| SAL | (132) | 310 | 178 |
| SCX | (7.024) | 6.410 | (614) |
| SOG | (36.971) | 37.990 | 1.019 |
| TOR | (2.310) | 1.680 | (630) |
| UAG | (23.753) | 21.250 | (2.503) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 68,78 | 70,71 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 26,24 | 23,22 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 0,89 | 0,98 |
| Investmentfonds | 6,95 | 6,42 |
| Pensionsgeschäfte | 0,00 | 0,03 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,02 | (0,09) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,71) | (0,42) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (1,51) | 0,37 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (1,62) | (1,31) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (0,05) | (0,04) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Australien | 1,68 | 1,36 |
| Österreich | 0,22 | 0,36 |
| Belgien | 0,17 | 0,29 |
| Bermuda | 0,71 | 0,82 |
| Brasilien | 0,71 | 1,15 |
| Kanada | 2,13 | 2,05 |
| Cayman-Inseln | 3,68 | 4,90 |
| Chile | 0,07 | 0,05 |
| China | 1,18 | 1,26 |
| Kolumbien | 0,02 | 0,03 |
| Dänemark | 0,41 | 0,47 |
| Finnland | 0,19 | 0,18 |
| Frankreich | 2,35 | 2,51 |
| Deutschland | 2,13 | 2,64 |
| Guernsey, Kanalinseln | 0,37 | 0,46 |
| Hongkong | 0,28 | 0,83 |
| Indien | 0,44 | 0,53 |
| Indonesien | 0,39 | 0,35 |
| Irland | 0,82 | 0,92 |
| Insel Man | k. A. | 0,18 |
| Italien | 2,54 | 2,23 |
| Japan | 1,90 | 1,92 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,80 | 0,66 |
| Kuwait | k. A. | 0,14 |
| Luxemburg | 2,67 | 4,05 |
| Mauritius | 0,38 | 0,33 |
| Mexiko | 0,42 | 0,49 |
| Multinational | 0,14 | 0,12 |
| Niederlande | 2,97 | 3,17 |
| Norwegen | 0,17 | 0,27 |
| Panama | 0,21 | 0,28 |
| Peru | 1,37 | 1,34 |
| Katar | 0,10 | 0,24 |
| Rumänien | 0,30 | 0,26 |
| Russland | 0,09 | 0,43 |
| Saudi-Arabien | 0,21 | 0,23 |
| Singapur | 0,57 | 0,40 |
| Slowenien | 0,10 | 0,00 |
| Südafrika | 0,94 | 0,47 |
| Südkorea | 0,11 | 0,14 |
| Spanien | 0,45 | 0,90 |
| Supranational | 0,21 | 0,15 |
| Schweden | 0,31 | 0,38 |
| Schweiz | 2,99 | 2,51 |
| Thailand | 0,07 | 0,05 |
| Türkei | 0,04 | 0,03 |
| Ukraine | 0,04 | 0,05 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 0,07 | 0,20 |
| Großbritannien | 5,91 | 7,19 |
| USA | 51,48 | 44,58 |
| Uruguay | k. A. | 0,01 |
| Jungferninseln (Britisch) | 0,33 | 0,31 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,07 | 0,04 |
| Investmentfonds | 6,95 | 6,42 |
| Pensionsgeschäfte | 0,00 | 0,03 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,02 | (0,09) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf | 0,00 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,12) | 0,01 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,06) | 0,02 |
| Zinsswaps | (0,53) | (0,45) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoptionen | 0,38 | 0,10 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,01) | 0,00 |
| Zinsswapoptionen | (0,97) | (0,19) |
| Optionen auf Wertpapiere | 0,00 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,03) | 0,08 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | 0,04 | 0,08 |
| Devisenterminkontrakte | 0,74 | (0,28) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (1,66) | 0,58 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (1,62) | (1,31) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 0,96 | 0,09 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **BERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Boral Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.05.2028 | $ | 200 | $ 188 | 0,01 |
| **Commonwealth Bank of Australia** | | | | |
| 3,743 % fällig am 12.09.2039 (d) | | 200 | 163 | 0,01 |
| **GPT Wholesale Office Fund** | | | | |
| 3,222 % fällig am 05.11.2031 | AUD | 1.440 | 798 | 0,06 |
| **Lendlease Finance Ltd.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 27.10.2027 | | 1.370 | 842 | 0,06 |
| 3,700 % fällig am 31.03.2031 | | 800 | 454 | 0,03 |
| **Macquarie University** | | | | |
| 2,250 % fällig am 22.05.2030 | | 750 | 420 | 0,03 |
| **Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 30.04.2025 | $ | 150 | 146 | 0,01 |
| **Transurban Finance Co. Pty. Ltd.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 16.03.2031 | | 2.100 | 1.724 | 0,12 |
| **Vicinity Centres Trust** | | | | |
| 4,927 % fällig am 02.06.2028 | AUD | 2.500 | 1.670 | 0,12 |
| **Woolworths Group Ltd.** | | | | |
| 0,375 % fällig am 15.11.2028 | € | 4.800 | 4.074 | 0,28 |
| Summe Australien | | | 10.479 | 0,73 |
| **ÖSTERREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Erste Group Bank AG** | | | | |
| 0,125 % fällig am 17.05.2028 | | 1.400 | 1.231 | 0,09 |
| 4,250 % fällig am 15.10.2027 (c)(d) | | 1.800 | 1.488 | 0,11 |
| 6,500 % fällig am 15.04.2024 (c)(d) | | 200 | 204 | 0,01 |
| Summe Österreich | | | 2.923 | 0,21 |
| **BELGIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **KBC Group NV** | | | | |
| 0,202 % fällig am 24.11.2022 | | 800 | 837 | 0,06 |
| 0,250 % fällig am 01.03.2027 | | 1.800 | 1.688 | 0,12 |
| 1,500 % fällig am 29.03.2026 | | 500 | 503 | 0,03 |
| **Silfin NV** | | | | |
| 2,875 % fällig am 11.04.2027 | | 2.000 | 1.527 | 0,11 |
| | | | 4.555 | 0,32 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Communaute Francaise de Belgique** | | | | |
| 0,625 % fällig am 11.06.2035 | | 2.000 | 1.659 | 0,11 |
| **Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap** | | | | |
| 1,500 % fällig am 11.04.2044 | | 300 | 251 | 0,02 |
| | | | 1.910 | 0,13 |
| Summe Belgien | | | 6.465 | 0,45 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco BTG Pactual S.A.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 11.01.2026 | $ | 2.300 | 2.046 | 0,14 |
| 4,500 % fällig am 10.01.2025 | | 2.500 | 2.411 | 0,17 |
| **Itau Unibanco Holding S.A.** | | | | |
| 2,900 % fällig am 24.01.2023 | | 300 | 299 | 0,02 |
| **Suzano Austria GmbH** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.01.2032 | | 1.500 | 1.133 | 0,08 |
| Summe Brasilien | | | 5.889 | 0,41 |
| **KANADA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bank of Montreal** | | | | |
| 1,758 % fällig am 10.03.2026 | CAD | 2.900 | 2.042 | 0,14 |
| **Brookfield Finance, Inc.** | | | | |
| 2,724 % fällig am 15.04.2031 | $ | 4.850 | 4.104 | 0,29 |
| **CGI, Inc.** | | | | |
| 2,300 % fällig am 14.09.2031 | | 1.000 | 804 | 0,06 |
| **Toronto-Dominion Bank** | | | | |
| 1,952 % fällig am 08.04.2030 | € | 3.700 | 3.513 | 0,24 |
| | | | 10.463 | 0,73 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Canada Government International Bond** | | | | |
| 2,250 % fällig am 01.12.2029 | CAD | 12.200 | $ 8.903 | 0,62 |
| **Province of Quebec** | | | | |
| 1,850 % fällig am 13.02.2027 | | 500 | 361 | 0,03 |
| | | | 9.264 | 0,65 |
| Summe Kanada | | | 19.727 | 1,38 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Alibaba Group Holding Ltd.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 09.02.2041 | $ | 2.100 | 1.447 | 0,10 |
| **CIFI Holdings Group Co. Ltd.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 17.08.2026 | | 800 | 455 | 0,03 |
| **Health & Happiness H&H International Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 24.10.2024 | | 1.200 | 1.050 | 0,07 |
| **MAF Sukuk Ltd.** | | | | |
| 3,933 % fällig am 28.02.2030 | | 400 | 384 | 0,03 |
| **Xiaomi Best Time International Ltd.** | | | | |
| 4,100 % fällig am 14.07.2051 | | 1.500 | 1.011 | 0,07 |
| Summe Cayman Inseln | | | 4.347 | 0,30 |
| **CHILE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco de Credito e Inversiones S.A.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 14.10.2031 | | 3.100 | 2.563 | 0,18 |
| **Banco Santander Chile** | | | | |
| 2,700 % fällig am 10.01.2025 | | 2.000 | 1.917 | 0,13 |
| | | | 4.480 | 0,31 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Chile Government International Bond** | | | | |
| 1,250 % fällig am 29.01.2040 | € | 200 | 137 | 0,01 |
| 1,250 % fällig am 22.01.2051 | | 2.200 | 1.273 | 0,09 |
| 2,750 % fällig am 31.01.2027 | $ | 3.200 | 2.995 | 0,21 |
| 3,500 % fällig am 31.01.2034 | | 2.000 | 1.783 | 0,12 |
| 3,500 % fällig am 25.01.2050 | | 300 | 230 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 15.04.2053 | | 1.600 | 1.215 | 0,09 |
| 4,340 % fällig am 07.03.2042 | | 1.000 | 892 | 0,06 |
| | | | 8.525 | 0,60 |
| Summe Chile | | | 13.005 | 0,91 |
| **KOLUMBIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BanColombia S.A.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 29.01.2025 | | 1.300 | 1.200 | 0,08 |
| **KROATIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Croatia Government International Bond** | | | | |
| 1,500 % fällig am 17.06.2031 | € | 300 | 269 | 0,02 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **A.P. Moller - Maersk A/S** | | | | |
| 0,750 % fällig am 25.11.2031 | | 1.900 | 1.589 | 0,11 |
| **GN Store Nord A/S** | | | | |
| 0,875 % fällig am 25.11.2024 | | 700 | 693 | 0,05 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 1,375 % fällig am 12.07.2027 | | 1.650 | 1.608 | 0,11 |
| **TDC Net A/S** | | | | |
| 5,056 % fällig am 31.05.2028 | | 5.200 | 5.094 | 0,36 |
| Summe Dänemark | | | 8.984 | 0,63 |
| **FINNLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Balder Finland Oyj** | | | | |
| 1,000 % fällig am 20.01.2029 | | 400 | 264 | 0,02 |
| **Castellum Helsinki Finance Holding Abp** | | | | |
| 0,875 % fällig am 17.09.2029 | | 1.000 | 712 | 0,05 |
| **Kemira Oyj** | | | | |
| 1,000 % fällig am 30.03.2028 | | 1.000 | 884 | 0,06 |
| **Nordea Bank Abp** | | | | |
| 1,500 % fällig am 30.09.2026 | $ | 3.000 | $ 2.667 | 0,19 |
| 3,750 % fällig am 01.03.2029 (c)(d) | | 3.300 | 2.439 | 0,17 |
| **SATO Oyj** | | | | |
| 1,375 % fällig am 24.02.2028 | € | 1.200 | 998 | 0,07 |
| **SBB Treasury Oyj** | | | | |
| 0,129 % fällig am 08.02.2024 | | 2.200 | 1.896 | 0,13 |
| 1,125 % fällig am 26.11.2029 | | 2.100 | 1.324 | 0,09 |
| **Tornator Oyj** | | | | |
| 1,250 % fällig am 14.10.2026 | | 200 | 198 | 0,02 |
| Summe Finnland | | | 11.382 | 0,80 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Accor S.A.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 29.11.2028 | | 4.100 | 3.416 | 0,24 |
| **Altarea S.C.A.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 17.01.2028 | | 2.200 | 1.833 | 0,13 |
| **Banque Federative du Credit Mutuel S.A.** | | | | |
| 0,250 % fällig am 29.06.2028 | | 900 | 810 | 0,06 |
| 1,750 % fällig am 19.12.2024 | £ | 100 | 116 | 0,01 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 0,875 % fällig am 11.07.2030 | € | 1.500 | 1.299 | 0,09 |
| 1,675 % fällig am 30.06.2027 | $ | 12.150 | 10.724 | 0,75 |
| 2,219 % fällig am 09.06.2026 | | 1.200 | 1.109 | 0,08 |
| 2,591 % fällig am 20.01.2028 | | 1.000 | 900 | 0,06 |
| 3,132 % fällig am 20.01.2033 | | 3.200 | 2.682 | 0,19 |
| 3,500 % fällig am 16.11.2027 | | 1.800 | 1.681 | 0,12 |
| 4,625 % fällig am 25.02.2031 (c)(d) | | 2.100 | 1.555 | 0,11 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 14.01.2028 | € | 3.400 | 3.119 | 0,22 |
| 2,045 % fällig am 19.10.2027 | $ | 4.000 | 3.532 | 0,25 |
| 3,116 % fällig am 19.10.2032 | | 300 | 242 | 0,02 |
| **CNP Assurances** | | | | |
| 1,250 % fällig am 27.01.2029 | € | 1.600 | 1.413 | 0,10 |
| **Credit Agricole Assurances S.A.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 06.10.2031 | | 3.400 | 2.690 | 0,19 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 0,125 % fällig am 09.12.2027 | | 700 | 617 | 0,04 |
| 3,173 % fällig am 22.03.2024 | $ | 2.000 | 2.007 | 0,14 |
| **Crown European Holdings S.A.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.02.2023 | € | 400 | 410 | 0,03 |
| **Danone S.A.** | | | | |
| 2,947 % fällig am 02.11.2026 | $ | 200 | 192 | 0,01 |
| **Electricite de France S.A.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 13.10.2025 | | 200 | 197 | 0,01 |
| **Faurecia SE** | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.06.2029 | € | 750 | 553 | 0,04 |
| 2,750 % fällig am 15.02.2027 | | 4.000 | 3.269 | 0,23 |
| **Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement** | | | | |
| 0,125 % fällig am 16.09.2025 | | 3.500 | 3.269 | 0,23 |
| **Ile-de-France Mobilites** | | | | |
| 0,400 % fällig am 28.05.2031 | | 1.700 | 1.540 | 0,11 |
| 0,675 % fällig am 24.11.2036 | | 1.900 | 1.543 | 0,11 |
| **JCDecaux S.A.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 07.02.2030 | | 2.300 | 1.973 | 0,14 |
| **L'Oreal S.A.** | | | | |
| 0,875 % fällig am 29.06.2026 | | 2.300 | 2.317 | 0,16 |
| **New Immo Holding S.A.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 26.11.2026 | | 200 | 183 | 0,01 |
| **SEB S.A.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 31.05.2024 | | 1.200 | 1.242 | 0,09 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 12.06.2029 | | 400 | 345 | 0,02 |
| 0,625 % fällig am 02.12.2027 | | 3.700 | 3.417 | 0,24 |
| 0,875 % fällig am 22.09.2028 | | 200 | 182 | 0,01 |
| 3,625 % fällig am 01.03.2041 | $ | 350 | 239 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 12.01.2027 | | 2.200 | 2.096 | 0,15 |
| 6,750 % fällig am 06.04.2028 (c)(d) | | 300 | 266 | 0,02 |
| 7,875 % fällig am 18.12.2023 (c)(d) | | 200 | 196 | 0,01 |
| **Valeo** | | | | |
| 1,000 % fällig am 03.08.2028 | € | 2.900 | 2.369 | 0,16 |
| **Verallia S.A.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 14.05.2028 | | 2.400 | 2.069 | 0,14 |
| 1,875 % fällig am 10.11.2031 | | 2.600 | 2.034 | 0,14 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Vilmorin & Cie S.A.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 26.03.2028 | € | 1.400 | $ 1.137 | 0,08 |
| | | | 70.783 | 4,96 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Action Logement Services** | | | | |
| 1,375 % fällig am 13.04.2032 | | 2.500 | 2.401 | 0,17 |
| **Agence Francaise de Developpement** | | | | |
| 1,625 % fällig am 25.05.2032 | | 2.000 | 1.983 | 0,14 |
| **Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale** | | | | |
| 1,375 % fällig am 20.01.2031 | $ | 4.000 | 3.409 | 0,24 |
| **France Government International Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 25.06.2044 | € | 2.100 | 1.487 | 0,11 |
| **SNCF Reseau** | | | | |
| 0,750 % fällig am 25.05.2036 | | 500 | 418 | 0,03 |
| 2,250 % fällig am 20.12.2047 | | 300 | 283 | 0,02 |
| **Societe Du Grand Paris EPIC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.11.2030 (b) | | 500 | 442 | 0,03 |
| 1,000 % fällig am 18.02.2070 | | 900 | 485 | 0,03 |
| 1,625 % fällig am 08.04.2042 | | 3.000 | 2.623 | 0,18 |
| **UNEDIC ASSEO** | | | | |
| 0,000 % fällig am 19.11.2030 (b) | | 300 | 265 | 0,02 |
| 0,250 % fällig am 16.07.2035 | | 500 | 398 | 0,03 |
| | | | 14.194 | 1,00 |
| Summe Frankreich | | | 84.977 | 5,96 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Commerzbank AG** | | | | |
| 3,000 % fällig am 14.09.2027 | | 2.800 | 2.859 | 0,20 |
| **Deutsche Bahn Finance GmbH** | | | | |
| 0,625 % fällig am 08.12.2050 | | 750 | 416 | 0,03 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 1,375 % fällig am 10.06.2026 | | 500 | 506 | 0,04 |
| 1,447 % fällig am 01.04.2025 (e) | $ | 2.000 | 1.870 | 0,13 |
| 1,875 % fällig am 23.02.2028 | € | 2.500 | 2.361 | 0,17 |
| 2,222 % fällig am 18.09.2024 | $ | 100 | 97 | 0,01 |
| 2,311 % fällig am 16.11.2027 | | 3.000 | 2.591 | 0,18 |
| 3,250 % fällig am 24.05.2028 | € | 1.200 | 1.200 | 0,08 |
| 3,547 % fällig am 18.09.2031 | $ | 300 | 251 | 0,02 |
| 3,742 % fällig am 07.01.2033 | | 2.300 | 1.677 | 0,12 |
| 3,961 % fällig am 26.11.2025 | | 500 | 484 | 0,03 |
| **Eurogrid GmbH** | | | | |
| 1,113 % fällig am 15.05.2032 | € | 300 | 258 | 0,02 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.09.2028 (b) | | 800 | 755 | 0,05 |
| 0,750 % fällig am 30.09.2030 | $ | 1.100 | 911 | 0,06 |
| 1,375 % fällig am 07.06.2032 | € | 1.600 | 1.576 | 0,11 |
| **Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen** | | | | |
| 1,000 % fällig am 26.05.2042 | | 1.900 | 1.431 | 0,10 |
| **Schaeffler AG** | | | | |
| 3,375 % fällig am 12.10.2028 | | 4.200 | 3.571 | 0,25 |
| **Sixt SE** | | | | |
| 1,750 % fällig am 09.12.2024 | | 400 | 409 | 0,03 |
| **Vantage Towers AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 31.03.2025 (b) | | 700 | 671 | 0,05 |
| 0,375 % fällig am 31.03.2027 | | 700 | 632 | 0,04 |
| **Vonovia SE** | | | | |
| 0,250 % fällig am 01.09.2028 | | 1.600 | 1.302 | 0,09 |
| 1,375 % fällig am 28.01.2026 | | 2.600 | 2.522 | 0,18 |
| 1,625 % fällig am 01.09.2051 | | 100 | 53 | 0,00 |
| 1,875 % fällig am 28.06.2028 | | 1.900 | 1.744 | 0,12 |
| 2,375 % fällig am 25.03.2032 | | 400 | 345 | 0,02 |
| **ZF Finance GmbH** | | | | |
| 2,000 % fällig am 06.05.2027 | | 1.500 | 1.213 | 0,09 |
| 2,250 % fällig am 03.05.2028 | | 2.300 | 1.773 | 0,13 |
| | | | 33.478 | 2,35 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.08.2031 (b) | | 14.700 | 13.663 | 0,96 |
| **Land Nordrhein-Westfalen** | | | | |
| 0,000 % fällig am 12.10.2035 (b) | | 700 | 536 | 0,03 |
| 0,500 % fällig am 25.11.2039 | | 200 | 153 | 0,01 |
| | | | 14.352 | 1,00 |
| Summe Deutschland | | | 47.830 | 3,35 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **GUERNSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 29.07.2026 | € | 2.100 | $ 1.767 | 0,12 |
| 3,000 % fällig am 29.03.2025 | | 300 | 277 | 0,02 |
| **Sirius Real Estate Ltd.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 22.06.2026 | | 100 | 90 | 0,01 |
| 1,750 % fällig am 24.11.2028 | | 2.300 | 1.864 | 0,13 |
| Summe Guernsey, Kanalinseln | | | 3.998 | 0,28 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Hong Kong Government International Bond** | | | | |
| 2,375 % fällig am 02.02.2051 | $ | 300 | 213 | 0,01 |
| **INDIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Axis Bank Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 08.08.2022 | | 200 | 200 | 0,01 |
| **Bharti Airtel Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 03.06.2031 | | 500 | 419 | 0,03 |
| 4,375 % fällig am 10.06.2025 | | 1.200 | 1.196 | 0,08 |
| **Indian Railway Finance Corp. Ltd.** | | | | |
| 3,570 % fällig am 21.01.2032 | | 5.100 | 4.374 | 0,31 |
| **JSW Hydro Energy Ltd.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 18.05.2031 | | 3.956 | 3.155 | 0,22 |
| **ReNew Power Pvt Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 05.03.2027 | | 1.550 | 1.420 | 0,10 |
| **ReNew Wind Energy AP2** | | | | |
| 4,500 % fällig am 14.07.2028 | | 3.400 | 2.666 | 0,19 |
| **Shriram Transport Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 13.03.2024 | | 1.000 | 924 | 0,07 |
| 5,100 % fällig am 16.07.2023 | | 200 | 192 | 0,01 |
| 5,950 % fällig am 24.10.2022 | | 1.700 | 1.681 | 0,12 |
| Summe Indien | | | 16.227 | 1,14 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bank Mandiri Persero Tbk PT** | | | | |
| 2,000 % fällig am 19.04.2026 | | 1.300 | 1.180 | 0,08 |
| **IRLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Jubilee CLO DAC** | | | | |
| 0,391 % fällig am 12.07.2028 | € | 24 | 25 | 0,00 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 2,450 % fällig am 29.10.2026 | $ | 400 | 349 | 0,02 |
| **AIB Group PLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 04.04.2028 | € | 3.800 | 3.659 | 0,26 |
| 6,250 % fällig am 23.06.2025 (c)(d) | | 300 | 293 | 0,02 |
| **Bank of Ireland Group PLC** | | | | |
| 1,875 % fällig am 05.06.2026 | | 4.100 | 4.080 | 0,29 |
| **CCEP Finance Ireland DAC** | | | | |
| 0,500 % fällig am 06.09.2029 | | 1.900 | 1.653 | 0,12 |
| **Johnson Controls International PLC** | | | | |
| 2,000 % fällig am 16.09.2031 | $ | 400 | 319 | 0,02 |
| **Smurfit Kappa Acquisitions ULC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.01.2026 | € | 300 | 309 | 0,02 |
| | | | 10.662 | 0,75 |
| Summe Irland | | | 10.687 | 0,75 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Assicurazioni Generali SpA** | | | | |
| 2,124 % fällig am 01.10.2030 | | 1.500 | 1.244 | 0,09 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 0,750 % fällig am 04.12.2024 | | 300 | 301 | 0,02 |
| 2,625 % fällig am 11.03.2036 | £ | 1.000 | 853 | 0,06 |
| 3,875 % fällig am 12.01.2028 | $ | 1.400 | 1.296 | 0,09 |
| 4,198 % fällig am 01.06.2032 | | 900 | 660 | 0,05 |
| 4,950 % fällig am 01.06.2042 | | 1.600 | 1.083 | 0,08 |
| 5,017 % fällig am 26.06.2024 | | 3.900 | 3.725 | 0,26 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 7,750 % fällig am 11.01.2027 (c)(d) | € | 200 | $ 199 | 0,01 |
| **Nexi SpA** | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.04.2026 | | 100 | 85 | 0,01 |
| 2,125 % fällig am 30.04.2029 | | 1.600 | 1.173 | 0,08 |
| **Snam SpA** | | | | |
| 0,750 % fällig am 20.06.2029 | | 500 | 435 | 0,03 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 1,982 % fällig am 03.06.2027 | $ | 1.900 | 1.644 | 0,12 |
| 4,625 % fällig am 12.04.2027 | | 2.000 | 1.920 | 0,13 |
| 5,459 % fällig am 30.06.2035 | | 1.300 | 1.052 | 0,07 |
| 7,296 % fällig am 02.04.2034 | | 4.400 | 4.048 | 0,28 |
| | | | 19.718 | 1,38 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Cassa Depositi e Prestiti SpA** | | | | |
| 1,000 % fällig am 11.02.2030 | € | 200 | 180 | 0,01 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 1,500 % fällig am 30.04.2045 | | 1.130 | 813 | 0,06 |
| 1,800 % fällig am 01.03.2041 | | 3.100 | 2.473 | 0,18 |
| | | | 3.466 | 0,25 |
| Summe Italien | | | 23.184 | 1,63 |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Central Nippon Expressway Co. Ltd.** | | | | |
| 0,894 % fällig am 10.12.2025 | $ | 1.300 | 1.177 | 0,08 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | |
| 0,337 % fällig am 08.06.2027 | € | 700 | 652 | 0,05 |
| 0,339 % fällig am 19.07.2024 | | 200 | 201 | 0,01 |
| 0,680 % fällig am 26.01.2023 | | 500 | 523 | 0,04 |
| 0,978 % fällig am 09.06.2024 | | 200 | 205 | 0,01 |
| 0,980 % fällig am 09.10.2023 | | 300 | 311 | 0,02 |
| 1,538 % fällig am 20.07.2027 | $ | 2.400 | 2.124 | 0,15 |
| 2,494 % fällig am 13.10.2032 | | 2.900 | 2.390 | 0,17 |
| 3,837 % fällig am 17.04.2026 | | 2.500 | 2.468 | 0,17 |
| **Mitsui Fudosan Co. Ltd.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 23.01.2023 | | 3.385 | 3.380 | 0,24 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | |
| 0,214 % fällig am 07.10.2025 | € | 100 | 96 | 0,01 |
| 0,470 % fällig am 06.09.2029 | | 400 | 344 | 0,02 |
| 0,956 % fällig am 16.10.2024 | | 100 | 101 | 0,01 |
| 1,979 % fällig am 08.09.2031 | $ | 300 | 238 | 0,02 |
| 2,201 % fällig am 10.07.2031 | | 2.900 | 2.356 | 0,16 |
| 2,564 % fällig am 13.09.2031 | | 300 | 240 | 0,02 |
| 3,261 % fällig am 22.05.2030 | | 5.200 | 4.666 | 0,33 |
| **Nippon Life Insurance Co.** | | | | |
| 2,900 % fällig am 16.09.2051 | | 700 | 568 | 0,04 |
| **Nomura Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,172 % fällig am 14.07.2028 | | 4.100 | 3.458 | 0,24 |
| 2,329 % fällig am 22.01.2027 | | 5.400 | 4.786 | 0,34 |
| **Norinchukin Bank** | | | | |
| 1,284 % fällig am 22.09.2026 | | 2.000 | 1.779 | 0,12 |
| **NTT Finance Corp.** | | | | |
| 0,399 % fällig am 13.12.2028 | € | 1.700 | 1.544 | 0,11 |
| **ORIX Corp.** | | | | |
| 1,919 % fällig am 20.04.2026 | | 3.000 | 2.979 | 0,21 |
| **Panasonic Holdings Corp.** | | | | |
| 2,536 % fällig am 19.07.2022 | $ | 500 | 500 | 0,03 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | |
| 0,465 % fällig am 30.05.2024 | € | 400 | 405 | 0,03 |
| 1,904 % fällig am 19.07.2023 | $ | 100 | 100 | 0,01 |
| 2,472 % fällig am 14.01.2029 | | 3.900 | 3.400 | 0,24 |
| 3,102 % fällig am 17.01.2023 | | 2.100 | 2.100 | 0,15 |
| 3,202 % fällig am 17.09.2029 (d) | | 400 | 355 | 0,02 |
| **Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.** | | | | |
| 0,800 % fällig am 12.09.2023 | | 2.100 | 2.031 | 0,14 |
| 2,800 % fällig am 10.03.2027 | | 1.200 | 1.126 | 0,08 |
| | | | 46.603 | 3,27 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Development Bank of Japan, Inc.** | | | | |
| 0,010 % fällig am 15.10.2024 | € | 900 | 909 | 0,06 |
| 0,010 % fällig am 09.09.2025 | | 2.000 | 1.984 | 0,14 |
| | | | 2.893 | 0,20 |
| Summe Japan | | | 49.496 | 3,47 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 31.07.2043 | £ | 100 | $ 121 | 0,01 |
| **Aptiv PLC** | | | | |
| 3,100 % fällig am 01.12.2051 | $ | 1.800 | 1.164 | 0,08 |
| Summe Jersey, Kanalinseln | | | 1.285 | 0,09 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Acef Holding S.C.A.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 14.06.2028 | € | 1.700 | 1.430 | 0,10 |
| 1,250 % fällig am 26.04.2030 | | 4.100 | 3.230 | 0,23 |
| **CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund** | | | | |
| 0,500 % fällig am 27.01.2028 | | 600 | 519 | 0,04 |
| 0,900 % fällig am 12.10.2029 | | 3.700 | 3.065 | 0,22 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 27.01.2031 | | 500 | 348 | 0,02 |
| 1,625 % fällig am 23.04.2027 | | 900 | 753 | 0,05 |
| 1,750 % fällig am 14.01.2030 | | 4.500 | 3.335 | 0,23 |
| 2,750 % fällig am 12.05.2026 | | 200 | 186 | 0,01 |
| 2,750 % fällig am 22.01.2028 | £ | 350 | 329 | 0,02 |
| 4,875 % fällig am 18.08.2026 (c) | € | 100 | 61 | 0,00 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 2,000 % fällig am 17.01.2034 | | 4.100 | 3.025 | 0,21 |
| **NE Property BV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 20.01.2030 | | 5.400 | 4.017 | 0,28 |
| 3,375 % fällig am 14.07.2027 | | 600 | 541 | 0,04 |
| **Prologis International Funding S.A.** | | | | |
| 0,875 % fällig am 09.07.2029 | | 300 | 262 | 0,02 |
| 1,750 % fällig am 15.03.2028 | | 300 | 288 | 0,02 |
| 2,750 % fällig am 22.02.2032 | £ | 600 | 646 | 0,05 |
| **Segro Capital SARL** | | | | |
| 1,875 % fällig am 23.03.2030 | € | 550 | 504 | 0,04 |
| **SELP Finance SARL** | | | | |
| 0,875 % fällig am 27.05.2029 | | 2.200 | 1.850 | 0,13 |
| **SIG Combibloc Purchase Co. SARL** | | | | |
| 1,875 % fällig am 18.06.2023 | | 300 | 310 | 0,02 |
| | | | 24.699 | 1,73 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Großherzogtum Luxemburg** | | | | |
| 0,000 % fällig am 14.09.2032 (b) | | 2.000 | 1.693 | 0,12 |
| Summe Luxemburg | | | 26.392 | 1,85 |
| **MAURITIUS** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Azure Power Energy Ltd.** | | | | |
| 3,575 % fällig am 19.08.2026 | $ | 2.602 | 2.157 | 0,15 |
| **Azure Power Solar Energy Pvt Ltd.** | | | | |
| 5,650 % fällig am 24.12.2024 | | 200 | 190 | 0,01 |
| **Greenko Dutch BV** | | | | |
| 3,850 % fällig am 29.03.2026 | | 1.843 | 1.568 | 0,11 |
| **Greenko Power Ltd.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 13.12.2028 | | 2.933 | 2.349 | 0,16 |
| **Greenko Solar Mauritius Ltd.** | | | | |
| 5,550 % fällig am 29.01.2025 | | 900 | 846 | 0,06 |
| 5,950 % fällig am 29.07.2026 | | 200 | 179 | 0,01 |
| **India Green Energy Holdings** | | | | |
| 5,375 % fällig am 29.04.2024 | | 1.450 | 1.357 | 0,10 |
| **India Green Power Holdings** | | | | |
| 4,000 % fällig am 22.02.2027 | | 1.200 | 940 | 0,07 |
| Summe Mauritius | | | 9.586 | 0,67 |
| **MEXIKO** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Mercantil del Norte S.A.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 24.01.2032 (c)(d) | | 1.800 | 1.473 | 0,10 |
| **Cibanco S.A. Ibm** | | | | |
| 4,962 % fällig am 18.07.2029 | | 700 | 627 | 0,05 |
| **Coca-Cola Femsa S.A.B. de C.V.** | | | | |
| 1,850 % fällig am 01.09.2032 | | 1.300 | 1.012 | 0,07 |
| **Metalsa S.A. de C.V.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 04.05.2031 | | 2.900 | 2.053 | 0,15 |
| **Nemak S.A.B. de C.V.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 20.07.2028 | € | 1.400 | $ 1.053 | 0,07 |
| Summe Mexiko | | | 6.218 | 0,44 |
| **MULTINATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.09.2029 | | 350 | 274 | 0,02 |
| **NXP BV** | | | | |
| 2,500 % fällig am 11.05.2031 | $ | 2.660 | 2.189 | 0,15 |
| 3,400 % fällig am 01.05.2030 | | 900 | 795 | 0,06 |
| 5,000 % fällig am 15.01.2033 | | 6.500 | 6.352 | 0,44 |
| Summe multinational | | | 9.610 | 0,67 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | |
| 2,470 % fällig am 13.12.2029 | | 6.800 | 5.802 | 0,41 |
| **Akzo Nobel NV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 28.03.2032 | € | 750 | 680 | 0,05 |
| **Atrium Finance Issuer BV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.09.2027 | | 1.500 | 1.269 | 0,09 |
| **BMW Finance NV** | | | | |
| 0,500 % fällig am 22.11.2022 | | 175 | 183 | 0,01 |
| **Citycon Treasury BV** | | | | |
| 1,625 % fällig am 12.03.2028 | | 500 | 385 | 0,03 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 1,004 % fällig am 24.09.2026 | $ | 4.500 | 4.015 | 0,28 |
| 1,106 % fällig am 24.02.2027 | | 800 | 707 | 0,05 |
| 3,100 % fällig am 29.06.2028 (c)(d) | € | 1.000 | 788 | 0,06 |
| 3,758 % fällig am 06.04.2033 | $ | 3.850 | 3.478 | 0,24 |
| 4,375 % fällig am 29.06.2027 (c)(d) | € | 1.000 | 922 | 0,06 |
| 4,625 % fällig am 29.12.2025 (c)(d) | | 200 | 193 | 0,01 |
| 4,875 % fällig am 29.06.2029 (c)(d) | | 2.800 | 2.462 | 0,17 |
| 5,250 % fällig am 14.09.2027 | £ | 800 | 980 | 0,07 |
| **CTP NV** | | | | |
| 0,500 % fällig am 21.06.2025 | € | 4.200 | 3.746 | 0,26 |
| 0,625 % fällig am 27.09.2026 | | 300 | 251 | 0,02 |
| 0,875 % fällig am 20.01.2026 | | 2.700 | 2.364 | 0,17 |
| 1,250 % fällig am 21.06.2029 | | 400 | 292 | 0,02 |
| 1,500 % fällig am 27.09.2031 | | 2.500 | 1.585 | 0,11 |
| **Digital Dutch Finco BV** | | | | |
| 1,000 % fällig am 15.01.2032 | | 350 | 261 | 0,02 |
| **Digital Intrepid Holding BV** | | | | |
| 0,625 % fällig am 15.07.2031 | | 600 | 444 | 0,03 |
| **Enel Finance International NV** | | | | |
| 0,000 % fällig am 28.05.2026 (b) | | 1.000 | 939 | 0,07 |
| 0,375 % fällig am 28.05.2029 | | 2.000 | 1.713 | 0,12 |
| 0,875 % fällig am 17.01.2031 | | 1.100 | 916 | 0,06 |
| 1,875 % fällig am 12.07.2028 | $ | 1.700 | 1.427 | 0,10 |
| 2,250 % fällig am 12.07.2031 | | 2.300 | 1.808 | 0,13 |
| 2,875 % fällig am 11.04.2029 | £ | 3.100 | 3.465 | 0,24 |
| 4,625 % fällig am 15.06.2027 | $ | 5.400 | 5.317 | 0,37 |
| **Holcim Sterling Finance Netherlands BV** | | | | |
| 2,250 % fällig am 04.04.2034 | £ | 1.800 | 1.688 | 0,12 |
| **Iberdrola International BV** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.09.2033 | $ | 1.200 | 1.365 | 0,10 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 1,400 % fällig am 01.07.2026 | | 2.800 | 2.546 | 0,18 |
| 1,726 % fällig am 01.04.2027 | | 1.900 | 1.700 | 0,12 |
| 2,125 % fällig am 23.05.2026 | € | 2.700 | 2.750 | 0,19 |
| 3,869 % fällig am 28.03.2026 | $ | 2.900 | 2.846 | 0,20 |
| 3,875 % fällig am 16.05.2027 (c)(d) | | 200 | 146 | 0,01 |
| 4,017 % fällig am 28.03.2028 | | 3.400 | 3.241 | 0,23 |
| 4,250 % fällig am 16.05.2031 (c)(d) | | 1.000 | 684 | 0,05 |
| 4,875 % fällig am 16.05.2029 (c)(d) | | 600 | 492 | 0,03 |
| 5,750 % fällig am 16.11.2026 (c)(d) | | 550 | 504 | 0,04 |
| 6,500 % fällig am 16.04.2025 (c)(d) | | 300 | 283 | 0,02 |
| **JAB Holdings BV** | | | | |
| 4,500 % fällig am 08.04.2052 | | 4.100 | 3.172 | 0,22 |
| **JDE Peet's NV** | | | | |
| 0,625 % fällig am 09.02.2028 | € | 1.300 | 1.148 | 0,08 |
| 1,125 % fällig am 16.06.2033 | | 300 | 223 | 0,02 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 0,250 % fällig am 07.09.2026 | | 3.500 | 3.206 | 0,22 |
| 0,750 % fällig am 03.10.2022 | | 4.100 | 4.291 | 0,30 |
| 1,375 % fällig am 07.03.2024 | | 800 | 822 | 0,06 |
| **Mondelez International Holdings Netherlands BV** | | | | |
| 0,250 % fällig am 09.09.2029 | € | 2.000 | $ 1.702 | 0,12 |
| **Nationale-Nederlanden Bank NV** | | | | |
| 0,500 % fällig am 21.09.2028 | | 2.800 | 2.449 | 0,17 |
| **Prosus NV** | | | | |
| 2,085 % fällig am 19.01.2030 | | 1.300 | 1.041 | 0,07 |
| 2,778 % fällig am 19.01.2034 | | 200 | 146 | 0,01 |
| 3,257 % fällig am 19.01.2027 | $ | 2.200 | 1.914 | 0,13 |
| **SGS Nederland Holding BV** | | | | |
| 0,125 % fällig am 21.04.2027 | € | 1.900 | 1.751 | 0,12 |
| **Stedin Holding NV** | | | | |
| 0,500 % fällig am 14.11.2029 | | 100 | 86 | 0,01 |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | |
| 6,500 % (c) | | 200 | 203 | 0,01 |
| **Telefonica Europe BV** | | | | |
| 2,880 % fällig am 24.02.2028 (c) | | 1.500 | 1.211 | 0,09 |
| **Thermo Fisher Scientific Finance BV** | | | | |
| 0,000 % fällig am 18.11.2025 (b) | | 1.000 | 971 | 0,07 |
| 2,000 % fällig am 18.10.2051 | | 1.700 | 1.237 | 0,09 |
| **Vestas Wind Systems Finance BV** | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.06.2029 | | 3.000 | 2.851 | 0,20 |
| **Vesteda Finance BV** | | | | |
| 0,750 % fällig am 18.10.2031 | | 3.700 | 2.967 | 0,21 |
| **Vonovia Finance BV** | | | | |
| 1,125 % fällig am 08.09.2025 | | 200 | 196 | 0,01 |
| **Wabtec Transportation Netherlands BV** | | | | |
| 1,250 % fällig am 03.12.2027 | | 1.700 | 1.456 | 0,10 |
| **WPC Eurobond BV** | | | | |
| 1,350 % fällig am 15.04.2028 | | 200 | 175 | 0,01 |
| **ZF Europe Finance BV** | | | | |
| 3,000 % fällig am 23.10.2029 | | 100 | 77 | 0,01 |
| | | | 97.932 | 6,87 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Green Storm BV** | | | | |
| 0,402 % fällig am 22.02.2068 | | 200 | 211 | 0,01 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **BNG Bank NV** | | | | |
| 0,050 % fällig am 20.11.2029 | | 100 | 91 | 0,01 |
| 0,500 % fällig am 26.11.2025 | | 500 | 507 | 0,04 |
| **Nederlandse Waterschapsbank NV** | | | | |
| 0,125 % fällig am 03.09.2035 | | 1.900 | 1.486 | 0,10 |
| 1,500 % fällig am 15.06.2039 | | 200 | 182 | 0,01 |
| | | | 2.266 | 0,16 |
| Summe Niederlande | | | 100.409 | 7,04 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **DNB Bank ASA** | | | | |
| 0,375 % fällig am 18.01.2028 | | 2.400 | 2.263 | 0,16 |
| **PERU** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 1,950 % fällig am 17.11.2036 | | 2.000 | 1.439 | 0,10 |
| **RUMÄNIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Romania Government International Bond** | | | | |
| 1,750 % fällig am 13.07.2030 | | 2.100 | 1.569 | 0,11 |
| 2,125 % fällig am 07.03.2028 | | 900 | 777 | 0,06 |
| 2,625 % fällig am 02.12.2040 | | 2.900 | 1.767 | 0,12 |
| 3,750 % fällig am 07.02.2034 | | 900 | 707 | 0,05 |
| Summe Rumänien | | | 4.820 | 0,34 |
| **SERBIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Serbia Government International Bond** | | | | |
| 1,000 % fällig am 23.09.2028 | | 2.000 | 1.528 | 0,11 |
| 1,650 % fällig am 03.03.2033 | | 400 | 263 | 0,02 |
| Summe Serbien | | | 1.791 | 0,13 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 25.03.2027 | $ | 1.274 | $ 1.016 | 0,07 |
| **Continuum Energy Levanter Pte. Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 09.02.2027 | | 690 | 546 | 0,04 |
| **United Overseas Bank Ltd.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 16.03.2031 (d) | | 300 | 272 | 0,02 |
| 3,863 % fällig am 07.10.2032 (d) | | 4.000 | 3.830 | 0,27 |
| Summe Singapur | | | 5.664 | 0,40 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Growthpoint Properties International Pty. Ltd.** | | | | |
| 5,872 % fällig am 02.05.2023 | | 300 | 300 | 0,02 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 5,875 % fällig am 20.04.2032 | | 1.200 | 1.027 | 0,07 |
| Summe Südafrika | | | 1.327 | 0,09 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Hanwha Life Insurance Co. Ltd.** | | | | |
| 3,379 % fällig am 04.02.2032 | | 3.000 | 2.740 | 0,19 |
| **KB Kookmin Card Co. Ltd.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 13.05.2026 | | 2.600 | 2.338 | 0,16 |
| 4,000 % fällig am 09.06.2025 | | 1.900 | 1.883 | 0,13 |
| **Kookmin Bank** | | | | |
| 1,375 % fällig am 06.05.2026 | | 2.000 | 1.830 | 0,13 |
| 2,500 % fällig am 04.11.2030 (d) | | 900 | 760 | 0,05 |
| **NongHyup Bank** | | | | |
| 1,250 % fällig am 20.07.2025 | | 400 | 370 | 0,03 |
| **Shinhan Bank Co. Ltd.** | | | | |
| 1,183 % fällig am 29.09.2025 | AUD | 800 | 495 | 0,04 |
| 4,000 % fällig am 23.04.2029 (d) | $ | 600 | 575 | 0,04 |
| 4,375 % fällig am 13.04.2032 (d) | | 2.200 | 2.124 | 0,15 |
| **Shinhan Card Co. Ltd.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 23.06.2026 | | 1.000 | 893 | 0,06 |
| **SK Hynix, Inc.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 19.01.2031 | | 1.000 | 789 | 0,06 |
| | | | 14.797 | 1,04 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Export-Import Bank of Korea** | | | | |
| 2,125 % fällig am 18.01.2032 | | 2.000 | 1.719 | 0,12 |
| **Korea Expressway Corp.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 17.05.2026 | | 1.000 | 906 | 0,06 |
| **Korea Housing Finance Corp.** | | | | |
| 0,010 % fällig am 05.02.2025 | € | 400 | 401 | 0,03 |
| **Korea Water Resources Corp.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 27.04.2025 | $ | 3.500 | 3.478 | 0,24 |
| | | | 6.504 | 0,45 |
| Summe Südkorea | | | 21.301 | 1,49 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 04.06.2025 | € | 200 | 200 | 0,01 |
| **Banco de Sabadell S.A.** | | | | |
| 0,875 % fällig am 16.06.2028 | | 3.400 | 2.917 | 0,20 |
| 1,125 % fällig am 11.03.2027 | | 400 | 383 | 0,03 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 0,625 % fällig am 24.06.2029 | | 2.800 | 2.458 | 0,17 |
| 1,125 % fällig am 23.06.2027 | | 200 | 188 | 0,01 |
| 3,490 % fällig am 28.05.2030 | $ | 400 | 354 | 0,03 |
| 3,625 % fällig am 21.03.2029 (c)(d) | € | 600 | 436 | 0,03 |
| 4,125 % fällig am 12.11.2027 (c)(d) | | 1.000 | 787 | 0,06 |
| 4,175 % fällig am 24.03.2028 | $ | 2.000 | 1.910 | 0,13 |
| 4,375 % fällig am 14.01.2026 (c)(d) | € | 400 | 353 | 0,03 |
| **Bankinter S.A.** | | | | |
| 0,625 % fällig am 06.10.2027 | | 1.000 | 892 | 0,06 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 09.02.2029 | | 400 | 346 | 0,02 |
| 0,625 % fällig am 21.01.2028 | € | 3.000 | $ 2.807 | 0,20 |
| 0,750 % fällig am 26.05.2028 | | 1.400 | 1.263 | 0,09 |
| 1,500 % fällig am 03.12.2026 | £ | 700 | 766 | 0,05 |
| 5,875 % fällig am 09.10.2027 (c)(d) | € | 800 | 738 | 0,05 |
| **Cellnex Finance Co. S.A.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 07.07.2041 | $ | 1.000 | 688 | 0,05 |
| **Kutxabank S.A.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 14.10.2027 | € | 3.200 | 2.951 | 0,21 |
| | | | 20.437 | 1,43 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Adif Alta Velocidad** | | | | |
| 0,550 % fällig am 30.04.2030 | | 200 | 184 | 0,01 |
| 0,550 % fällig am 31.10.2031 | | 2.600 | 2.279 | 0,16 |
| **Autonomous Community of Madrid** | | | | |
| 0,419 % fällig am 30.04.2030 | | 100 | 91 | 0,01 |
| 0,827 % fällig am 30.07.2027 | | 500 | 497 | 0,03 |
| 1,571 % fällig am 30.04.2029 | | 100 | 101 | 0,01 |
| 1,723 % fällig am 30.04.2032 | | 6.000 | 5.799 | 0,41 |
| **Spain Government International Bond** | | | | |
| 1,000 % fällig am 30.07.2042 | | 6.340 | 4.730 | 0,33 |
| **Xunta de Galicia** | | | | |
| 0,084 % fällig am 30.07.2027 | | 150 | 143 | 0,01 |
| | | | 13.824 | 0,97 |
| Summe Spanien | | | 34.261 | 2,40 |
| **SUPRANATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Asian Development Bank** | | | | |
| 1,500 % fällig am 04.05.2028 | CAD | 2.000 | 1.383 | 0,10 |
| 6,550 % fällig am 26.01.2025 | ZAR | 64.000 | 3.794 | 0,27 |
| **Banque Ouest Africaine de Developpement** | | | | |
| 2,750 % fällig am 22.01.2033 | € | 800 | 672 | 0,05 |
| **Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial** | | | | |
| 0,000 % fällig am 28.07.2026 (b) | | 1.000 | 977 | 0,07 |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.07.2027 | AUD | 2.100 | 1.223 | 0,08 |
| 1,500 % fällig am 15.06.2032 | € | 3.000 | 2.967 | 0,21 |
| **Europäische Union** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.10.2030 (b) | | 800 | 715 | 0,05 |
| 0,000 % fällig am 04.07.2035 (b) | | 700 | 544 | 0,04 |
| 0,300 % fällig am 04.11.2050 | | 1.900 | 1.142 | 0,08 |
| 0,400 % fällig am 04.02.2037 | | 2.150 | 1.723 | 0,12 |
| 1,250 % fällig am 04.02.2043 | | 8.000 | 6.781 | 0,47 |
| 2,625 % fällig am 04.02.2048 | | 1.300 | 1.423 | 0,10 |
| Summe Supranational | | | 23.344 | 1,64 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **EQT AB** | | | | |
| 0,875 % fällig am 14.05.2031 | | 4.400 | 3.364 | 0,24 |
| 2,375 % fällig am 06.04.2028 | | 3.000 | 2.864 | 0,20 |
| 2,875 % fällig am 06.04.2032 | | 3.000 | 2.650 | 0,19 |
| **Svenska Handelsbanken AB** | | | | |
| 4,375 % fällig am 01.03.2027 (c)(d) | $ | 400 | 342 | 0,02 |
| 4,750 % fällig am 01.03.2031 (c)(d) | | 1.200 | 987 | 0,07 |
| | | | 10.207 | 0,72 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Sweden Government International Bond** | | | | |
| 0,125 % fällig am 09.09.2030 | SEK | 9.000 | 771 | 0,05 |
| Summe Schweden | | | 10.978 | 0,77 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **UBS AG** | | | | |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (d) | $ | 5.800 | 5.817 | 0,41 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 2,746 % fällig am 11.02.2033 | | 1.000 | 815 | 0,05 |
| 2,859 % fällig am 15.08.2023 | | 1.000 | 1.000 | 0,07 |
| 4,125 % fällig am 24.09.2025 | | 4.300 | 4.272 | 0,30 |
| 4,375 % fällig am 10.02.2031 (c)(d) | | 1.200 | 881 | 0,06 |
| 4,875 % fällig am 12.02.2027 (c)(d) | | 1.000 | 839 | 0,06 |
| 5,125 % fällig am 29.07.2026 (c)(d) | | 300 | 270 | 0,02 |
| Summe Schweiz | | | 13.894 | 0,97 |
| **THAILAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bangkok Bank PCL** | | | | |
| 3,466 % fällig am 23.09.2036 (d) | $ | 800 | $ 670 | 0,05 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Anglian Water Services Financing PLC** | | | | |
| 2,750 % fällig am 26.10.2029 | £ | 100 | 117 | 0,01 |
| **Assura Financing PLC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.06.2033 | | 1.200 | 1.130 | 0,08 |
| **AstraZeneca PLC** | | | | |
| 1,375 % fällig am 06.08.2030 | $ | 500 | 411 | 0,03 |
| **Atlantica Sustainable Infrastructure PLC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.06.2028 | | 1.400 | 1.222 | 0,09 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 2,667 % fällig am 10.03.2032 | | 1.000 | 807 | 0,06 |
| 2,894 % fällig am 24.11.2032 | | 3.000 | 2.415 | 0,17 |
| 3,250 % fällig am 12.02.2027 | £ | 900 | 1.026 | 0,07 |
| 3,250 % fällig am 17.01.2033 | | 2.000 | 2.074 | 0,15 |
| 5,200 % fällig am 12.05.2026 | $ | 800 | 798 | 0,06 |
| 6,125 % fällig am 15.12.2025 (c)(d) | | 1.000 | 930 | 0,07 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (c)(d) | £ | 1.200 | 1.437 | 0,10 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (c)(d) | $ | 2.100 | 2.069 | 0,14 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2022 (c)(d) | £ | 200 | 242 | 0,02 |
| **Berkeley Group PLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 11.08.2031 | | 3.250 | 2.913 | 0,20 |
| **British Telecommunications PLC** | | | | |
| 1,000 % fällig am 23.06.2024 | € | 283 | 290 | 0,02 |
| 3,125 % fällig am 21.11.2031 | £ | 100 | 109 | 0,01 |
| **Brookfield Finance UK PLC** | | | | |
| 2,340 % fällig am 30.01.2032 | $ | 3.000 | 2.415 | 0,17 |
| **Burberry Group PLC** | | | | |
| 1,125 % fällig am 21.09.2025 | £ | 500 | 559 | 0,04 |
| **Chanel Ceres PLC** | | | | |
| 1,000 % fällig am 31.07.2031 | € | 2.500 | 2.162 | 0,15 |
| **Clarion Funding PLC** | | | | |
| 1,250 % fällig am 13.11.2032 | £ | 700 | 678 | 0,05 |
| 1,875 % fällig am 22.01.2035 | | 200 | 194 | 0,01 |
| **CSL Finance PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 27.04.2032 | $ | 1.100 | 1.077 | 0,08 |
| **Derwent London PLC** | | | | |
| 1,875 % fällig am 17.11.2031 | £ | 2.200 | 2.173 | 0,15 |
| **Direct Line Insurance Group PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 05.06.2032 | | 300 | 315 | 0,02 |
| **Ferguson Finance PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 02.06.2030 | $ | 300 | 260 | 0,02 |
| **Grainger PLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 03.07.2030 | £ | 1.260 | 1.287 | 0,09 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 04.12.2024 | € | 100 | 103 | 0,01 |
| 1,750 % fällig am 24.07.2027 | £ | 2.700 | 2.947 | 0,21 |
| 2,013 % fällig am 22.09.2028 | $ | 900 | 771 | 0,05 |
| 2,206 % fällig am 17.08.2029 | | 1.000 | 841 | 0,06 |
| 2,804 % fällig am 24.05.2032 | | 5.600 | 4.604 | 0,32 |
| 2,871 % fällig am 22.11.2032 | | 1.300 | 1.065 | 0,07 |
| 2,999 % fällig am 10.03.2026 | | 2.900 | 2.764 | 0,19 |
| 3,000 % fällig am 22.07.2028 | £ | 100 | 113 | 0,01 |
| 3,973 % fällig am 22.05.2030 | $ | 3.700 | 3.402 | 0,24 |
| 4,041 % fällig am 13.03.2028 | | 200 | 190 | 0,01 |
| 4,600 % fällig am 17.12.2030 (c)(d) | | 800 | 617 | 0,04 |
| 5,250 % fällig am 16.09.2022 (c)(d) | € | 800 | 826 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 29.09.2023 (c)(d) | | 200 | 207 | 0,01 |
| **Informa PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 05.07.2023 | | 400 | 411 | 0,03 |
| 3,125 % fällig am 05.07.2026 | £ | 200 | 234 | 0,02 |
| **InterContinental Hotels Group PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 08.10.2028 | | 1.400 | 1.552 | 0,11 |
| **John Lewis PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 18.12.2034 | | 300 | 277 | 0,02 |
| 6,125 % fällig am 21.01.2025 | | 100 | 126 | 0,01 |
| **Legal & General Group PLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 24.03.2031 (c)(d) | | 1.800 | 1.852 | 0,13 |
| **Lendlease Europe Finance PLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 02.12.2033 | | 3.300 | 3.138 | 0,22 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 3,511 % fällig am 18.03.2026 | $ | 700 | 682 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 3,574 % fällig am 07.11.2028 | $ | 1.900 | $ 1.779 | 0,12 |
| 3,750 % fällig am 18.03.2028 | | 1.600 | 1.524 | 0,11 |
| 4,550 % fällig am 16.08.2028 | | 300 | 293 | 0,02 |
| **London & Quadrant Housing Trust** | | | | |
| 2,000 % fällig am 31.03.2032 | £ | 1.400 | 1.476 | 0,10 |
| **London Stock Exchange Group PLC** | | | | |
| 1,750 % fällig am 19.09.2029 | € | 600 | 580 | 0,04 |
| **LSEGA Financing PLC** | | | | |
| 3,200 % fällig am 06.04.2041 | $ | 1.000 | 784 | 0,05 |
| **Marks & Spencer PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 19.05.2026 | £ | 1.000 | 1.069 | 0,07 |
| 4,500 % fällig am 10.07.2027 | | 300 | 312 | 0,02 |
| **Motability Operations Group PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 20.01.2041 | | 400 | 340 | 0,02 |
| **National Grid Electricity Transmission PLC** | | | | |
| 0,190 % fällig am 20.01.2025 | € | 300 | 297 | 0,02 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 4,302 % fällig am 08.03.2029 | $ | 900 | 862 | 0,06 |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.11.2025 | € | 350 | 348 | 0,02 |
| 0,780 % fällig am 26.02.2030 | | 500 | 425 | 0,03 |
| 1,642 % fällig am 14.06.2027 | $ | 900 | 791 | 0,06 |
| 2,057 % fällig am 09.11.2028 | £ | 1.900 | 2.020 | 0,14 |
| 3,875 % fällig am 12.09.2023 | $ | 300 | 299 | 0,02 |
| 4,269 % fällig am 22.03.2025 | | 1.500 | 1.486 | 0,10 |
| 5,125 % fällig am 12.05.2027 (c)(d) | £ | 400 | 412 | 0,03 |
| **Peabody Capital PLC** | | | | |
| 2,750 % fällig am 02.03.2034 | | 500 | 543 | 0,04 |
| **Pearson Funding PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 04.06.2030 | | 500 | 577 | 0,04 |
| **Places for People Treasury PLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 26.01.2036 | | 2.200 | 2.211 | 0,15 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 1,673 % fällig am 14.06.2027 | $ | 1.600 | 1.399 | 0,10 |
| 3,373 % fällig am 05.01.2024 | | 1.400 | 1.394 | 0,10 |
| 3,823 % fällig am 03.11.2028 | | 2.100 | 1.951 | 0,14 |
| 4,750 % fällig am 15.09.2025 | | 600 | 593 | 0,04 |
| 6,750 % fällig am 24.06.2024 (c)(d) | £ | 400 | 469 | 0,03 |
| **Severn Trent Utilities Finance PLC** | | | | |
| 2,000 % fällig am 02.06.2040 | | 300 | 266 | 0,02 |
| 2,625 % fällig am 22.02.2033 | | 1.800 | 1.952 | 0,14 |
| **SSE PLC** | | | | |
| 1,750 % fällig am 16.04.2030 | € | 100 | 92 | 0,01 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 0,800 % fällig am 17.11.2029 | | 3.100 | 2.671 | 0,19 |
| 0,991 % fällig am 12.01.2025 | $ | 700 | 662 | 0,05 |
| 1,456 % fällig am 14.01.2027 | | 3.618 | 3.195 | 0,22 |
| 2,678 % fällig am 29.06.2032 | | 500 | 402 | 0,03 |
| 7,750 % fällig am 02.04.2023 (c)(d) | | 600 | 593 | 0,04 |
| **Tesco Corporate Treasury Services PLC** | | | | |
| 0,375 % fällig am 27.07.2029 | € | 700 | 567 | 0,04 |
| 1,875 % fällig am 02.11.2028 | £ | 3.800 | 3.930 | 0,28 |
| 2,750 % fällig am 27.04.2030 | | 500 | 531 | 0,04 |
| **Thames Water Utilities Finance PLC** | | | | |
| 0,875 % fällig am 31.01.2028 | € | 3.000 | 2.734 | 0,19 |
| **Travis Perkins PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 17.02.2026 (f) | £ | 1.000 | 1.059 | 0,07 |
| **Vmed O2 UK Financing PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 31.01.2031 | € | 900 | 728 | 0,05 |
| 4,500 % fällig am 15.07.2031 | £ | 1.000 | 963 | 0,07 |
| 4,750 % fällig am 15.07.2031 | $ | 4.900 | 3.969 | 0,28 |
| **Vodafone Group PLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 04.06.2081 | | 1.559 | 1.043 | 0,07 |
| **Weir Group PLC** | | | | |
| 2,200 % fällig am 13.05.2026 | | 9.700 | 8.540 | 0,60 |
| **Workspace Group PLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 11.03.2028 | £ | 1.600 | 1.600 | 0,11 |
| **Yorkshire Building Society** | | | | |
| 3,511 % fällig am 11.10.2030 | | 2.400 | 2.681 | 0,19 |
| **Zenith Finco PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 30.06.2027 | | 2.300 | 2.259 | 0,16 |
| | | | 120.503 | 8,45 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Gemgarto PLC** | | | | |
| 1,355 % fällig am 16.12.2067 | | 697 | 838 | 0,06 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 0,875 % fällig am 31.07.2033 | £ | 6.350 | $ 6.593 | 0,46 |
| Summe Großbritannien | | | 127.934 | 8,97 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust** | | | | |
| 2,100 % fällig am 20.05.2048 | $ | 3.094 | 2.673 | 0,19 |
| 4,000 % fällig am 20.04.2049 | | 5.682 | 5.387 | 0,38 |
| | | | 8.060 | 0,57 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AbbVie, Inc.** | | | | |
| 3,200 % fällig am 21.11.2029 | | 1.400 | 1.289 | 0,09 |
| **AES Corp.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 15.01.2026 | | 4.319 | 3.814 | 0,27 |
| 2,450 % fällig am 15.01.2031 | | 5.600 | 4.510 | 0,32 |
| **Aetna, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.11.2022 | | 400 | 400 | 0,03 |
| **Alcon Finance Corp.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 23.09.2029 | | 1.900 | 1.688 | 0,12 |
| **Alexandria Real Estate Equities, Inc.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 18.05.2032 | | 1.650 | 1.305 | 0,09 |
| 2,950 % fällig am 15.03.2034 | | 2.700 | 2.251 | 0,16 |
| 3,000 % fällig am 18.05.2051 | | 800 | 539 | 0,04 |
| **Allegion U.S. Holding Co., Inc.** | | | | |
| 3,550 % fällig am 01.10.2027 | | 1.230 | 1.132 | 0,08 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 2,200 % fällig am 02.11.2028 | | 400 | 326 | 0,02 |
| 3,050 % fällig am 05.06.2023 | | 100 | 99 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 01.11.2031 | | 3.900 | 4.325 | 0,30 |
| **Alphabet, Inc.** | | | | |
| 1,100 % fällig am 15.08.2030 | | 800 | 657 | 0,05 |
| **American Express Co.** | | | | |
| 2,036 % fällig am 03.08.2023 | | 2.062 | 2.060 | 0,14 |
| 3,400 % fällig am 27.02.2023 | | 400 | 401 | 0,03 |
| 4,050 % fällig am 03.05.2029 | | 2.900 | 2.846 | 0,20 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028 | € | 400 | 350 | 0,02 |
| 0,950 % fällig am 05.10.2030 | | 900 | 737 | 0,05 |
| 1,000 % fällig am 15.01.2032 | | 100 | 78 | 0,01 |
| 1,450 % fällig am 15.09.2026 | $ | 1.700 | 1.488 | 0,10 |
| 1,875 % fällig am 15.10.2030 | | 5.600 | 4.362 | 0,31 |
| 1,950 % fällig am 22.05.2026 | € | 200 | 199 | 0,01 |
| 2,100 % fällig am 15.06.2030 | $ | 1.000 | 802 | 0,06 |
| 3,375 % fällig am 15.05.2024 | | 200 | 197 | 0,01 |
| 3,650 % fällig am 15.03.2027 | | 2.000 | 1.901 | 0,13 |
| 4,050 % fällig am 15.03.2032 | | 1.900 | 1.734 | 0,12 |
| 4,400 % fällig am 15.02.2026 | | 800 | 796 | 0,06 |
| **American Water Capital Corp.** | | | | |
| 4,150 % fällig am 01.06.2049 | | 1.800 | 1.600 | 0,11 |
| **Amgen, Inc.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 15.01.2032 | | 1.000 | 815 | 0,06 |
| 2,300 % fällig am 25.02.2031 | | 1.100 | 936 | 0,07 |
| 3,000 % fällig am 22.02.2029 | | 4.600 | 4.247 | 0,30 |
| **Apple, Inc.** | | | | |
| 1,400 % fällig am 05.08.2028 | | 7.100 | 6.218 | 0,44 |
| 2,200 % fällig am 11.09.2029 | | 1.961 | 1.768 | 0,12 |
| 2,450 % fällig am 04.08.2026 | | 1.400 | 1.342 | 0,09 |
| **Arizona Public Service Co.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 15.09.2050 | | 1.300 | 835 | 0,06 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 3,650 % fällig am 15.09.2059 | | 2.509 | 1.885 | 0,13 |
| 4,850 % fällig am 25.05.2047 (e) | CAD | 1.500 | 1.003 | 0,07 |
| 5,100 % fällig am 25.11.2048 | | 300 | 207 | 0,01 |
| **Autodesk, Inc.** | | | | |
| 2,400 % fällig am 15.12.2031 | $ | 2.900 | 2.370 | 0,17 |
| **AvalonBay Communities, Inc.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 01.12.2028 | | 3.900 | 3.395 | 0,24 |
| 2,050 % fällig am 15.01.2032 | | 425 | 351 | 0,02 |
| **Avangrid, Inc.** | | | | |
| 3,200 % fällig am 15.04.2025 | | 3.000 | 2.920 | 0,20 |
| 3,800 % fällig am 01.06.2029 | | 1.500 | 1.405 | 0,10 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,652 % fällig am 24.08.2025 | € | 600 | 622 | 0,04 |
| 1,102 % fällig am 24.05.2032 | | 300 | 254 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 1,734 % fällig am 22.07.2027 | $ | 300 | $ 267 | 0,02 |
| 2,087 % fällig am 14.06.2029 | | 2.400 | 2.058 | 0,14 |
| 2,299 % fällig am 21.07.2032 | | 600 | 485 | 0,03 |
| 2,456 % fällig am 22.10.2025 | | 1.700 | 1.621 | 0,11 |
| 2,572 % fällig am 20.10.2032 | | 2.000 | 1.652 | 0,12 |
| 2,687 % fällig am 22.04.2032 | | 6.600 | 5.547 | 0,39 |
| 2,824 % fällig am 27.04.2033 | € | 700 | 679 | 0,05 |
| 2,972 % fällig am 04.02.2033 | $ | 3.000 | 2.559 | 0,18 |
| 3,384 % fällig am 02.04.2026 | | 11.900 | 11.550 | 0,81 |
| 3,559 % fällig am 23.04.2027 | | 2.600 | 2.494 | 0,17 |
| **Baxter International, Inc.** | | | | |
| 2,272 % fällig am 01.12.2028 | | 7.000 | 6.136 | 0,43 |
| **BlueHub Loan Fund, Inc.** | | | | |
| 3,099 % fällig am 01.01.2030 | | 650 | 591 | 0,04 |
| **BMW U.S. Capital LLC** | | | | |
| 1,950 % fällig am 12.08.2031 | | 2.000 | 1.635 | 0,11 |
| **Boise Cascade Co.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.07.2030 | | 260 | 228 | 0,02 |
| **Boston Properties LP** | | | | |
| 2,550 % fällig am 01.04.2032 | | 2.430 | 1.937 | 0,14 |
| **Brandywine Operating Partnership LP** | | | | |
| 4,550 % fällig am 01.10.2029 | | 100 | 96 | 0,01 |
| **Bush Foundation** | | | | |
| 2,754 % fällig am 01.10.2050 | | 375 | 281 | 0,02 |
| **Campbell Soup Co.** | | | | |
| 4,150 % fällig am 15.03.2028 | | 1.150 | 1.130 | 0,08 |
| **CBRE Services, Inc.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.04.2031 | | 1.000 | 815 | 0,06 |
| **Charles Schwab Corp.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.12.2030 (c) | | 1.400 | 1.079 | 0,08 |
| **Chubb INA Holdings, Inc.** | | | | |
| 0,875 % fällig am 15.06.2027 | € | 200 | 191 | 0,01 |
| **Cigna Corp.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.07.2023 | $ | 163 | 163 | 0,01 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 1,281 % fällig am 03.11.2025 | | 400 | 372 | 0,03 |
| 1,669 % fällig am 25.01.2026 (e) | | 2.000 | 1.933 | 0,14 |
| 2,520 % fällig am 03.11.2032 | | 800 | 650 | 0,05 |
| 2,572 % fällig am 03.06.2031 (e) | | 13.100 | 11.023 | 0,77 |
| **Citrix Systems, Inc.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 01.03.2026 | | 900 | 872 | 0,06 |
| **Clearway Energy Operating LLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.02.2031 | | 1.420 | 1.149 | 0,08 |
| 3,750 % fällig am 15.01.2032 | | 1.400 | 1.112 | 0,08 |
| 4,750 % fällig am 15.03.2028 | | 400 | 361 | 0,03 |
| **Community Preservation Corp.** | | | | |
| 2,867 % fällig am 01.02.2030 | | 1.225 | 1.092 | 0,08 |
| **Conagra Brands, Inc.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 01.11.2027 | | 600 | 501 | 0,03 |
| **Consolidated Edison Co. of New York, Inc.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 15.06.2061 | | 3.500 | 2.767 | 0,19 |
| **Continental Wind LLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 28.02.2033 | | 352 | 374 | 0,03 |
| **Corebridge Financial, Inc.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 05.04.2032 | | 8.200 | 7.365 | 0,52 |
| 4,350 % fällig am 05.04.2042 | | 200 | 171 | 0,01 |
| **Corporate Office Properties LP** | | | | |
| 2,000 % fällig am 15.01.2029 | | 700 | 565 | 0,04 |
| 2,250 % fällig am 15.03.2026 | | 500 | 454 | 0,03 |
| **Crown Castle International Corp.** | | | | |
| 1,350 % fällig am 15.07.2025 | | 200 | 183 | 0,01 |
| 2,500 % fällig am 15.07.2031 | | 1.000 | 819 | 0,06 |
| 3,250 % fällig am 15.01.2051 | | 600 | 432 | 0,03 |
| 4,300 % fällig am 15.02.2029 | | 4.800 | 4.614 | 0,32 |
| 5,200 % fällig am 15.02.2049 | | 100 | 96 | 0,01 |
| **CVS Health Corp.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 21.08.2030 | | 200 | 160 | 0,01 |
| 2,750 % fällig am 01.12.2022 | | 1.500 | 1.500 | 0,10 |
| 4,300 % fällig am 25.03.2028 | | 192 | 190 | 0,01 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.12.2041 | | 1.470 | 1.053 | 0,07 |
| 3,450 % fällig am 15.12.2051 | | 1.000 | 679 | 0,05 |
| 5,300 % fällig am 01.10.2029 | | 2.000 | 1.974 | 0,14 |
| 6,200 % fällig am 15.07.2030 | | 800 | 833 | 0,06 |
| **Digital Stout Holding LLC** | | | | |
| 3,300 % fällig am 19.07.2029 | £ | 100 | 111 | 0,01 |
| 3,750 % fällig am 17.10.2030 | | 400 | 449 | 0,03 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Dominion Energy, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.08.2031 | $ | 3.847 | $ 3.167 | 0,22 |
| **Doris Duke Charitable Foundation** | | | | |
| 2,345 % fällig am 01.07.2050 | | 400 | 271 | 0,02 |
| **DTE Electric Co.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 01.04.2051 | | 1.100 | 888 | 0,06 |
| 3,650 % fällig am 01.03.2052 | | 600 | 519 | 0,04 |
| 3,950 % fällig am 01.03.2049 | | 700 | 630 | 0,04 |
| **Duke Energy Florida LLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.12.2029 | | 300 | 267 | 0,02 |
| **Duke Energy Progress LLC** | | | | |
| 3,400 % fällig am 01.04.2032 | | 850 | 791 | 0,06 |
| **Duke Realty LP** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.01.2032 | | 3.000 | 2.502 | 0,18 |
| 2,875 % fällig am 15.11.2029 | | 100 | 90 | 0,01 |
| **Electronic Arts, Inc.** | | | | |
| 1,850 % fällig am 15.02.2031 | | 2.000 | 1.627 | 0,11 |
| **Elevance Health, Inc.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.09.2029 | | 1.812 | 1.634 | 0,11 |
| **Eli Lilly & Co.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 14.09.2033 | € | 2.000 | 1.617 | 0,11 |
| **Empower Finance LP** | | | | |
| 1,776 % fällig am 17.03.2031 | $ | 3.400 | 2.731 | 0,19 |
| **Equinix, Inc.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 15.03.2033 | € | 400 | 309 | 0,02 |
| 1,550 % fällig am 15.03.2028 | $ | 6.700 | 5.642 | 0,40 |
| 3,400 % fällig am 15.02.2052 | | 1.000 | 742 | 0,05 |
| 3,900 % fällig am 15.04.2032 | | 4.500 | 4.075 | 0,29 |
| **Equitable Financial Life Global Funding** | | | | |
| 1,300 % fällig am 12.07.2026 | | 3.550 | 3.149 | 0,22 |
| **Equitable Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,350 % fällig am 20.04.2028 | | 900 | 869 | 0,06 |
| **ERP Operating LP** | | | | |
| 1,850 % fällig am 01.08.2031 | | 700 | 575 | 0,04 |
| 4,150 % fällig am 01.12.2028 | | 100 | 98 | 0,01 |
| **Eversource Energy** | | | | |
| 1,650 % fällig am 15.08.2030 | | 800 | 638 | 0,04 |
| **F&G Global Funding** | | | | |
| 2,300 % fällig am 11.04.2027 | | 2.000 | 1.787 | 0,13 |
| **FactSet Research Systems, Inc.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 01.03.2032 | | 4.100 | 3.599 | 0,25 |
| **Farmers Exchange Capital** | | | | |
| 5,454 % fällig am 15.10.2054 | | 400 | 396 | 0,03 |
| **First American Financial Corp.** | | | | |
| 2,400 % fällig am 15.08.2031 | | 3.600 | 2.780 | 0,19 |
| 4,000 % fällig am 15.05.2030 | | 700 | 630 | 0,04 |
| **Fiserv, Inc.** | | | | |
| 0,375 % fällig am 01.07.2023 | € | 2.150 | 2.219 | 0,16 |
| 2,650 % fällig am 01.06.2030 | $ | 4.500 | 3.816 | 0,27 |
| 3,000 % fällig am 01.07.2031 | £ | 100 | 109 | 0,01 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 0,346 % fällig am 01.12.2024 | € | 200 | 195 | 0,01 |
| 1,514 % fällig am 17.02.2023 | | 400 | 412 | 0,03 |
| 1,744 % fällig am 19.07.2024 | | 900 | 871 | 0,06 |
| 2,300 % fällig am 10.02.2025 | $ | 1.000 | 900 | 0,06 |
| 2,900 % fällig am 10.02.2029 | | 700 | 550 | 0,04 |
| 3,021 % fällig am 06.03.2024 | € | 300 | 301 | 0,02 |
| 3,375 % fällig am 13.11.2025 | $ | 1.400 | 1.265 | 0,09 |
| 4,000 % fällig am 13.11.2030 | | 500 | 406 | 0,03 |
| 4,535 % fällig am 06.03.2025 | £ | 400 | 456 | 0,03 |
| 4,950 % fällig am 28.05.2027 | $ | 900 | 838 | 0,06 |
| 5,584 % fällig am 18.03.2024 | | 600 | 598 | 0,04 |
| **Fresenius Medical Care U.S. Finance, Inc.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 16.02.2031 | | 600 | 475 | 0,03 |
| **FS KKR Capital Corp.** | | | | |
| 1,650 % fällig am 12.10.2024 | | 700 | 623 | 0,04 |
| 3,125 % fällig am 12.10.2028 | | 1.300 | 1.038 | 0,07 |
| **Gap, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.10.2029 | | 1.050 | 739 | 0,05 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 0,434 % fällig am 26.09.2023 | € | 200 | 209 | 0,01 |
| 1,000 % fällig am 16.12.2025 | £ | 200 | 224 | 0,02 |
| 1,500 % fällig am 07.12.2027 | | 800 | 845 | 0,06 |
| 1,992 % fällig am 27.01.2032 | $ | 1.000 | 791 | 0,06 |
| 2,383 % fällig am 21.07.2032 | | 900 | 729 | 0,05 |
| 2,615 % fällig am 22.04.2032 | | 6.000 | 4.988 | 0,35 |
| 2,640 % fällig am 24.02.2028 | | 4.300 | 3.906 | 0,27 |
| 2,650 % fällig am 21.10.2032 | | 900 | 743 | 0,05 |
| 3,102 % fällig am 24.02.2033 | $ | 1.100 | $ 941 | 0,07 |
| 3,250 % fällig am 01.02.2023 | € | 115 | 122 | 0,01 |
| 3,691 % fällig am 05.06.2028 | $ | 500 | 475 | 0,03 |
| **Goodman U.S. Finance Five LLC** | | | | |
| 4,625 % fällig am 04.05.2032 | | 4.600 | 4.518 | 0,32 |
| **Goodman U.S. Finance Three LLC** | | | | |
| 3,700 % fällig am 15.03.2028 | | 230 | 220 | 0,02 |
| **GSK Consumer Healthcare Capital U.S. LLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 24.03.2029 | | 7.050 | 6.602 | 0,46 |
| **Hanwha Energy USA Holdings Corp.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 30.07.2022 | | 400 | 400 | 0,03 |
| **HAT Holdings LLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.06.2026 | | 255 | 220 | 0,02 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.03.2032 | | 900 | 760 | 0,05 |
| 4,125 % fällig am 15.06.2029 | | 4.700 | 4.290 | 0,30 |
| 4,500 % fällig am 15.02.2027 | | 1.700 | 1.636 | 0,11 |
| 5,250 % fällig am 15.06.2049 | | 1.000 | 863 | 0,06 |
| **Healthpeak Properties, Inc.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 01.12.2028 | | 1.750 | 1.513 | 0,11 |
| 3,000 % fällig am 15.01.2030 | | 3.200 | 2.828 | 0,20 |
| **Host Hotels & Resorts LP** | | | | |
| 2,900 % fällig am 15.12.2031 | | 2.200 | 1.749 | 0,12 |
| 3,375 % fällig am 15.12.2029 | | 6.400 | 5.424 | 0,38 |
| 3,500 % fällig am 15.09.2030 | | 500 | 428 | 0,03 |
| **Hudson Pacific Properties LP** | | | | |
| 3,950 % fällig am 01.11.2027 | | 1.870 | 1.782 | 0,12 |
| **Humana, Inc.** | | | | |
| 1,350 % fällig am 03.02.2027 | | 2.000 | 1.750 | 0,12 |
| 3,700 % fällig am 23.03.2029 | | 4.700 | 4.454 | 0,31 |
| 3,950 % fällig am 15.03.2027 | | 95 | 93 | 0,01 |
| **Illumina, Inc.** | | | | |
| 2,550 % fällig am 23.03.2031 | | 7.650 | 6.229 | 0,44 |
| **Intercontinental Exchange, Inc.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 15.09.2040 | | 500 | 368 | 0,03 |
| 3,000 % fällig am 15.09.2060 | | 1.600 | 1.083 | 0,08 |
| **International Flavors & Fragrances, Inc.** | | | | |
| 1,832 % fällig am 15.10.2027 | | 1.600 | 1.380 | 0,10 |
| 3,468 % fällig am 01.12.2050 | | 500 | 365 | 0,03 |
| **Interstate Power & Light Co.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 01.04.2029 | | 1.200 | 1.144 | 0,08 |
| 4,100 % fällig am 26.09.2028 | | 200 | 197 | 0,01 |
| **John Deere Capital Corp.** | | | | |
| 3,350 % fällig am 18.04.2029 | | 1.900 | 1.824 | 0,13 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 1,040 % fällig am 04.02.2027 | | 1.800 | 1.595 | 0,11 |
| 1,963 % fällig am 23.03.2030 | € | 1.900 | 1.817 | 0,13 |
| 2,414 % fällig am 24.10.2023 | $ | 3.263 | 3.263 | 0,23 |
| 2,545 % fällig am 08.11.2032 | | 9.150 | 7.611 | 0,53 |
| 2,580 % fällig am 22.04.2032 | | 6.500 | 5.475 | 0,38 |
| 4,323 % fällig am 26.04.2028 | | 3.500 | 3.445 | 0,24 |
| 4,565 % fällig am 14.06.2030 | | 800 | 786 | 0,05 |
| **Kaiser Foundation Hospitals** | | | | |
| 2,810 % fällig am 01.06.2041 | | 2.850 | 2.215 | 0,16 |
| **Kellogg Co.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 20.05.2029 | € | 1.900 | 1.683 | 0,12 |
| **Keurig Dr Pepper, Inc.** | | | | |
| 4,050 % fällig am 15.04.2032 | $ | 1.400 | 1.312 | 0,09 |
| **Kilroy Realty LP** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.11.2032 | | 1.400 | 1.094 | 0,08 |
| 2,650 % fällig am 15.11.2033 | | 8.400 | 6.512 | 0,46 |
| 4,750 % fällig am 15.12.2028 | | 1.500 | 1.471 | 0,10 |
| **Kimco Realty Corp.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 01.10.2030 | | 800 | 689 | 0,05 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.07.2027 | £ | 100 | 121 | 0,01 |
| **Leeward Renewable Energy Operations LLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.07.2029 | $ | 700 | 560 | 0,04 |
| **Level 3 Financing, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.11.2029 | | 2.100 | 1.739 | 0,12 |
| **Liberty Utilities Finance GP** | | | | |
| 2,050 % fällig am 15.09.2030 | | 500 | 411 | 0,03 |
| **Low Income Investment Fund** | | | | |
| 3,711 % fällig am 01.07.2029 | | 300 | 291 | 0,02 |
| **Magallanes, Inc.** | | | | |
| 3,638 % fällig am 15.03.2025 | | 1.900 | 1.843 | 0,13 |
| 3,755 % fällig am 15.03.2027 | | 700 | 657 | 0,05 |
| 4,054 % fällig am 15.03.2029 | $ | 700$ | 642 | 0,04 |
| 4,279 % fällig am 15.03.2032 | | 2.500 | 2.237 | 0,16 |
| 5,391 % fällig am 15.03.2062 | | 500 | 419 | 0,03 |
| **Merck & Co., Inc.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 10.12.2028 | | 2.000 | 1.779 | 0,12 |
| 2,750 % fällig am 10.12.2051 | | 400 | 296 | 0,02 |
| **Micron Technology, Inc.** | | | | |
| 2,703 % fällig am 15.04.2032 | | 1.800 | 1.437 | 0,10 |
| **Microsoft Corp.** | | | | |
| 2,675 % fällig am 01.06.2060 | | 393 | 282 | 0,02 |
| **MidAmerican Energy Co.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 01.08.2052 | | 1.750 | 1.262 | 0,09 |
| 3,650 % fällig am 15.04.2029 | | 3.000 | 2.917 | 0,20 |
| **Moody's Corp.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 19.08.2031 | | 700 | 572 | 0,04 |
| 2,550 % fällig am 18.08.2060 | | 500 | 313 | 0,02 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 1,928 % fällig am 28.04.2032 | | 13.300 | 10.560 | 0,74 |
| 4,210 % fällig am 20.04.2028 | | 4.000 | 3.914 | 0,27 |
| **Morgan Stanley Domestic Holdings, Inc.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 24.08.2027 | | 200 | 191 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 20.06.2028 | | 1.500 | 1.503 | 0,11 |
| **MPT Operating Partnership LP** | | | | |
| 2,550 % fällig am 05.12.2023 | £ | 200 | 233 | 0,02 |
| **Netflix, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.11.2029 | € | 2.000 | 1.892 | 0,13 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 15.06.2028 | $ | 5.000 | 4.352 | 0,30 |
| 2,200 % fällig am 02.12.2026 | AUD | 920 | 560 | 0,04 |
| **Niagara Mohawk Power Corp.** | | | | |
| 1,960 % fällig am 27.06.2030 | $ | 400 | 331 | 0,02 |
| **Northern States Power Co.** | | | | |
| 2,600 % fällig am 01.06.2051 | | 1.300 | 918 | 0,06 |
| 2,900 % fällig am 01.03.2050 | | 1.300 | 980 | 0,07 |
| **Nucor Corp.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 23.05.2025 | | 2.400 | 2.389 | 0,17 |
| **NVR, Inc.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.05.2030 | | 2.000 | 1.725 | 0,12 |
| **OneMain Finance Corp.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.01.2027 | | 3.250 | 2.605 | 0,18 |
| **Oracle Corp.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 25.03.2051 (e) | | 300 | 221 | 0,02 |
| **Owens Corning** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.06.2030 | | 5.000 | 4.571 | 0,32 |
| 3,950 % fällig am 15.08.2029 | | 700 | 650 | 0,05 |
| **Oxford Finance LLC** | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.02.2027 | | 700 | 672 | 0,05 |
| **Pacific Life Global Funding** | | | | |
| 1,375 % fällig am 14.04.2026 | | 605 | 546 | 0,04 |
| 2,450 % fällig am 11.01.2032 | | 2.000 | 1.661 | 0,12 |
| **Penn Mutual Life Insurance Co.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 29.04.2061 | | 1.800 | 1.303 | 0,09 |
| **PepsiCo, Inc.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 29.07.2029 | | 1.400 | 1.297 | 0,09 |
| **PNC Bank N.A.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 22.10.2029 | | 600 | 523 | 0,04 |
| 3,250 % fällig am 22.01.2028 | | 1.300 | 1.240 | 0,09 |
| **PNC Financial Services Group, Inc.** | | | | |
| 2,307 % fällig am 23.04.2032 | | 1.000 | 836 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 15.05.2027 (c) | | 2.000 | 1.925 | 0,13 |
| **Principal Life Global Funding** | | | | |
| 1,250 % fällig am 16.08.2026 | | 2.750 | 2.436 | 0,17 |
| 1,375 % fällig am 10.01.2025 | | 2.000 | 1.868 | 0,13 |
| **Prologis Euro Finance LLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 08.02.2034 | € | 3.000 | 2.389 | 0,17 |
| **Prologis LP** | | | | |
| 1,250 % fällig am 15.10.2030 | $ | 3.700 | 2.928 | 0,21 |
| **Public Service Co. of Colorado** | | | | |
| 2,700 % fällig am 15.01.2051 | | 625 | 446 | 0,03 |
| 3,200 % fällig am 01.03.2050 | | 400 | 316 | 0,02 |
| 3,700 % fällig am 15.06.2028 | | 2.100 | 2.070 | 0,14 |
| **Public Service Co. of Oklahoma** | | | | |
| 3,150 % fällig am 15.08.2051 | | 2.200 | 1.619 | 0,11 |
| **Public Service Electric & Gas Co.** | | | | |
| 3,100 % fällig am 15.03.2032 | | 2.950 | 2.713 | 0,19 |
| **Qorvo, Inc.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 15.12.2024 | | 4.900 | 4.587 | 0,32 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Quanta Services, Inc.** | | | | |
| 2,900 % fällig am 01.10.2030 | $ | 3.000 | $ 2.475 | 0,17 |
| **Radian Group, Inc.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.03.2025 | | 1.220 | 1.193 | 0,08 |
| **Rayonier LP** | | | | |
| 2,750 % fällig am 17.05.2031 | | 2.500 | 2.090 | 0,15 |
| **Realty Income Corp.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 13.07.2033 | £ | 2.000 | 1.878 | 0,13 |
| **Regency Centers LP** | | | | |
| 2,950 % fällig am 15.09.2029 | $ | 1.900 | 1.672 | 0,12 |
| 3,700 % fällig am 15.06.2030 | | 1.000 | 909 | 0,06 |
| **Reliance Steel & Aluminum Co.** | | | | |
| 2,150 % fällig am 15.08.2030 | | 1.000 | 811 | 0,06 |
| **RELX Capital, Inc.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 22.05.2030 | | 600 | 540 | 0,04 |
| 4,750 % fällig am 20.05.2032 | | 200 | 203 | 0,01 |
| **Rexford Industrial Realty LP** | | | | |
| 2,150 % fällig am 01.09.2031 | | 950 | 748 | 0,05 |
| **S&P Global, Inc.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 01.03.2029 | | 5.500 | 5.009 | 0,35 |
| 4,250 % fällig am 01.05.2029 | | 200 | 198 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 01.08.2028 | | 500 | 509 | 0,04 |
| **salesforce.com, Inc.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.07.2028 | | 1.750 | 1.530 | 0,11 |
| **San Diego Gas & Electric Co.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 15.08.2051 | | 1.750 | 1.294 | 0,09 |
| **Santander Holdings USA, Inc.** | | | | |
| 2,490 % fällig am 06.01.2028 | | 1.400 | 1.237 | 0,09 |
| 3,400 % fällig am 18.01.2023 | | 500 | 499 | 0,03 |
| **SLM Corp.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 02.11.2026 | | 2.900 | 2.346 | 0,16 |
| **Solar Star Funding LLC** | | | | |
| 5,375 % fällig am 30.06.2035 | | 1.963 | 2.130 | 0,15 |
| **Southern California Edison Co.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 01.02.2045 | | 1.200 | 910 | 0,06 |
| 3,650 % fällig am 01.06.2051 | | 2.500 | 1.945 | 0,14 |
| 3,900 % fällig am 01.12.2041 | | 100 | 81 | 0,01 |
| 3,900 % fällig am 15.03.2043 | | 100 | 80 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 01.04.2047 | | 1.000 | 813 | 0,06 |
| 4,650 % fällig am 01.10.2043 | | 100 | 91 | 0,01 |
| 4,700 % fällig am 01.06.2027 | | 3.500 | 3.510 | 0,25 |
| 6,650 % fällig am 01.04.2029 | | 300 | 321 | 0,02 |
| **Southwest Airlines Co. Pass-Through Trust** | | | | |
| 6,650 % fällig am 01.08.2022 | | 6 | 6 | 0,00 |
| **Southwestern Public Service Co.** | | | | |
| 5,150 % fällig am 01.06.2052 | | 2.000 | 2.040 | 0,14 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.11.2022 | | 200 | 201 | 0,01 |
| **Sprint Corp.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.09.2023 | | 100 | 103 | 0,01 |
| **Standard Industries, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 21.11.2026 | € | 1.600 | 1.314 | 0,09 |
| **Starwood Property Trust, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.07.2026 | $ | 3.350 | 2.845 | 0,20 |
| **Sunnova Energy Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.09.2026 | | 1.970 | 1.717 | 0,12 |
| **SVB Financial Group** | | | | |
| 4,100 % fällig am 15.02.2031 (c) | | 1.200 | 831 | 0,06 |
| 4,345 % fällig am 29.04.2028 | | 1.400 | 1.366 | 0,10 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | | |
| 2,550 % fällig am 15.02.2031 | $ | 2.000 | $ 1.685 | 0,12 |
| 3,300 % fällig am 15.02.2051 | | 900 | 657 | 0,05 |
| 3,600 % fällig am 15.11.2060 | | 600 | 441 | 0,03 |
| **Thermo Fisher Scientific, Inc.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 15.10.2031 | | 2.000 | 1.679 | 0,12 |
| **Topaz Solar Farms LLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 30.09.2039 | | 1.401 | 1.274 | 0,09 |
| **Toyota Motor Credit Corp.** | | | | |
| 3,050 % fällig am 22.03.2027 | | 1.300 | 1.251 | 0,09 |
| **Travel + Leisure Co.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 01.03.2023 | | 100 | 98 | 0,01 |
| **Truist Financial Corp.** | | | | |
| 1,267 % fällig am 02.03.2027 | | 1.900 | 1.705 | 0,12 |
| **UDR, Inc.** | | | | |
| 2,100 % fällig am 01.08.2032 | | 400 | 312 | 0,02 |
| **Union Electric Co.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 01.04.2052 | | 5.700 | 5.028 | 0,35 |
| **USAA Capital Corp.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 01.05.2030 | | 1.000 | 858 | 0,06 |
| **VeriSign, Inc.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 15.06.2031 | | 1.100 | 886 | 0,06 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 18.09.2030 | | 6.060 | 4.849 | 0,34 |
| 2,100 % fällig am 22.03.2028 | | 700 | 622 | 0,04 |
| 2,550 % fällig am 21.03.2031 | | 1.300 | 1.113 | 0,08 |
| 2,850 % fällig am 03.09.2041 | | 2.550 | 1.916 | 0,13 |
| 3,400 % fällig am 22.03.2041 | | 200 | 163 | 0,01 |
| 3,700 % fällig am 22.03.2061 | | 239 | 188 | 0,01 |
| 3,875 % fällig am 08.02.2029 | | 2.400 | 2.324 | 0,16 |
| **VICI Properties LP** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.12.2026 | | 1.400 | 1.282 | 0,09 |
| **VMware, Inc.** | | | | |
| 2,200 % fällig am 15.08.2031 | | 1.000 | 788 | 0,06 |
| 4,700 % fällig am 15.05.2030 | | 3.000 | 2.896 | 0,20 |
| **Walt Disney Co.** | | | | |
| 2,200 % fällig am 13.01.2028 | | 1.500 | 1.361 | 0,10 |
| **Welltower, Inc.** | | | | |
| 3,850 % fällig am 15.06.2032 | | 7.400 | 6.753 | 0,47 |
| **Westinghouse Air Brake Technologies Corp.** | | | | |
| 3,200 % fällig am 15.06.2025 | | 800 | 764 | 0,05 |
| **Weyerhaeuser Co.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.11.2029 | | 400 | 379 | 0,03 |
| 6,875 % fällig am 15.12.2033 | | 70 | 79 | 0,01 |
| 7,375 % fällig am 15.03.2032 | | 1.112 | 1.288 | 0,09 |
| **Wisconsin Public Service Corp.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 01.12.2051 | | 2.250 | 1.638 | 0,11 |
| **Workday, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.04.2027 | | 1.300 | 1.244 | 0,09 |
| **WP Carey, Inc.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 01.02.2032 | | 2.200 | 1.774 | 0,12 |
| **Xylem, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 30.01.2031 | | 3.600 | 3.003 | 0,21 |
| **ZF North America Capital, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 27.04.2023 | € | 200 | 206 | 0,01 |
| **Zoetis, Inc.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 15.05.2030 | $ | 6.600 | 5.532 | 0,39 |
| 3,250 % fällig am 01.02.2023 | | 400 | 399 | 0,03 |
| | | | 511.030 | 35,82 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Elanco Animal Health, Inc.** | | | | |
| 2,812 % fällig am 01.08.2027 (b) | $ | 188 | $ 178 | 0,01 |
| **IQVIA, Inc.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 07.03.2024 (b) | € | 1.000 | 1.006 | 0,07 |
| **TerraForm Power Operating LLC** | | | | |
| 2,921 % fällig am 21.05.2029 (b) | $ | 2.000 | 1.965 | 0,14 |
| | | | 3.149 | 0,22 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **California Health Facilities Financing Authority Revenue Bonds, Series 2022** | | | | |
| 4,190 % fällig am 01.06.2037 | | 2.100 | 2.002 | 0,14 |
| **University of Michigan Revenue Bonds, Series 2022** | | | | |
| 3,504 % fällig am 01.04.2052 | | 1.300 | 1.154 | 0,08 |
| | | | 3.156 | 0,22 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Freddie Mac** | | | | |
| 1,153 % fällig am 25.08.2029 (a) | | 2.400 | 137 | 0,01 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.07.2052 | | 14.700 | 14.141 | 0,99 |
| | | | 14.278 | 1,00 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | | |
| 1,750 % fällig am 15.08.2041 | | 33.200 | 25.267 | 1,77 |
| 1,875 % fällig am 15.02.2041 | | 17.500 | 13.732 | 0,96 |
| 2,000 % fällig am 15.11.2041 (f) | | 40.700 | 32.341 | 2,27 |
| 2,250 % fällig am 15.05.2041 | | 35.400 | 29.553 | 2,07 |
| 2,375 % fällig am 15.02.2042 (f)(g) | | 57.200 | 48.522 | 3,40 |
| 3,250 % fällig am 15.05.2042 | | 3.900 | 3.807 | 0,27 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 0,500 % fällig am 30.11.2023 | | 22.700 | 21.932 | 1,54 |
| 0,750 % fällig am 30.04.2026 | | 7.400 | 6.785 | 0,48 |
| | | | 181.939 | 12,76 |
| Summe USA | | | 721.612 | 50,59 |
| **URUGUAY** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Uruguay Government International Bond** | | | | |
| 4,975 % fällig am 20.04.2055 | | 700 | 693 | 0,05 |
| **JUNGFERNINSELN (BRITISCH)** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **TSMC Global Ltd.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 23.04.2026 | | 3.600 | 3.280 | 0,23 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **$ 1.451.233** | **101,73** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 1,480 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 29.500 | U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.02.2041 | $ (30.174) | $ 29.500 | $ 29.501 | 2,07 |
| SSB | 0,400 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 6.285 | U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026 | (6.411) | 6.285 | 6.285 | 0,44 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (36.585)** | **$ 35.785** | **$ 35.786** | **2,51** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 134 | $ (41) | 0,00 |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 171 | 309 | 0,02 |
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09.2022 | 2 | 3 | 0,00 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Long | 09.2022 | 44 | (132) | (0,01) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 513 | 1.747 | 0,12 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 40 | 295 | 0,02 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 168 | (131) | (0,01) |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 184 | (55) | 0,00 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 238 | 162 | 0,01 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2022 | 946 | 1.331 | 0,09 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2022 | 133 | 370 | 0,03 |
| United Kingdom Long Gilt December Futures | Long | 03.2023 | 295 | (1.699) | (0,12) |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09.2022 | 146 | 725 | 0,05 |
| | | | | $ 2.884 | 0,20 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 2.884** | **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 |
|---|---|---|---|---|---|
| Koninklijke KPN NV | (1,000) % | 20.12.2023 | € 200 | $ (6) | 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 |
|---|---|---|---|---|---|
| American International Group, Inc. | 1,000 % | 20.12.2026 | $ 900 | $ (18) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.12.2023 | 2.100 | (25) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.06.2026 | 3.200 | (59) | 0,00 |
| Bank of America Corp. | 1,000 | 20.12.2022 | 2.900 | (13) | 0,00 |
| Barclays Bank PLC | 1,000 | 20.12.2022 | € 2.300 | (10) | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.12.2025 | 100 | (1) | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.12.2027 | 300 | (6) | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.06.2028 | 1.600 | (54) | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.12.2028 | 400 | (12) | 0,00 |
| Citigroup, Inc. | 1,000 | 20.12.2022 | $ 1.000 | (2) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.06.2027 | 600 | (33) | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2024 | 300 | 7 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2024 | 800 | 14 | 0,00 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 1,000 | 20.12.2026 | 3.000 | (68) | (0,01) |
| JPMorgan Chase & Co. | 1,000 | 20.12.2022 | 1.000 | (5) | 0,00 |
| Morgan Stanley | 1,000 | 20.12.2022 | 600 | (3) | 0,00 |
| Telefonica Emisiones S.A. | 1,000 | 20.06.2026 | € 100 | (1) | 0,00 |
| Telefonica Emisiones S.A. | 1,000 | 20.06.2028 | 900 | (16) | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 | 20.06.2028 | 600 | (28) | 0,00 |
| Valeo S.A. | 1,000 | 20.06.2026 | 300 | (17) | 0,00 |
| Valeo S.A. | 1,000 | 20.06.2028 | 900 | (81) | (0,01) |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20.06.2026 | $ 700 | (19) | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20.12.2026 | 2.200 | (69) | (0,01) |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20.06.2027 | 9.100 | (104) | (0,01) |
| | | | | $ (623) | (0,04) |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 % | 21.09.2052 | £ 1.200 | $ 205 | 0,01 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2024 | $ 40.600 | (53) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,000 | 16.06.2026 | CAD 27.800 | (1.541) | (0,11) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,220 | 03.03.2025 | 600 | (27) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,235 | 04.03.2025 | 1.100 | (51) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,275 | 03.03.2025 | 600 | (26) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,276 | 03.03.2025 | 300 | (13) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,290 | 03.03.2025 | 200 | (9) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,500 | 17.06.2030 | 500 | (38) | 0,00 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,785 % | 12.08.2051 | $ 800 | $ 192 | 0,01 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2027 | € 62.600 | (2.655) | (0,19) |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | 7.200 | (1.441) | (0,10) |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,600 | 15.12.2050 | 3.100 | 1.430 | 0,10 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,475 | 16.06.2031 | $ 2.600 | 192 | 0,01 |
| | | | | | $ (3.835) | (0,27) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (4.464)** | **(0,31)** |

(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 – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Italy Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2026 | $ 2.300 | $ 11 | $ (31) | $ (20) | 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 | 07.2022 | ZAR | 27.927 | $ | 1.820 | $ 117 | $ 0 | $ 117 | 0,01 |
| | 08.2022 | AUD | 203 | | 140 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 267 | | 212 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08.2022 | £ | 66.385 | | 82.373 | 1.690 | 0 | 1.690 | 0,12 |
| | 08.2022 | SEK | 8.815 | | 891 | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 2.957 | £ | 2.355 | 0 | (95) | (95) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 802 | NOK | 7.634 | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | € | 6.362 | $ | 6.766 | 115 | 0 | 115 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 367.261 | € | 349.138 | 0 | (2.255) | (2.255) | (0,16) |
| | 07.2022 | ZAR | 1.734 | $ | 111 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 16.214 | | 12.535 | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 345.759 | | 364.332 | 2.191 | 0 | 2.191 | 0,15 |
| BRC | 07.2022 | $ | 811 | € | 766 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.404 | NOK | 13.738 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | BRL | 57 | $ | 12 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2.094 | € | 1.950 | 0 | (55) | (55) | (0,01) |
| | 08.2022 | AUD | 4.976 | $ | 3.501 | 78 | 0 | 78 | 0,01 |
| | 11.2022 | $ | 93 | PEN | 370 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | | 11 | BRL | 57 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | BRL | 57 | $ | 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 08.2022 | $ | 3.202 | NOK | 31.745 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | € | 359.844 | $ | 388.055 | 11.856 | 0 | 11.856 | 0,83 |
| | 07.2022 | $ | 15.093 | € | 14.352 | 0 | (88) | (88) | (0,01) |
| | 08.2022 | CAD | 3.565 | $ | 2.782 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | CHF | 125 | | 130 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 18 | | 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 9 | | 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | SEK | 17.265 | | 1.699 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 50 | € | 47 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 905 | £ | 746 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | SEK | 1.935 | $ | 191 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| RYL | 08.2022 | CAD | 265 | | 205 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 08.2022 | AUD | 220 | | 160 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 2.882 | CHF | 2.880 | $ 134 | $0 | $134 | 0,01 |
| | 09.2022 | ZAR | 35.129 | $ | 2.272 | 143 | 0 | 143 | 0,01 |
| UAG | 08.2022 | AUD | 2.288 | | 1.653 | 79 | 0 | 79 | 0,01 |
| | | | | | | $ 16.506 | $ (2.578) | $ 13.928 | 0,97 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | CHF 1.364 | $ 1.369 | $ 0 | $ (56) | $ (56) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 65.483 | CHF 62.577 | 1 | (120) | (119) | (0,01) |
| BPS | 07.2022 | CHF 144 | $ 150 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 11 | CHF 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | 65.303 | 62.507 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | 19 | 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | CHF 18 | $ 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 27.447 | CHF 26.330 | 56 | 0 | 56 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | CHF 86 | $ 89 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 43.699 | CHF 41.779 | 4 | (63) | (59) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | CHF 189 | $ 193 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | | | | $ 62 | $ (257) | $ (195) | (0,01) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | $ 49 | € 46 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | € 244.500 | $ 257.111 | 1.497 | 0 | 1.497 | 0,11 |
| | 07.2022 | $ 15.308 | € 14.510 | 0 | (139) | (139) | (0,01) |
| | 08.2022 | 232.993 | 221.115 | 0 | (1.401) | (1.401) | (0,10) |
| CBK | 07.2022 | € 99 | $ 106 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 11.166 | € 10.400 | 0 | (294) | (294) | (0,02) |
| MBC | 07.2022 | € 226.294 | $ 238.073 | 1.494 | 0 | 1.494 | 0,10 |
| | 07.2022 | $ 249.693 | € 231.541 | 0 | (7.627) | (7.627) | (0,54) |
| | 08.2022 | 233.036 | 221.115 | 0 | (1.444) | (1.444) | (0,10) |
| SCX | 07.2022 | 208.711 | 194.837 | 0 | (5.018) | (5.018) | (0,35) |
| UAG | 07.2022 | 250.698 | 233.294 | 0 | (6.801) | (6.801) | (0,48) |
| | | | | $ 2.993 | $ (22.725) | $ (19.732) | (1,39) |

Zum 30. Juni 2022 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 Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | £ 259 | $ 325 | $ 10 | $ 0 | $ 10 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 91.581 | £ 72.432 | 0 | (3.617) | (3.617) | (0,25) |
| BPS | 07.2022 | £ 6.759 | $ 8.346 | 145 | (7) | 138 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ 1.175 | £ 933 | 0 | (42) | (42) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | £ 3.173 | $ 3.875 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 91.534 | £ 72.563 | 0 | (3.410) | (3.410) | (0,24) |
| CBK | 07.2022 | £ 18 | $ 23 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | 1.719 | 2.114 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | $ 10 | £ 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | £ 78 | $ 95 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 89.520 | £ 71.210 | 0 | (3.039) | (3.039) | (0,21) |
| | | | | $ 205 | $ (10.115) | $ (9.910) | (0,69) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | SEK 3.166 | $ 319 | $ 10 | $ 0 | $ 10 | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | 1.956 | 197 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 81.160 | SEK 792.848 | 0 | (3.790) | (3.790) | (0,27) |
| BPS | 07.2022 | 103.050 | 1.011.674 | 0 | (4.325) | (4.325) | (0,30) |
| BRC | 07.2022 | SEK 859.896 | $ 84.623 | 710 | 0 | 710 | 0,05 |
| | 08.2022 | $ 84.623 | SEK 859.184 | 0 | (698) | (698) | (0,05) |
| CBK | 07.2022 | 18.820 | 183.748 | 0 | (888) | (888) | (0,06) |
| MBC | 07.2022 | SEK 373.339 | $ 36.875 | 442 | 0 | 442 | 0,03 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07.2022 | $ 1.875 | SEK 19.009 | $ 0 | $ (20) | $ (20) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | 266 | 2.604 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | SEK 24.893 | $ 2.456 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 649 | 67 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 108.781 | SEK 1.063.198 | 0 | (5.028) | (5.028) | (0,35) |
| | | | | $ 1.199 | $ (14.761) | $ (13.562) | (0,95) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (29.491)** | **(2,07)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 1.455.947** | **102,06** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ (29.451)** | **(2,06)** |
| **Nettovermögen** | **$ 1.426.496** | **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

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Nullkuponwertpapier.

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

(d) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(e) Eingeschränkte Wertpapiere:

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeits-datum | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| AT&T, Inc. | 4,850 % | 25.05.2047 | 23.09.2021 | $ 1.327 | $ 1.003 | 0,07 |
| Citigroup, Inc. | 1,669 | 25.01.2026 | 18.01.2022 | 2.000 | 1.933 | 0,14 |
| Citigroup, Inc. | 2,572 | 03.06.2031 | 08.09.2021 - 29.12.2021 | 13.259 | 11.023 | 0,77 |
| Deutsche Bank AG | 1,447 | 01.04.2025 | 23.09.2021 | 2.008 | 1.870 | 0,13 |
| Oracle Corp. | 3,950 | 25.03.2051 | 22.03.2021 | 299 | 221 | 0,02 |
| | | | | $ 18.893 | $ 16.050 | 1,13 |

(f) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 63.250 als Sicherheiten verpfändet.

(g) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 11.282 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.531 als Sicherheiten erhalten.

Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 260 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 21.461 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 25.040 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 1.449.268 | $ 1.965 | $ 1.451.233 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 35.785 | 0 | 35.785 |
| Finanzderivate[3] | 1.208 | (32.279) | 0 | (31.071) |
| **Summen** | **$ 1.208** | **$ 1.452.774** | **$ 1.965** | **$ 1.455.947** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 1.166.597 | $ 0 | $ 1.166.597 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 962 | 0 | 962 |
| Finanzderivate[3] | 987 | 7.174 | 0 | 8.161 |
| **Summen** | **$ 987** | **$ 1.174.733** | **$ 0** | **$ 1.175.720** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2022:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 1,500 % | 22.06.2022 | 06.07.2022 | $ (36.437) | $ (36.451) | (2,55) |
| | 1,510 | 22.06.2022 | 06.07.2022 | (24.526) | (24.535) | (1,72) |
| BRC | (1,250) | 26.05.2022 | TBD[1] | £ (669) | (811) | (0,06) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (61.797)** | **(4,33)** |

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

**Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2022:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| MSC | 1,530 % | 21.06.2022 | 05.07.2022 | $ (11.066) | $ (11.071) | (0,78) |
| **Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte** | | | | | **$ (11.071)** | **(0,78)** |

(1) In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 2 für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ 10 | $ 0 | $ 10 |
| BOA | (5.867) | 5.540 | (327) |
| BPS | (4.250) | 3.800 | (450) |
| BRC | (3.398) | 3.160 | (238) |
| CBK | (1.164) | 750 | (414) |
| JPM | 14 | 0 | 14 |
| MBC | 4,657 | (4.150 ) | 507 |
| MYI | 63 | 0 | 63 |
| RYL | 26 | 0 | 26 |
| SCX | (12.856) | 11.790 | (1.066) |
| UAG | (6.726) | 0 | (6.726) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 80,49 | 78,12 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 20,72 | 19,89 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 0,52 | 0,06 |
| Pensionsgeschäfte | 2,51 | 0,08 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,20 | (0,02) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,31) | 0,00 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (2,07) | 0,71 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (4,33) | k. A. |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (0,78) | k. A. |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Australien | 0,73 | 0,94 |
| Österreich | 0,21 | 0,38 |
| Belgien | 0,45 | 0,55 |
| Bermuda | k. A. | 0,10 |
| Brasilien | 0,41 | 0,75 |
| Kanada | 1,38 | 0,77 |
| Cayman-Inseln | 0,30 | 1,02 |
| Chile | 0,91 | 0,50 |
| China | k. A. | 0,26 |
| Kolumbien | 0,08 | 0,11 |
| Kroatien | 0,02 | 0,03 |
| Dänemark | 0,63 | 0,25 |
| Finnland | 0,80 | 1,19 |
| Frankreich | 5,96 | 6,42 |
| Deutschland | 3,35 | 2,04 |
| Guernsey, Kanalinseln | 0,28 | 0,47 |
| Hongkong | 0,01 | 0,29 |
| Indien | 1,14 | 0,50 |
| Indonesien | 0,08 | 0,51 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Irland | 0,75 | 0,51 |
| Insel Man | k. A. | 0,06 |
| Italien | 1,63 | 2,72 |
| Japan | 3,47 | 2,61 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,09 | 0,15 |
| Luxemburg | 1,85 | 1,52 |
| Mauritius | 0,67 | 0,85 |
| Mexiko | 0,44 | 0,76 |
| Multinational | 0,67 | 0,34 |
| Niederlande | 7,04 | 6,62 |
| Norwegen | 0,16 | k. A. |
| Panama | k. A. | 0,03 |
| Peru | 0,10 | 0,19 |
| Rumänien | 0,34 | 0,38 |
| Serbien | 0,13 | 0,18 |
| Singapur | 0,40 | 0,20 |
| Südafrika | 0,09 | k. A. |
| Südkorea | 1,49 | 1,38 |
| Spanien | 2,40 | 3,09 |
| Supranational | 1,64 | 0,95 |
| Schweden | 0,77 | 0,65 |
| Schweiz | 0,97 | 1,11 |
| Thailand | 0,05 | 0,06 |
| Großbritannien | 8,97 | 9,79 |
| USA | 50,59 | 44,41 |
| Uruguay | 0,05 | 0,08 |
| Jungferninseln (Britisch) | 0,23 | 0,30 |
| Kurzfristige Instrumente | k. A. | 2,05 |
| Pensionsgeschäfte | 2,51 | 0,08 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,20 | (0,02) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf | 0,00 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,04) | 0,00 |
| Zinsswaps | (0,27) | 0,00 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,00 | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | 0,97 | (0,26) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (3,04) | 0,97 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (2,06) | 1,16 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 22.03.2023 | $ | 1.100 | $ 1.102 | 0,11 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Australia Government International Bond** | | | | |
| 0,750 % fällig am 21.11.2027 | AUD | 4.228 | 2.892 | 0,30 |
| 3,000 % fällig am 20.09.2025 | | 5.866 | 4.419 | 0,45 |
| | | | 7.311 | 0,75 |
| Summe Australien | | | 8.413 | 0,86 |
| **KANADA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Canadian Government Real Return Bond** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.12.2026 (c) | CAD | 2.558 | 2.288 | 0,23 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Atlas Senior Loan Fund Ltd.** | | | | |
| 2,194 % fällig am 16.01.2030 | $ | 2.295 | 2.272 | 0,23 |
| **Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.** | | | | |
| 2,144 % fällig am 15.10.2030 | | 1.342 | 1.324 | 0,14 |
| **Sound Point CLO Ltd.** | | | | |
| 1,994 % fällig am 15.04.2029 | | 4.611 | 4.557 | 0,46 |
| | | | 8.153 | 0,83 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.08.2022 | | 14 | 14 | 0,00 |
| Summe Cayman Inseln | | | 8.167 | 0,83 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.10.2053 | DKK | 20.206 | 2.070 | 0,21 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 10.551 | 1.167 | 0,12 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 11.004 | 1.133 | 0,12 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 495 | 56 | 0,01 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 15.223 | 1.675 | 0,17 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 4 | 1 | 0,00 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.10.2043 | | 11.172 | 1.278 | 0,13 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 15.499 | 1.717 | 0,17 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 14 | 2 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.10.2053 | | 3.114 | 319 | 0,03 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 41.560 | 4.383 | 0,45 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 71.663 | 7.385 | 0,75 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 186.054 | 21.069 | 2,14 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2053 | | 8.682 | 1.032 | 0,10 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 2 | 0 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2053 | | 51.100 | 6.714 | 0,68 |
| 3,500 % fällig am 01.10.2053 | | 5.000 | 678 | 0,07 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 37.834 | 4.178 | 0,43 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 13.430 | 1.426 | 0,14 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 16.328 | 1.853 | 0,19 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 43.646 | 4.817 | 0,49 |
| 2,500 % fällig am 01.04.2047 | | 9 | 1 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2053 | | 27.400 | 3.601 | 0,37 |
| | | | 66.555 | 6,77 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Denmark Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.11.2023 (c) | | 12.661 | 1.860 | 0,19 |
| Summe Dänemark | | | 68.415 | 6,96 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **France Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 01.03.2025 (c) | € | 9.597 | 10.585 | 1,08 |
| 0,100 % fällig am 01.03.2026 (c) | | 3.711 | 4.118 | 0,42 |
| 0,100 % fällig am 01.03.2028 (c) | € | 13.546 | $ 15.042 | 1,53 |
| 0,100 % fällig am 01.03.2029 (c) | | 551 | 608 | 0,06 |
| 0,100 % fällig am 25.07.2031 (c) | | 3.171 | 3.463 | 0,35 |
| 0,100 % fällig am 25.07.2036 (c) | | 225 | 237 | 0,02 |
| 0,100 % fällig am 25.07.2038 (c) | | 3.113 | 3.237 | 0,33 |
| 0,250 % fällig am 25.07.2024 (c) | | 14.311 | 16.014 | 1,63 |
| 0,500 % fällig am 25.05.2029 | | 1.500 | 1.459 | 0,15 |
| 1,100 % fällig am 25.07.2022 (c) | | 9.673 | 10.181 | 1,04 |
| 2,100 % fällig am 25.07.2023 (c) | | 11.013 | 12.327 | 1,26 |
| Summe Frankreich | | | 77.271 | 7,87 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.04.2023 (c) | | 16.010 | 17.374 | 1,77 |
| **GUERNSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.09.2022 | $ | 600 | 601 | 0,06 |
| **IRLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Ares European CLO DAC** | | | | |
| 0,610 % fällig am 15.04.2030 | € | 5.641 | 5.782 | 0,59 |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | | 4.200 | 4.294 | 0,44 |
| **Cairn CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 20.10.2028 | | 849 | 882 | 0,09 |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | | 1.700 | 1.732 | 0,18 |
| **Carlyle Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,700 % fällig am 15.01.2031 | | 800 | 817 | 0,08 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | | 888 | 925 | 0,09 |
| **Jubilee CLO DAC** | | | | |
| 0,519 % fällig am 15.12.2029 | | 511 | 529 | 0,05 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** | | | | |
| 1,050 % fällig am 15.10.2031 | | 5.900 | 6.074 | 0,62 |
| **Palmerston Park CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 18.04.2030 | | 1.367 | 1.407 | 0,14 |
| | | | 22.442 | 2,28 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **European Loan Conduit DAC** | | | | |
| 1,000 % fällig am 17.02.2030 | | 1.294 | 1.335 | 0,14 |
| Summe Irland | | | 23.777 | 2,42 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.05.2033 (c) | | 1.916 | 1.736 | 0,18 |
| 0,400 % fällig am 15.05.2030 (c) | | 5.099 | 5.082 | 0,52 |
| 0,650 % fällig am 15.05.2026 (c) | | 3.496 | 3.770 | 0,38 |
| 1,400 % fällig am 26.05.2025 (c) | | 30.055 | 32.752 | 3,34 |
| 2,350 % fällig am 15.09.2024 (c) | | 31.838 | 36.483 | 3,71 |
| 2,600 % fällig am 15.09.2023 (c) | | 10.461 | 11.831 | 1,20 |
| Summe Italien | | | 91.654 | 9,33 |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Mitsubishi HC Capital, Inc.** | | | | |
| 2,652 % fällig am 19.09.2022 | $ | 200 | 200 | 0,02 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Japan Government International Bond** | | | | |
| 0,005 % fällig am 10.03.2031 (c) | ¥ | 184.223 | 1.435 | 0,15 |
| 0,100 % fällig am 10.09.2024 (c) | | 568.150 | 4.303 | 0,44 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2025 (c) | | 736.920 | 5.598 | 0,57 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2026 (c) | | 1.622.001 | 12.506 | 1,27 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2028 (c) | | 708.989 | 5.485 | 0,56 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2029 (c) | | 951.041 | 7.371 | 0,75 |
| | | | 36.698 | 3,74 |
| Summe Japan | | | 36.898 | 3,76 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Delos Finance SARL** | | | | |
| 4,000 % fällig am 06.10.2023 | $ | 70 | $ 69 | 0,01 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Grosvenor Place CLO BV** | | | | |
| 0,720 % fällig am 30.10.2029 | € | 2.064 | 2.149 | 0,22 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ING Bank NV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.12.2022 | $ | 700 | 699 | 0,07 |
| Summe Niederlande | | | 2.848 | 0,29 |
| **NEUSEELAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **New Zealand Government International Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 20.09.2025 | NZD | 9.540 | 6.071 | 0,62 |
| 3,000 % fällig am 20.09.2030 | | 1.185 | 795 | 0,08 |
| Summe Neuseeland | | | 6.866 | 0,70 |
| **PERU** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | PEN | 4.900 | 1.179 | 0,12 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 5.700 | 1.327 | 0,13 |
| Summe Peru | | | 2.506 | 0,25 |
| **SLOWENIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Nova Ljubljanska Banka d.d.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 05.02.2030 | € | 600 | 552 | 0,06 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **BBVA Consumer Auto** | | | | |
| 0,270 % fällig am 20.07.2031 | | 635 | 654 | 0,07 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Spain Government International Bond** | | | | |
| 0,700 % fällig am 30.11.2033 (c) | | 4.162 | 4.446 | 0,45 |
| Summe Spanien | | | 5.100 | 0,52 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Sweden Government International Bond** | | | | |
| 0,125 % fällig am 01.06.2026 | SEK | 44.795 | 4.624 | 0,47 |
| 0,125 % fällig am 01.12.2027 | | 4.779 | 502 | 0,05 |
| 1,000 % fällig am 01.06.2025 | | 57.713 | 6.027 | 0,62 |
| Summe Schweden | | | 11.153 | 1,14 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 3,747 % fällig am 25.06.2024 | $ | 1.600 | 1.602 | 0,16 |
| 4,519 % fällig am 25.06.2024 | | 1.000 | 998 | 0,10 |
| | | | 2.600 | 0,26 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Canada Square Funding PLC** | | | | |
| 1,550 % fällig am 17.10.2051 | £ | 2.228 | 2.704 | 0,28 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | |
| 1,795 % fällig am 16.09.2069 | | 1.060 | 1.286 | 0,13 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 1,048 % fällig am 18.06.2038 | | 153 | 183 | 0,02 |
| 1,743 % fällig am 18.03.2039 | | 38 | 45 | 0,00 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | | |
| 1,703 % fällig am 25.05.2053 | | 2.989 | 3.624 | 0,37 |
| **Polaris PLC** | | | | |
| 1,740 % fällig am 23.10.2059 | | 2.965 | 3.552 | 0,36 |
| **Precise Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,870 % fällig am 16.10.2056 | | 357 | 429 | 0,04 |
| 1,952 % fällig am 12.12.2055 | | 882 | 1.065 | 0,11 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2045 | £ 1.648 | $ 1.999 | 0,20 |
| 1,827 % fällig am 20.02.2054 | 693 | 842 | 0,09 |
| | | 15.729 | 1,60 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | |
| 0,125 % fällig am 22.03.2024 (c) | 21.150 | 27.181 | 2,77 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2026 (c) | 26.144 | 34.214 | 3,48 |
| 0,125 % fällig am 22.11.2036 (c) | 1.028 | 1.488 | 0,15 |
| 0,125 % fällig am 22.11.2056 (c) | 43 | 68 | 0,01 |
| 0,625 % fällig am 22.10.2050 | 1.900 | 1.408 | 0,14 |
| 1,875 % fällig am 22.11.2022 (c) | 13.001 | 16.352 | 1,67 |
| | | 80.711 | 8,22 |
| Summe Großbritannien | | 99.040 | 10,08 |
| **USA** | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,524 % fällig am 25.10.2034 | $ 655 | 642 | 0,07 |
| **Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | |
| 1,954 % fällig am 25.03.2036 | 97 | 96 | 0,01 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,284 % fällig am 25.01.2036 | 2.514 | 2.490 | 0,25 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | |
| 2,359 % fällig am 25.07.2035 | 17 | 17 | 0,00 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,564 % fällig am 25.05.2034 | 2.162 | 2.024 | 0,21 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | |
| 2,574 % fällig am 25.10.2033 | 838 | 812 | 0,08 |
| **Structured Asset Securities Corp.** | | | |
| 2,329 % fällig am 25.02.2035 | 1.487 | 1.449 | 0,15 |
| | | 7.530 | 0,77 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Nissan Motor Acceptance Co. LLC** | | | |
| 3,450 % fällig am 15.03.2023 | 100 | 100 | 0,01 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | |
| 5,750 % fällig am 15.05.2024 | $ 200 | $ 204 | 0,02 |
| | | 304 | 0,03 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | |
| **GS Mortgage Securities Trust** | | | |
| 2,773 % fällig am 10.11.2045 | 2.075 | 2.071 | 0,21 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | |
| 2,164 % fällig am 25.08.2036 | 250 | 248 | 0,02 |
| 2,264 % fällig am 25.10.2028 | 9 | 9 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | |
| 2,075 % fällig am 19.04.2035 | 339 | 319 | 0,03 |
| 2,095 % fällig am 19.07.2035 | 56 | 52 | 0,01 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 2,204 % fällig am 25.07.2045 | 433 | 407 | 0,04 |
| 2,264 % fällig am 25.07.2045 | 87 | 82 | 0,01 |
| | | 3.188 | 0,32 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Ginnie Mae** | | | |
| 0,382 % fällig am 20.08.2068 | 1.216 | 1.187 | 0,12 |
| 1,503 % fällig am 20.08.2066 | 331 | 330 | 0,03 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 | 500 | 450 | 0,05 |
| 3,000 % fällig am 01.08.2052 | 12.100 | 11.260 | 1,15 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2052 | 7.500 | 7.206 | 0,73 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 3.000 | 2.959 | 0,30 |
| | | 23.392 | 2,38 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c)** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2024 | 8.521 | 8.605 | 0,88 |
| 0,125 % fällig am 15.10.2024 (e) | 78.189 | 78.685 | 8,01 |
| 0,125 % fällig am 15.04.2025 | 52.115 | 52.155 | 5,31 |
| 0,125 % fällig am 15.10.2025 | 51.356 | 51.333 | 5,23 |
| 0,125 % fällig am 15.04.2026 | 41.697 | 41.322 | 4,21 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2026 | 34.844 | 34.576 | 3,52 |
| 0,125 % fällig am 15.10.2026 (e) | 85.471 | 84.728 | 8,63 |
| 0,125 % fällig am 15.04.2027 | 17.302 | 17.043 | 1,73 |
| 0,125 % fällig am 15.01.2030 | 17.976 | 17.171 | 1,75 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2030 | $ 6.990 | $ 6.671 | 0,68 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2031 | 12.489 | 11.885 | 1,21 |
| 0,125 % fällig am 15.01.2032 (e) | 1.564 | 1.486 | 0,15 |
| 0,125 % fällig am 15.02.2051 | 333 | 257 | 0,03 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 | 10.617 | 10.684 | 1,09 |
| 0,250 % fällig am 15.02.2050 | 450 | 356 | 0,04 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2023 | 14.905 | 15.169 | 1,54 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 | 16.943 | 17.118 | 1,74 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2027 | 11.935 | 11.897 | 1,21 |
| 0,500 % fällig am 15.04.2024 | 42.841 | 43.441 | 4,42 |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028 | 7.265 | 7.220 | 0,73 |
| 0,625 % fällig am 15.04.2023 (e) | 80.191 | 81.567 | 8,30 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2024 | 24.930 | 25.360 | 2,58 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2026 (e) | 59.402 | 60.088 | 6,12 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2045 | 1.841 | 1.652 | 0,17 |
| 0,875 % fällig am 15.02.2047 | 718 | 665 | 0,07 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 | 1.116 | 1.144 | 0,12 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2041 | 792 | 922 | 0,09 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | |
| 1,750 % fällig am 31.12.2024 | 30 | 29 | 0,00 |
| | | 683.229 | 69,56 |
| Summe USA | | 717.643 | 73,06 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | |
| 51,049 % fällig am 30.09.2022 (a)(b) | ARS 34.100 | 114 | 0,01 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 114 | 0,01 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | **$ 1.180.749** | **120,21** |
| | **AKTIEN** | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)** | 16.685 | 166 | 0,02 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$ 166** | **0,02** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 577 | U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | $ (589) | $ 577 | $ 577 | 0,06 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (589)** | **$ 577** | **$ 577** | **0,06** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month SOFR December Futures | Long | 03.2023 | 518 | $ 96 | 0,01 |
| 3-Month SOFR March Futures | Short | 06.2023 | 518 | (136) | (0,01) |
| 3-Month Euribor March Futures | Long | 03.2023 | 411 | (1.920) | (0,20) |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 16 | 5 | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 144.500 EUR auf Euro-Bund August 2022 Futures(1) | Short | 07.2022 | 77 | (197) | (0,02) |
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09.2022 | 121 | (132) | (0,01) |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09.2022 | 418 | (2.983) | (0,30) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 190 | 549 | 0,06 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 110 | (189) | (0,02) |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 78 | 342 | 0,03 |
| Euro-Schatz September Futures | Short | 09.2022 | 528 | (75) | (0,01) |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 63 | (86) | (0,01) |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 144.500 EUR auf August 2022 Futures(1) | Short | 07.2022 | 77 | 114 | 0,01 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 114 | (97) | (0,01) |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 296 | 144 | 0,01 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 216 | (360) | (0,04) |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2022 | 431 | 1.020 | 0,10 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 9 | $ (11) | 0,00 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2022 | 54 | 150 | 0,02 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Long | 09.2022 | 7 | (35) | 0,00 |
| | | | | $ (3.801) | (0,39) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ (3.801)** | **(0,39)** |

(1) Future-Style-Option.

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Barclays Bank PLC | 1,000 % | 20.12.2022 | € 900 | $ (5) | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2023 | $ 500 | (5) | 0,00 |
| | | | | $ (10) | 0,00 |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 % | 21.09.2032 | £ 6.500 | $ 752 | 0,08 |
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2052 | 2.800 | 481 | 0,05 |
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 1,600 | 18.05.2032 | 9.000 | (631) | (0,06) |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 16.06.2029 | ¥ 3.582.000 | (102) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,435 | 20.06.2029 | 1.418.000 | (68) | (0,01) |
| Erhalt[3] | 3-Month USD-LIBOR | 1,840 | 21.11.2028 | $ 11.700 | 465 | 0,05 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,880 | 25.01.2052 | 4.300 | (849) | (0,09) |
| Zahlung[3] | 3-Month USD-LIBOR | 1,888 | 21.11.2053 | 2.400 | (386) | (0,04) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | € 31.100 | 2.715 | 0,28 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2052 | 2.100 | 541 | 0,05 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 12.04.2027 | 5.500 | (253) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 11.05.2027 | 4.900 | (226) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,700 | 11.04.2027 | 3.200 | (141) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 13.05.2027 | 4.400 | (143) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.05.2027 | 900 | (29) | 0,00 |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,005 | 15.02.2025 | 18.100 | 1.410 | 0,14 |
| Zahlung | CPTFEMU | 1,355 | 15.02.2050 | 1.200 | 8 | 0,00 |
| Zahlung | CPTFEMU | 1,375 | 15.02.2040 | 1.600 | (77) | (0,01) |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,380 | 15.03.2031 | 4.800 | 340 | 0,03 |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,500 | 15.07.2031 | 7.040 | 534 | 0,05 |
| Zahlung | CPTFEMU | 1,946 | 15.03.2048 | 800 | (92) | (0,01) |
| Zahlung | CPTFEMU | 2,421 | 15.05.2052 | 330 | (6) | 0,00 |
| Zahlung | CPTFEMU | 2,455 | 15.06.2032 | 2.300 | 12 | 0,00 |
| Zahlung | CPTFEMU | 2,488 | 15.05.2037 | 2.290 | (4) | 0,00 |
| Zahlung | CPTFEMU | 2,550 | 15.04.2052 | 1.400 | 30 | 0,00 |
| Erhalt | CPTFEMU | 2,570 | 15.06.2032 | 1.200 | (17) | 0,00 |
| Zahlung | CPTFEMU | 2,580 | 15.03.2052 | 1.400 | 27 | 0,00 |
| Erhalt | CPTFEMU | 2,600 | 15.05.2032 | 3.000 | (29) | 0,00 |
| Erhalt | CPTFEMU | 2,720 | 15.06.2032 | 4.500 | (139) | (0,01) |
| Erhalt | CPTFEMU | 3,000 | 15.05.2027 | 2.100 | 6 | 0,00 |
| Erhalt | CPTFEMU | 3,130 | 15.05.2027 | 100 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 1,794 | 24.08.2027 | $ 6.700 | 159 | 0,02 |
| Erhalt | CPURNSA | 1,798 | 25.08.2027 | 3.400 | 81 | 0,01 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,883 | 20.11.2029 | 7.400 | (133) | (0,01) |
| Erhalt | CPURNSA | 1,890 | 27.08.2027 | 6.500 | 157 | 0,02 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,954 | 03.06.2029 | 4.700 | (88) | (0,01) |
| Zahlung | CPURNSA | 1,998 | 25.07.2029 | 4.300 | (82) | (0,01) |
| Erhalt | CPURNSA | 2,210 | 05.02.2023 | 17.550 | 700 | 0,07 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,220 | 13.04.2023 | 7.440 | 279 | 0,03 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,263 | 27.04.2023 | 60 | 2 | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,263 | 09.05.2023 | 5.230 | 190 | 0,02 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,281 | 10.05.2023 | 6.064 | 220 | 0,02 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,311 | 24.02.2031 | 6.600 | 138 | 0,01 |
| Zahlung | CPURNSA | 2,335 | 05.02.2028 | 6.110 | (165) | (0,02) |
| Zahlung | CPURNSA | 2,353 | 09.05.2028 | 960 | (25) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 2,364 | 10.05.2028 | 7.960 | (205) | (0,02) |
| Zahlung | CPURNSA | 2,379 | 09.07.2028 | 1.900 | (48) | (0,01) |
| Erhalt | CPURNSA | 2,419 | 05.03.2026 | 400 | 11 | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,690 | 01.06.2026 | 1.300 | 37 | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,703 | 25.05.2026 | 2.450 | 70 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,768 | 13.05.2026 | 3.500 | 101 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,813 | 14.05.2026 | 1.600 | 47 | 0,00 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | CPURNSA | 5,000 % | 03.03.2023 | $ 16.000 | $ (280) | (0,03) |
| Zahlung | FRCPXTOB | 1,280 | 15.11.2034 | € 1.700 | (153) | (0,02) |
| Zahlung | FRCPXTOB | 1,410 | 15.11.2039 | 2.000 | (183) | (0,02) |
| Zahlung | UKRPI | 3,330 | 15.01.2025 | £ 400 | (24) | 0,00 |
| Zahlung | UKRPI | 3,346 | 15.05.2030 | 550 | (4) | 0,00 |
| Zahlung | UKRPI | 3,530 | 15.10.2031 | 7.260 | (93) | (0,01) |
| Zahlung | UKRPI | 3,566 | 15.03.2036 | 1.400 | 60 | 0,01 |
| Zahlung | UKRPI | 3,750 | 15.04.2031 | 1.930 | (11) | 0,00 |
| Zahlung | UKRPI | 3,850 | 15.09.2024 | 4.700 | (326) | (0,03) |
| Erhalt | UKRPI | 4,049 | 15.07.2022 | 15.300 | 558 | 0,06 |
| Erhalt | UKRPI | 4,180 | 15.09.2022 | 2.200 | 111 | 0,01 |
| Erhalt | UKRPI | 4,220 | 15.08.2022 | 1.400 | 63 | 0,01 |
| Zahlung | UKRPI | 4,288 | 15.02.2032 | 2.200 | 94 | 0,01 |
| Erhalt | UKRPI | 4,480 | 15.09.2023 | 1.300 | 110 | 0,01 |
| Erhalt | UKRPI | 6,440 | 15.05.2024 | 1.500 | 13 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 6,600 | 15.05.2024 | 2.200 | 11 | 0,00 |
| | | | | | $ 5.521 | 0,56 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 5.511** | **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.

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

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

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

**OPTIONSKAUF**

**ZINSSWAPOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,195 % | 02.11.2022 | 2.200 | $ 2 | $ 939 | 0,09 |
| | Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,197 | 04.11.2022 | 2.590 | 197 | 1.104 | 0,11 |
| | Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,000 | 15.03.2023 | 1.400 | 157 | 661 | 0,07 |
| BRC | Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,410 | 02.02.2023 | 59.900 | 299 | 51 | 0,01 |
| | Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,197 | 04.11.2022 | 1.410 | 105 | 601 | 0,06 |
| CBK | Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,720 | 23.02.2023 | 11.300 | 62 | 19 | 0,00 |
| DUB | Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,237 | 17.11.2023 | 8.700 | 540 | 1.368 | 0,14 |
| GLM | Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,200 | 26.04.2023 | 10.000 | 107 | 101 | 0,01 |
| JPM | Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,710 | 25.01.2023 | 12.100 | 74 | 16 | 0,00 |
| | Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,000 | 15.03.2023 | 1.800 | 198 | 850 | 0,09 |
| MYC | Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,428 | 31.01.2023 | 59.500 | 304 | 50 | 0,01 |
| | Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,190 | 02.11.2022 | 2.100 | 153 | 898 | 0,09 |
| | Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,200 | 31.05.2023 | 28.400 | 341 | 318 | 0,03 |
| | | | | | | | $ 2.539 | $ 6.976 | 0,71 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

**INFLATION-CAPPED OPTIONS**

| Kontrahent | Beschreibung | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | Cap – OTC CPALEMU | $ 100,151 | Maximal [(Index Final/Index Initial – 1) – 3,000 %] oder 0 | 22.06.2035 | 1.500 | $ (68) | $ (22) | 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 |
| | | | | | | $ (76) | $ (22) | 0,00 |

**ZINSSWAPOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,000 % | 02.11.2022 | 6.600 | $ 0 | $ (1.441) | (0,15) |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,000 | 04.11.2022 | 7.740 | (192) | (1.691) | (0,17) |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,175 | 15.03.2023 | 4.200 | (154) | (1.009) | (0,10) |
| BRC | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,558 | 02.02.2023 | 13.100 | (300) | (33) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,000 | 04.11.2022 | 4.160 | (102) | (909) | (0,09) |
| CBK | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,736 | 23.02.2023 | 2.700 | (67) | (11) | 0,00 |
| DUB | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,350 | 08.08.2022 | 2.200 | (8) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,550 | 08.08.2022 | 2.200 | (9) | (44) | (0,01) |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,340 | 17.11.2023 | 43.000 | (542) | (1.767) | (0,18) |

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,350 % | 26.04.2023 | 5.500 | $ (109) | $ (93) | (0,01) |
| JPM | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,785 | 25.01.2023 | 2.800 | (77) | (11) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,175 | 15.03.2023 | 5.400 | (194) | (1.297) | (0,13) |
| MYC | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,579 | 31.01.2023 | 13.000 | (304) | (33) | (0,01) |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,350 | 31.05.2023 | 15.600 | (340) | (289) | (0,03) |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,000 | 02.11.2022 | 6.400 | (155) | (1.397) | (0,14) |
| | | | | | | | $ (2.553) | $ (10.025) | (1,02) |

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPM | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2052 | $ 96,906 | 04.08.2022 | 200 | $ (1) | $ (3) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,141 | 07.09.2022 | 300 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,156 | 07.09.2022 | 500 | (2) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,656 | 07.09.2022 | 800 | (3) | (7) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 101,141 | 07.09.2022 | 300 | (1) | (1) | 0,00 |
| SAL | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | 94,688 | 07.09.2022 | 1.000 | (6) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 99,156 | 07.07.2022 | 2.400 | (17) | (15) | (0,01) |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 99,563 | 07.07.2022 | 600 | (3) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 100,281 | 07.07.2022 | 1.300 | (6) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 98,234 | 07.09.2022 | 1.700 | (10) | (7) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,406 | 07.09.2022 | 600 | (2) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,656 | 07.09.2022 | 800 | (3) | (7) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 100,234 | 07.09.2022 | 1.700 | (8) | (14) | 0,00 |
| | | | | | $ (63) | $ (71) | (0,01) |

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 % | 17.10.2057 | $ 600 | $ (40) | $ 40 | $ 0 | 0,00 |
| SAL | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 1.400 | (3) | (12) | (15) | 0,00 |
| UAG | CMBX.NA.AAA.9 Index | 0,500 | 17.09.2058 | 897 | (80) | 79 | (1) | 0,00 |
| | | | | | $ (123) | $ 107 | $ (16) | 0,00 |

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

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

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | £ 81.941 | $ 103.596 | $ 4.083 | $ 0 | $ 4.083 | 0,41 |
| | 07.2022 | $ 59.395 | DKK 417.497 | 0 | (703) | (703) | (0,07) |
| | 07.2022 | 1.264 | € 1.195 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 07.2022 | 6.966 | NZD 11.177 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK 402.943 | $ 57.430 | 681 | 0 | 681 | 0,07 |
| | 08.2022 | NZD 11.177 | 6.964 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 12.2022 | PEN 21.930 | 5.741 | 56 | 0 | 56 | 0,01 |
| BPS | 07.2022 | CHF 581 | 606 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK 27.565 | 3.910 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| | 07.2022 | € 4.466 | 4.793 | 124 | 0 | 124 | 0,01 |
| | 07.2022 | ¥ 468.500 | 3.472 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 13.589 | DKK 94.360 | 18 | (342) | (324) | (0,03) |
| | 07.2022 | 249.193 | € 236.822 | 0 | (1.606) | (1.606) | (0,16) |
| | 07.2022 | 1.471 | £ 1.168 | 0 | (53) | (53) | (0,01) |
| | 08.2022 | € 208.719 | $ 219.930 | 1.322 | 0 | 1.322 | 0,13 |
| | 10.2022 | $ 911 | PEN 3.719 | 59 | 0 | 59 | 0,01 |
| BRC | 07.2022 | 27.037 | ¥ 3.667.578 | 0 | (41) | (41) | 0,00 |
| | 07.2022 | 11.051 | SEK 112.290 | 0 | (93) | (93) | (0,01) |
| | 08.2022 | ¥ 3.661.622 | $ 27.037 | 40 | 0 | 40 | 0,00 |
| | 08.2022 | SEK 112.197 | 11.051 | 91 | 0 | 91 | 0,01 |
| CBK | 07.2022 | $ 3.257 | DKK 22.890 | 0 | (39) | (39) | 0,00 |
| | 07.2022 | 1.210 | € 1.127 | 0 | (32) | (32) | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | DKK 163.382 | $ 24.194 | 1.226 | 0 | 1.226 | 0,12 |
| GLM | 08.2022 | $ 666 | PEN 2.500 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | NZD 11.177 | $ 7.318 | 368 | 0 | 368 | 0,04 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MBC | 07.2022 | CAD 3.148 | 2.493 | 53 | 0 | 53 | 0,01 |
| | 07.2022 | € 4.575 | 4.776 | 8 | (15) | (7) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 7.711 | AUD 11.197 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07.2022 | 3.328 | DKK 22.300 | 0 | (193) | (193) | (0,02) |
| | 07.2022 | $ 1.189 | € 1.123 | $ 0 | $ (15) | $ (15) | 0,00 |
| | 07.2022 | 1.601 | ¥ 212.600 | 0 | (36) | (36) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD 11.197 | 7.712 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | DKK 564.827 | 83.737 | 4.333 | 0 | 4.333 | 0,44 |
| | 07.2022 | € 1.158 | 1.217 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ 97 | 118 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 16.312 | DKK 113.204 | 0 | (397) | (397) | (0,04) |
| | 07.2022 | 2.127 | £ 1.754 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07.2022 | 5.410 | ¥ 736.601 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK 81.314 | $ 11.580 | 128 | 0 | 128 | 0,01 |
| | 08.2022 | ¥ 735.408 | 5.410 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | SEK 112.444 | 11.506 | 533 | 0 | 533 | 0,05 |
| | 07.2022 | $ 8.692 | DKK 59.455 | 0 | (334) | (334) | (0,03) |
| | 07.2022 | 4.205 | ¥ 572.526 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ 571.598 | $ 4.205 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | € 230.518 | 247.762 | 6.768 | 0 | 6.768 | 0,69 |
| | 07.2022 | $ 98.322 | £ 80.790 | 0 | (206) | (206) | (0,02) |
| | 08.2022 | £ 80.790 | $ 98.367 | 205 | 0 | 205 | 0,02 |
| TOR | 07.2022 | ¥ 5.027.776 | 39.611 | 2.603 | 0 | 2.603 | 0,26 |
| UAG | 07.2022 | AUD 11.197 | 7.998 | 298 | 0 | 298 | 0,03 |
| | 07.2022 | $ 3.717 | DKK 26.015 | 0 | (60) | (60) | (0,01) |
| | | | | $ 23.115 | $ (4.242) | $ 18.873 | 1,92 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | $ 11.136 | CHF 10.649 | $ 8 | $ (20) | $ (12) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CHF 36 | $ 37 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 84 | CHF 80 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | 10.941 | 10.472 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | CHF 10.313 | $ 10.857 | 85 | 0 | 85 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ 10.767 | CHF 10.328 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 08.2022 | 10.857 | 10.296 | 0 | (84) | (84) | (0,01) |
| SCX | 07.2022 | CHF 88 | $ 91 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 204 | CHF 195 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | CHF 1 | $ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 113 | $ (107) | $ 6 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | $ 2.824 | € 2.668 | $ 0 | $ (35) | $ (35) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | € 195.968 | $ 206.122 | 1.249 | 0 | 1.249 | 0,13 |
| | 07.2022 | $ 6.421 | € 6.046 | 0 | (101) | (101) | (0,01) |
| | 08.2022 | 205.770 | 195.280 | 0 | (1.237) | (1.237) | (0,13) |
| CBK | 07.2022 | 1.470 | 1.371 | 0 | (37) | (37) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | € 197.732 | $ 208.021 | 1.303 | 0 | 1.303 | 0,13 |
| | 07.2022 | $ 211.253 | € 195.916 | 1 | (6.435) | (6.434) | (0,66) |
| | 08.2022 | 205.808 | 195.280 | 0 | (1.275) | (1.275) | (0,13) |
| SOG | 07.2022 | 209.633 | 195.043 | 0 | (5.727) | (5.727) | (0,58) |
| UAG | 07.2022 | 179.882 | 167.395 | 0 | (4.880) | (4.880) | (0,50) |
| | | | | $ 2.553 | $ (19.727) | $ (17.174) | (1,75) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | £ 634 | $ 789 | $ 19 | $ 0 | $ 19 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 53.194 | £ 42.071 | 0 | (2.100) | (2.100) | (0,21) |
| BPS | 07.2022 | £ 146 | $ 183 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 985 | £ 800 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | 52.830 | 41.882 | 0 | (1.967) | (1.967) | (0,20) |
| CBK | 07.2022 | 390 | 310 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | £ 48 | $ 59 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 679 | £ 545 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | 59 | 49 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 432 | 351 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SOG | 07.2022 | £ 41.821 | $ 50.897 | $ 107 | $ 0 | $ 107 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ 50.920 | £ 41.821 | 0 | (106) | (106) | (0,01) |
| TOR | 07.2022 | 52.653 | 41.764 | 0 | (1.932) | (1.932) | (0,20) |
| | | | | $ 132 | $ (6.153) | $ (6.021) | (0,61) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **$ (7.474)** | **(0,76)** |
| **Summe Anlagen** | | | | | | **$ 1.175.728** | **119,70** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | | | | | **$ (193.500)** | **(19,70)** |
| **Nettovermögen** | | | | | | **$ 982.228** | **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.

(g) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 195.158 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von USD 13.655 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 15.260 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 1.180.749 | $ 0 | $ 1.180.749 |
| Investmentfonds | 166 | 0 | 0 | 166 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 577 | 0 | 577 |
| Finanzderivate[3] | (4.607) | (1.157) | 0 | (5.764) |
| **Summen** | **$ (4.441)** | **$ 1.180.169** | **$ 0** | **$ 1.175.728** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 1.420.625 | $ 0 | $ 1.420.625 |
| Investmentfonds | 12.363 | 0 | 0 | 12.363 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 1.138 | 0 | 1.138 |
| Finanzderivate[3] | 3.585 | 4.864 | 0 | 8.449 |
| **Summen** | **$ 15.948** | **$ 1.426.627** | **$ 0** | **$ 1.442.575** |

(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 2022:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte(1) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | 1,470 % | 23.06.2022 | 14.07.2022 | $ (2.098) | $ (2.099) | (0,21) |
| | 1,540 | 21.06.2022 | 12.07.2022 | (79.223) | (79.257) | (8,07) |
| CSN | 1,590 | 28.06.2022 | 05.07.2022 | (1.239) | (1.239) | (0,13) |
| | 1,590 | 29.06.2022 | 06.07.2022 | (26.825) | (26.828) | (2,73) |
| | 1,590 | 30.06.2022 | 05.07.2022 | (3.834) | (3.834) | (0,39) |
| | 1,600 | 28.06.2022 | 05.07.2022 | (82.799) | (82.810) | (8,43) |
| **Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte** | | | | | **$ (196.067)** | **(19,96)** |

(1) In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 60 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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 1.973 | $ (1.830) | $ 143 |
| BPS | (1.954) | 1.720 | (234) |
| BRC | (2.260) | 2.150 | (110) |
| CBK | (115) | 220 | 105 |
| DUB | 804 | (480) | 324 |
| GLM | (25) | 0 | (25) |
| JPM | (90) | 140 | 50 |
| MBC | (6,621) | 6.030 | (591) |
| MYC | (453) | 400 | (53) |
| MYI | 4.075 | (3.940) | 135 |
| SAL | (70) | 260 | 190 |
| SCX | 193 | 0 | 193 |
| SOG | 1.041 | (1.080) | (39) |
| TOR | 671 | (870) | (199) |
| UAG | (4.643) | 4.170 | (473) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 107,34 | 106,67 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 12,41 | 11,25 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 0,46 | 0,56 |
| Investmentfonds | 0,02 | 1,03 |
| Pensionsgeschäfte | 0,06 | 0,09 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,39) | 0,19 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,56 | (0,15) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (0,76) | 0,67 |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (19,96) | (20,92) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Australien | 0,86 | 0,99 |
| Kanada | 0,23 | 0,20 |
| Cayman-Inseln | 0,83 | 0,19 |
| Dänemark | 6,96 | 9,55 |
| Frankreich | 7,87 | 9,96 |
| Deutschland | 1,77 | k. A. |
| Guernsey, Kanalinseln | 0,06 | 0,05 |
| Irland | 2,42 | 1,32 |
| Italien | 9,33 | 9,33 |
| Japan | 3,76 | 5,09 |
| Luxemburg | 0,01 | 0,01 |
| Niederlande | 0,29 | 0,35 |
| Neuseeland | 0,70 | 0,65 |
| Peru | 0,25 | 0,28 |
| Slowenien | 0,06 | 0,06 |
| Spanien | 0,52 | 1,79 |
| Schweden | 1,14 | 1,05 |
| Großbritannien | 10,08 | 11,18 |
| USA | 73,06 | 66,43 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,01 | k. A. |
| Investmentfonds | 0,02 | 1,03 |
| Pensionsgeschäfte | 0,06 | 0,09 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,39) | 0,19 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,00 | 0,00 |
| Zinsswaps | 0,56 | (0,15) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoptionen | 0,71 | 0,19 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | k. A. | 0,00 |
| Inflation-Capped Options | 0,00 | 0,00 |
| Zinsswapoptionen | (1,02) | (0,22) |
| Optionen auf Wertpapiere | (0,01) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | 0,00 | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | 1,92 | (0,17) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (2,36) | 0,87 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (19,70) | (20,31) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Australia Government International Bond** | | | | |
| 0,250 % fällig am 21.11.2032 | AUD | 17.628 | $ 10.668 | 0,38 |
| 0,750 % fällig am 21.11.2027 | | 18.135 | 12.405 | 0,44 |
| 2,000 % fällig am 21.08.2035 | | 4.560 | 3.293 | 0,12 |
| 3,000 % fällig am 20.09.2025 | | 27.498 | 20.716 | 0,74 |
| Summe Australien | | | 47.082 | 1,68 |
| **BELGIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Belgium Government International Bond** | | | | |
| 1,400 % fällig am 22.06.2053 | € | 2.500 | 1.923 | 0,07 |
| **KANADA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Canadian Government Real Return Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.12.2050 (c) | CAD | 8.873 | 5.484 | 0,20 |
| 1,250 % fällig am 01.12.2047 (c) | | 11.273 | 8.443 | 0,30 |
| 1,500 % fällig am 01.12.2044 (c) | | 10.417 | 8.204 | 0,29 |
| 3,000 % fällig am 01.12.2036 (c) | | 4.072 | 3.859 | 0,14 |
| 4,000 % fällig am 01.12.2031 (c) | | 12.292 | 12.003 | 0,43 |
| Summe Kanada | | | 37.993 | 1,36 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Catamaran CLO Ltd.** | | | | |
| 2,236 % fällig am 22.04.2030 | $ | 7.362 | 7.266 | 0,26 |
| **Denali Capital CLO Ltd.** | | | | |
| 2,094 % fällig am 15.04.2031 | | 499 | 490 | 0,02 |
| **Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.** | | | | |
| 2,504 % fällig am 15.09.2037 | | 10.500 | 10.356 | 0,37 |
| **Magnetite Ltd.** | | | | |
| 2,024 % fällig am 15.04.2031 | | 600 | 593 | 0,02 |
| **Mountain View CLO LLC** | | | | |
| 2,134 % fällig am 16.10.2029 | | 874 | 863 | 0,03 |
| **OZLM Ltd.** | | | | |
| 2,441 % fällig am 16.05.2030 | | 6.100 | 5.996 | 0,22 |
| **Starwood Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 2,528 % fällig am 15.07.2038 | | 4.244 | 4.212 | 0,15 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | |
| 1,924 % fällig am 15.07.2027 | | 289 | 289 | 0,01 |
| 2,163 % fällig am 20.01.2029 | | 3.191 | 3.160 | 0,11 |
| 2,401 % fällig am 07.09.2030 | | 1.200 | 1.184 | 0,04 |
| **Voya CLO Ltd.** | | | | |
| 1,944 % fällig am 18.01.2029 | | 2.354 | 2.322 | 0,08 |
| | | | 36.731 | 1,31 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2023 | | 58 | 58 | 0,01 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.08.2022 | | 41 | 41 | 0,00 |
| | | | 99 | 0,01 |
| Summe Cayman Inseln | | | 36.830 | 1,32 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **DLR Kredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 3.469 | 385 | 0,01 |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 6.772 | 715 | 0,03 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 103.254 | 10.647 | 0,38 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 4.252 | 483 | 0,02 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 15.374 | 1.741 | 0,06 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 4 | 0 | 0,00 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.10.2043 | | 29.574 | 3.382 | 0,12 |
| 0,500 % fällig am 01.10.2053 | | 101.511 | 10.424 | 0,37 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 8.438 | 911 | 0,03 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 134.562 | 15.110 | 0,54 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 16 | 2 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.10.2053 | DKK | 88.066 | $ 9.023 | 0,32 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 253.063 | 26.490 | 0,95 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 298.180 | 31.632 | 1,13 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 212.487 | 23.844 | 0,85 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2053 | | 49.598 | 5.895 | 0,21 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 3 | 0 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2053 | | 12.100 | 1.590 | 0,06 |
| 3,500 % fällig am 01.10.2053 | | 87.800 | 11.915 | 0,43 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 31.529 | 3.411 | 0,12 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 61.647 | 6.487 | 0,23 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 51.331 | 5.826 | 0,21 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 121.547 | 13.580 | 0,49 |
| 2,500 % fällig am 01.04.2047 | | 9 | 1 | 0,00 |
| | | | 183.494 | 6,56 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Denmark Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.11.2023 (c) | | 104.236 | 15.317 | 0,55 |
| Summe Dänemark | | | 198.811 | 7,11 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **France Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 01.03.2025 (c) | € | 31.847 | 35.127 | 1,26 |
| 0,100 % fällig am 01.03.2026 (c) | | 51.959 | 57.657 | 2,06 |
| 0,100 % fällig am 01.03.2028 (c) | | 37.686 | 41.848 | 1,50 |
| 0,100 % fällig am 01.03.2029 (c)(e) | | 7.717 | 8.509 | 0,30 |
| 0,100 % fällig am 25.07.2031 (c) | | 49.307 | 53.854 | 1,92 |
| 0,100 % fällig am 01.03.2032 (c) | | 8.044 | 8.862 | 0,32 |
| 0,100 % fällig am 25.07.2036 (c) | | 13.778 | 14.473 | 0,52 |
| 0,100 % fällig am 25.07.2038 (c) | | 10.037 | 10.438 | 0,37 |
| 0,250 % fällig am 25.07.2024 (c) | | 18.662 | 20.883 | 0,75 |
| 0,500 % fällig am 25.05.2029 | | 19.500 | 18.962 | 0,68 |
| 0,700 % fällig am 25.07.2030 (c) | | 17.258 | 19.948 | 0,71 |
| 1,850 % fällig am 25.07.2027 (c) | | 12.979 | 15.685 | 0,56 |
| Summe Frankreich | | | 306.246 | 10,95 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.04.2046 (c) | | 3 | 4 | 0,00 |
| **GUERNSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.09.2022 | $ | 2.400 | 2.402 | 0,09 |
| **IRLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Adagio CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.10.2031 | € | 1.700 | 1.743 | 0,06 |
| **Ares European CLO** | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.10.2030 | | 7.387 | 7.583 | 0,27 |
| **Ares European CLO DAC** | | | | |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | | 2.200 | 2.249 | 0,08 |
| 0,850 % fällig am 20.04.2032 | | 600 | 611 | 0,02 |
| **Armada Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.07.2031 | | 4.400 | 4.482 | 0,16 |
| **Black Diamond CLO DAC** | | | | |
| 0,980 % fällig am 15.05.2032 | | 7.400 | 7.560 | 0,27 |
| **Cairn CLO DAC** | | | | |
| 0,600 % fällig am 30.04.2031 | | 3.498 | 3.609 | 0,13 |
| 0,650 % fällig am 20.10.2028 | | 1.022 | 1.062 | 0,04 |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | | 4.500 | 4.585 | 0,16 |
| **Carlyle Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 15.08.2030 | | 3.192 | 3.272 | 0,12 |
| 0,700 % fällig am 15.01.2031 | | 4.100 | 4.188 | 0,15 |
| 0,890 % fällig am 15.08.2032 | | 5.400 | 5.477 | 0,20 |
| **Contego CLO DAC** | | | | |
| 0,640 % fällig am 23.01.2030 | | 1.099 | 1.129 | 0,04 |
| **CVC Cordatus Loan Fund DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 15.09.2031 | | 2.800 | 2.862 | 0,10 |
| **Dryden Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.04.2033 | € | 4.200 | $ 4.260 | 0,15 |
| 0,860 % fällig am 15.05.2034 | | 2.500 | 2.529 | 0,09 |
| **Euro-Galaxy CLO DAC** | | | | |
| 0,620 % fällig am 24.04.2034 | | 5.600 | 5.707 | 0,20 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | | 1.072 | 1.117 | 0,04 |
| 0,680 % fällig am 20.10.2031 | | 2.200 | 2.245 | 0,08 |
| 0,760 % fällig am 15.07.2031 | | 7.400 | 7.450 | 0,27 |
| 1,040 % fällig am 15.07.2031 | | 1.000 | 991 | 0,04 |
| **Jubilee CLO DAC** | | | | |
| 0,519 % fällig am 15.12.2029 | | 547 | 566 | 0,02 |
| 0,600 % fällig am 15.04.2030 | | 600 | 618 | 0,02 |
| 0,650 % fällig am 15.04.2031 | | 1.700 | 1.738 | 0,06 |
| **Laurelin DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 20.10.2031 | | 3.800 | 3.893 | 0,14 |
| **Madison Park Euro Funding DAC** | | | | |
| 0,800 % fällig am 15.07.2032 | | 7.300 | 7.398 | 0,27 |
| **Man GLG Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,680 % fällig am 15.10.2030 | | 3.586 | 3.672 | 0,13 |
| 0,870 % fällig am 15.01.2030 | | 578 | 598 | 0,02 |
| **Oak Hill European Credit Partners DAC** | | | | |
| 0,740 % fällig am 20.10.2031 | | 1.900 | 1.934 | 0,07 |
| **OCP Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,880 % fällig am 22.09.2034 | | 7.300 | 7.388 | 0,27 |
| **Purple Finance CLO DAC** | | | | |
| 0,800 % fällig am 25.01.2031 | | 1.699 | 1.746 | 0,06 |
| **Segovia European CLO DAC** | | | | |
| 0,770 % fällig am 18.01.2031 | | 999 | 1.027 | 0,04 |
| 0,880 % fällig am 20.07.2032 | | 6.400 | 6.503 | 0,23 |
| **Tikehau CLO BV** | | | | |
| 0,870 % fällig am 04.08.2034 | | 3.500 | 3.567 | 0,13 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | |
| 0,810 % fällig am 15.02.2034 | | 10.300 | 10.407 | 0,37 |
| | | | 125.766 | 4,50 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **European Loan Conduit DAC** | | | | |
| 1,000 % fällig am 17.02.2030 | | 2.488 | 2.567 | 0,09 |
| Summe Irland | | | 128.333 | 4,59 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.05.2033 (c) | | 15.971 | 14.470 | 0,52 |
| 0,400 % fällig am 15.05.2030 (c) | | 46.779 | 46.621 | 1,67 |
| 0,450 % fällig am 22.05.2023 (c) | | 15.829 | 17.219 | 0,62 |
| 1,250 % fällig am 15.09.2032 (c) | | 8.695 | 9.069 | 0,32 |
| 1,300 % fällig am 15.05.2028 (c)(e) | | 54.790 | 59.689 | 2,13 |
| 1,400 % fällig am 26.05.2025 (c) | | 66.612 | 72.590 | 2,59 |
| 2,550 % fällig am 15.09.2041 (c) | | 15.929 | 19.658 | 0,70 |
| Summe Italien | | | 239.316 | 8,55 |
| **JAPAN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Japan Government International Bond** | | | | |
| 0,005 % fällig am 10.03.2031 (c) | ¥ | 931.349 | 7.253 | 0,26 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2025 (c) | | 351.900 | 2.673 | 0,10 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2026 (c) | | 3.424.913 | 26.408 | 0,94 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2028 (c) | | 4.475.877 | 34.626 | 1,24 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2029 (c) | | 2.537.809 | 19.670 | 0,70 |
| Summe Japan | | | 90.630 | 3,24 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **SES S.A.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 04.04.2023 | $ | 500 | 495 | 0,02 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Grosvenor Place CLO BV** | | | | |
| 0,720 % fällig am 30.10.2029 | € | 1.057 | 1.101 | 0,04 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ING Bank NV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.12.2022 | $ | 3.200 | $ 3.198 | 0,11 |
| Summe Niederlande | | | 4.299 | 0,15 |
| **NEUSEELAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **New Zealand Government International Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 20.09.2025 | NZD | 64.304 | 40.917 | 1,46 |
| 3,000 % fällig am 20.09.2030 | | 50 | 34 | 0,00 |
| Summe Neuseeland | | | 40.951 | 1,46 |
| **PERU** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | PEN | 7.900 | 1.900 | 0,07 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 11.700 | 2.724 | 0,09 |
| Summe Peru | | | 4.624 | 0,16 |
| **SLOWENIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Nova Ljubljanska Banka d.d.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 05.02.2030 | € | 1.100 | 1.012 | 0,04 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **BBVA Consumer Auto** | | | | |
| 0,270 % fällig am 20.07.2031 | | 1.330 | 1.370 | 0,05 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Spain Government International Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 31.10.2031 | | 600 | 529 | 0,02 |
| 0,700 % fällig am 30.11.2033 (c) | | 16.536 | 17.663 | 0,63 |
| 1,000 % fällig am 30.11.2030 (c) | | 2.585 | 2.894 | 0,10 |
| 1,450 % fällig am 31.10.2027 | | 13.400 | 13.763 | 0,49 |
| 1,450 % fällig am 30.04.2029 | | 5.700 | 5.754 | 0,21 |
| 2,550 % fällig am 31.10.2032 | | 2.500 | 2.614 | 0,09 |
| | | | 43.217 | 1,54 |
| Summe Spanien | | | 44.587 | 1,59 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Sweden Government International Bond** | | | | |
| 0,125 % fällig am 01.06.2026 | SEK | 104.171 | 10.754 | 0,38 |
| 0,125 % fällig am 01.12.2027 | | 15.133 | 1.589 | 0,06 |
| 0,125 % fällig am 01.06.2032 | | 51.703 | 5.737 | 0,21 |
| 1,000 % fällig am 01.06.2025 | | 116.233 | 12.138 | 0,43 |
| Summe Schweden | | | 30.218 | 1,08 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 3,747 % fällig am 25.06.2024 | $ | 2.200 | 2.203 | 0,08 |
| 4,519 % fällig am 25.06.2024 | | 1.400 | 1.397 | 0,05 |
| | | | 3.600 | 0,13 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Canada Square Funding PLC** | | | | |
| 1,550 % fällig am 17.10.2051 | £ | 4.238 | 5.143 | 0,18 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | |
| 1,795 % fällig am 16.09.2069 | | 1.949 | 2.365 | 0,09 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 1,048 % fällig am 18.06.2038 | | 44 | 52 | 0,00 |
| 1,743 % fällig am 18.03.2039 | | 50 | 60 | 0,00 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | | |
| 1,703 % fällig am 25.05.2053 | | 8.123 | 9.847 | 0,35 |
| **Polaris PLC** | | | | |
| 1,740 % fällig am 23.10.2059 | | 11.167 | 13.380 | 0,48 |
| **Precise Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,952 % fällig am 12.12.2055 | | 3.037 | 3.670 | 0,13 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,605 % fällig am 20.10.2051 | | 3.923 | 4.750 | 0,17 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | |
| 1,902 % fällig am 12.06.2053 | | 5.705 | 6.931 | 0,25 |
| | | | 46.198 | 1,65 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 0,125 % fällig am 10.08.2028 (c) | £ | 28.847 | $ 38.952 | 1,39 |
| 0,125 % fällig am 10.08.2031 (c) | | 61.244 | 86.036 | 3,08 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2039 (c) | | 2.028 | 2.956 | 0,11 |
| 0,125 % fällig am 10.08.2041 (c) | | 12.314 | 18.305 | 0,65 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2044 (c) | | 8.549 | 12.696 | 0,45 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2046 (c) | | 6.353 | 9.509 | 0,34 |
| 0,125 % fällig am 10.08.2048 (c) | | 1.496 | 2.263 | 0,08 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2051 (c) | | 15.898 | 24.282 | 0,87 |
| 0,125 % fällig am 22.11.2056 (c) | | 9.904 | 15.594 | 0,56 |
| 0,125 % fällig am 22.11.2065 (c) | | 8.790 | 14.849 | 0,53 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2068 (c) | | 14.724 | 25.708 | 0,92 |
| 0,250 % fällig am 22.03.2052 (c) | | 5.561 | 8.828 | 0,32 |
| 0,375 % fällig am 22.10.2026 | | 26.900 | 30.537 | 1,09 |
| 0,375 % fällig am 22.03.2062 (c) | | 25.681 | 45.206 | 1,62 |
| 0,500 % fällig am 22.03.2050 (c) | | 19.546 | 32.528 | 1,16 |
| 0,500 % fällig am 22.10.2061 | | 24.500 | 15.329 | 0,55 |
| 0,625 % fällig am 22.03.2040 (c) | | 8.274 | 13.131 | 0,47 |
| 0,625 % fällig am 22.11.2042 (c) | | 4.092 | 6.659 | 0,24 |
| 0,625 % fällig am 22.10.2050 | | 56.800 | 42.080 | 1,50 |
| 0,750 % fällig am 22.03.2034 (c) | | 33.966 | 51.475 | 1,84 |
| 0,750 % fällig am 22.11.2047 (c) | | 10.424 | 17.935 | 0,64 |
| 1,250 % fällig am 22.11.2027 (c) | | 1.202 | 1.703 | 0,06 |
| 1,250 % fällig am 22.11.2032 (c) | | 102.078 | 159.929 | 5,72 |
| 1,250 % fällig am 22.11.2055 (c) | | 21.532 | 44.814 | 1,60 |
| 1,500 % fällig am 22.07.2047 | | 3.900 | 3.756 | 0,13 |
| 2,500 % fällig am 17.07.2024 | | 11.907 | 16.846 | 0,60 |
| 4,125 % fällig am 22.07.2030 | | 7.196 | 13.555 | 0,49 |
| | | | 755.461 | 27,01 |
| Summe Großbritannien | | | 805.259 | 28,79 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,884 % fällig am 25.09.2036 | $ | 1.966 | 1.928 | 0,07 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,674 % fällig am 25.12.2033 | | 1.346 | 1.297 | 0,05 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,584 % fällig am 25.10.2035 | | 1.678 | 1.598 | 0,06 |
| **AMRESCO Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.06.2029 | | 9 | 8 | 0,00 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.10.2036 | | 7.141 | 6.645 | 0,24 |
| 2,224 % fällig am 25.10.2034 | | 919 | 917 | 0,03 |
| **Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,674 % fällig am 15.04.2033 | | 231 | 224 | 0,01 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,824 % fällig am 25.12.2036 | | 26 | 26 | 0,00 |
| 2,599 % fällig am 25.05.2035 | | 354 | 351 | 0,01 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,874 % fällig am 25.04.2036 | | 12.546 | 10.911 | 0,39 |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,974 % fällig am 25.10.2037 | | 211 | 210 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,914 % fällig am 25.09.2036 | | 539 | 526 | 0,02 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,569 % fällig am 25.10.2034 | | 1.045 | 1.019 | 0,04 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 2,029 % fällig am 25.08.2036 | | 152 | 152 | 0,01 |
| 2,314 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 3.100 | 2.913 | 0,10 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 2,419 % fällig am 25.02.2036 | | 71 | 71 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.02.2036 | | 8.691 | 8.533 | 0,31 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 2,244 % fällig am 25.01.2032 | | 1 | 1 | 0,00 |
| **Ellington Loan Acquisition Trust** | | | | |
| 2,724 % fällig am 25.05.2037 | | 914 | 886 | 0,03 |
| **Encore Credit Receivables Trust** | | | | |
| 2,524 % fällig am 25.01.2036 | | 1.400 | 1.329 | 0,05 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,934 % fällig am 25.07.2036 | | 1.017 | 972 | 0,04 |
| 2,494 % fällig am 25.09.2035 | | 1.809 | 1.787 | 0,06 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 2,479 % fällig am 25.08.2034 | | 64 | 63 | 0,00 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | |
| 2,264 % fällig am 25.03.2036 | $ | 3.233 | $ 3.199 | 0,11 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.05.2037 | | 412 | 409 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 2,774 % fällig am 25.12.2037 | | 1.958 | 2.010 | 0,07 |
| **Massachusetts Educational Financing Authority** | | | | |
| 2,134 % fällig am 25.04.2038 | | 53 | 54 | 0,00 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 2,284 % fällig am 25.01.2035 | | 1.867 | 1.812 | 0,07 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,344 % fällig am 25.10.2035 | | 980 | 961 | 0,03 |
| 2,389 % fällig am 25.02.2035 | | 2.171 | 2.079 | 0,07 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,059 % fällig am 25.03.2036 | | 920 | 902 | 0,03 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,419 % fällig am 25.07.2035 | | 74 | 74 | 0,00 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | | |
| 1,934 % fällig am 25.09.2037 | | 1.011 | 971 | 0,04 |
| 2,344 % fällig am 25.05.2035 | | 4.097 | 3.950 | 0,14 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 2,684 % fällig am 25.04.2023 | | 97 | 97 | 0,00 |
| | | | 58.885 | 2,10 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Eversource Energy** | | | | |
| 2,900 % fällig am 01.10.2024 | | 100 | 98 | 0,00 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 3,550 % fällig am 07.10.2022 | | 2.100 | 2.093 | 0,07 |
| **Lehman Brothers Holdings, Inc.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 05.03.2010 ^ | € | 950 | 6 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 05.04.2011 ^ | | 10 | 0 | 0,00 |
| **Nissan Motor Acceptance Co. LLC** | | | | |
| 2,600 % fällig am 28.09.2022 | $ | 500 | 497 | 0,02 |
| 2,650 % fällig am 13.07.2022 | | 1.900 | 1.900 | 0,07 |
| **RELX Capital, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 16.03.2023 | | 200 | 200 | 0,01 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.04.2023 | | 1.000 | 1.010 | 0,04 |
| | | | 5.804 | 0,21 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 3,266 % fällig am 20.01.2047 | | 1.166 | 1.053 | 0,04 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 3,074 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 62 | 41 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,396 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 239 | 218 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 3,440 % fällig am 25.09.2035 | | 3 | 3 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.08.2034 | | 492 | 461 | 0,02 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 | | 926 | 843 | 0,03 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,643 % fällig am 20.11.2034 | | 2 | 2 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | | |
| 1,506 % fällig am 30.11.2037 | | 1.200 | 1.093 | 0,04 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,192 % fällig am 19.10.2045 | | 2.620 | 2.286 | 0,08 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,064 % fällig am 25.06.2045 | | 84 | 78 | 0,00 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,938 % fällig am 25.09.2035 | | 54 | 53 | 0,00 |
| **Impac CMB Trust** | | | | |
| 2,264 % fällig am 25.03.2035 | | 1.335 | 1.255 | 0,04 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | | |
| 2,808 % fällig am 25.07.2035 | | 193 | 186 | 0,01 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.11.2035 | | 301 | 300 | 0,01 |
| **Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,184 % fällig am 15.08.2032 | | 170 | 157 | 0,01 |
| 2,610 % fällig am 20.10.2029 | | 12 | 11 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | |
| 2,314 % fällig am 25.08.2036 | $ 3.768 | $ 3.654 | 0,13 |
| **OBX Trust** | | | |
| 2,274 % fällig am 25.06.2057 | 203 | 199 | 0,01 |
| **Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 3,424 % fällig am 25.04.2035 | 820 | 802 | 0,03 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | |
| 2,295 % fällig am 19.10.2026 | 6 | 6 | 0,00 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,873 % fällig am 25.09.2034 | 362 | 351 | 0,01 |
| 3,463 % fällig am 25.08.2047 | 1.985 | 1.877 | 0,07 |
| **Structured Asset Securities Corp.** | | | |
| 1,974 % fällig am 25.03.2035 | 213 | 202 | 0,01 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 2,164 % fällig am 25.12.2045 | 24 | 23 | 0,00 |
| 2,184 % fällig am 25.11.2045 | 728 | 662 | 0,02 |
| | | 15.816 | 0,57 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae** | | | |
| 1,524 % fällig am 01.09.2044 | 24 | 24 | 0,00 |
| 2,633 % fällig am 01.12.2030 | 1 | 1 | 0,00 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 1,676 % fällig am 25.10.2044 | 247 | 254 | 0,01 |
| 1,756 % fällig am 01.09.2036 | 21 | 21 | 0,00 |
| 1,884 % fällig am 25.08.2031 | 5 | 5 | 0,00 |
| 1,904 % fällig am 25.09.2031 | 8 | 8 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 15.12.2037 | 145 | 146 | 0,01 |
| 1,927 % fällig am 01.10.2036 | 29 | 29 | 0,00 |
| 2,294 % fällig am 01.07.2036 | 58 | 60 | 0,00 |
| **Ginnie Mae** | | | |
| 0,382 % fällig am 20.08.2068 | 2.009 | 1.961 | 0,07 |
| 1,875 % fällig am 20.04.2030 | 3 | 3 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 20.05.2030 | 3 | 2 | 0,00 |
| 2,375 % fällig am 20.05.2030 | 27 | 27 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 | $ 1.500 | $ 1.349 | 0,05 |
| 3,000 % fällig am 01.08.2052 | 37.000 | 34.433 | 1,23 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2052 | 23.900 | 22.965 | 0,82 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 21.100 | 20.813 | 0,75 |
| | | 82.101 | 2,94 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | |
| 1,625 % fällig am 15.11.2050 (e) | 11.070 | 7.791 | 0,28 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c)** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.01.2023 (e) | 68.220 | 69.375 | 2,48 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2024 | 26.782 | 27.043 | 0,97 |
| 0,125 % fällig am 15.10.2024 | 25.011 | 25.170 | 0,90 |
| 0,125 % fällig am 15.04.2025 (e) | 93.106 | 93.177 | 3,33 |
| 0,125 % fällig am 15.10.2025 | 23.840 | 23.829 | 0,85 |
| 0,125 % fällig am 15.04.2026 | 37.133 | 36.800 | 1,32 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2026 | 35.791 | 35.515 | 1,27 |
| 0,125 % fällig am 15.10.2026 (e) | 41.889 | 41.525 | 1,48 |
| 0,125 % fällig am 15.04.2027 | 15.459 | 15.227 | 0,54 |
| 0,125 % fällig am 15.01.2030 (e) | 93.699 | 89.502 | 3,20 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2030 | 24.803 | 23.672 | 0,85 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2031 (e) | 216.872 | 206.384 | 7,39 |
| 0,125 % fällig am 15.01.2032 | 54.328 | 51.617 | 1,85 |
| 0,125 % fällig am 15.02.2051 | 18.219 | 14.064 | 0,50 |
| 0,125 % fällig am 15.02.2052 | 11.007 | 8.565 | 0,31 |
| 0,250 % fällig am 15.07.2029 (e) | 69.773 | 67.701 | 2,42 |
| 0,250 % fällig am 15.02.2050 (e) | 14.841 | 11.742 | 0,42 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2023 | 5.217 | 5.309 | 0,19 |
| 0,375 % fällig am 15.01.2027 | 23.645 | 23.568 | 0,84 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2027 | 15.267 | 15.219 | 0,54 |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028 | 17.142 | 17.034 | 0,61 |
| 0,625 % fällig am 15.04.2023 (e) | 66.774 | 67.919 | 2,43 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2024 | 8.019 | 8.157 | 0,29 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2026 | 10.754 | 10.878 | 0,39 |
| 0,625 % fällig am 15.02.2043 (e) | 13.553 | 11.997 | 0,43 |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 | 37.955 | 38.249 | 1,37 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| 0,750 % fällig am 15.02.2042 | $ 19.316 | $ 17.679 | 0,63 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2045 | 33.376 | 29.942 | 1,07 |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 | 1.855 | 1.873 | 0,07 |
| 0,875 % fällig am 15.02.2047 | 2.275 | 2.106 | 0,07 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2046 | 41.953 | 39.832 | 1,42 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2048 | 5.633 | 5.389 | 0,19 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2049 | 15.737 | 15.177 | 0,54 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 | 41.884 | 42.915 | 1,53 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 | 16.562 | 17.546 | 0,63 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2040 | 17.840 | 20.855 | 0,75 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2041 (e) | 48.798 | 56.779 | 2,03 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 | 25.747 | 27.289 | 0,98 |
| 3,625 % fällig am 15.04.2028 (e) | 52.509 | 61.361 | 2,19 |
| | | 1.385.772 | 49,55 |
| Summe USA | | 1.548.378 | 55,37 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | |
| 51,049 % fällig am 30.09.2022 (a)(b) | ARS 61.100 | 205 | 0,01 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 205 | 0,01 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | **$ 3.569.598** | **127,63** |
| | **AKTIEN** | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)** | 6.564.197 | 65.301 | 2,33 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$ 65.301** | **2,33** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 1.506 | U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | $ (1.536) | $ 1.506 | $ 1.506 | 0,05 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (1.536)** | **$ 1.506** | **$ 1.506** | **0,05** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month Euribor March Futures | Long | 03.2023 | 1.299 | $ (6.069) | (0,22) |
| 3-Month SOFR December Futures | Long | 03.2023 | 1.495 | 316 | 0,01 |
| 3-Month SOFR March Futures | Short | 06.2023 | 1.495 | (430) | (0,01) |
| Australia Government 3-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 205 | (7) | 0,00 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 79 | 43 | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 144.500 EUR auf Euro-Bund August 2022 Futures(1) | Short | 07.2022 | 223 | (570) | (0,02) |
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09.2022 | 1.142 | (465) | (0,02) |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09.2022 | 1.219 | (1.749) | (0,06) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 504 | 1.197 | 0,04 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 59 | 435 | 0,02 |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 155 | 229 | 0,01 |
| Euro-Schatz September Futures | Short | 09.2022 | 1.876 | 280 | 0,01 |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 204 | (175) | (0,01) |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 144.500 EUR auf August 2022 Futures(1) | Short | 07.2022 | 223 | 331 | 0,01 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 228 | (178) | (0,01) |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 1.672 | (793) | (0,03) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 1.126 | 980 | 0,04 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2022 | 1.323 | 1.651 | 0,06 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 5 | (14) | 0,00 |

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2022 | 123 | $ 697 | 0,03 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09.2022 | 977 | 5.076 | 0,18 |
| | | | | $ 785 | 0,03 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 785** | **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 |
|---|---|---|---|---|---|
| Barclays Bank PLC | 1,000 % | 20.12.2022 | € 2.700 | $ (12) | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2023 | $ 800 | 48 | 0,00 |
| | | | | $ 36 | 0,00 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 % | 21.09.2032 | £ 27.900 | $ 4.019 | 0,14 |
| Zahlung[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2052 | 16.800 | (2.145) | (0,08) |
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 1,600 | 18.05.2032 | 26.500 | (1.855) | (0,07) |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 16.06.2029 | ¥ 10.717.000 | (298) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,435 | 20.06.2029 | 3.683.000 | (177) | (0,01) |
| Erhalt[3] | 3-Month USD-LIBOR | 1,840 | 21.11.2028 | $ 36.400 | 1.831 | 0,07 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,880 | 25.01.2052 | 13.400 | (2.646) | (0,09) |
| Zahlung[3] | 3-Month USD-LIBOR | 1,888 | 21.11.2053 | 7.400 | (1.416) | (0,05) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | € 84.300 | 6.985 | 0,25 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2024 | 15.700 | 311 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 12.04.2027 | 16.300 | (750) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 11.05.2027 | 14.400 | (664) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,700 | 11.04.2027 | 9.500 | (418) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 13.05.2027 | 12.100 | (393) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.05.2027 | 2.700 | (88) | 0,00 |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,710 | 15.03.2033 | 5.900 | 1.303 | 0,05 |
| Zahlung | CPTFEMU | 2,455 | 15.06.2032 | 7.500 | 40 | 0,00 |
| Zahlung | CPTFEMU | 2,550 | 15.04.2052 | 3.400 | 73 | 0,00 |
| Erhalt | CPTFEMU | 2,570 | 15.06.2032 | 10.900 | (129) | 0,00 |
| Erhalt | CPTFEMU | 2,600 | 15.05.2032 | 20.300 | (199) | (0,01) |
| Erhalt | CPTFEMU | 2,720 | 15.06.2032 | 71.100 | (2.308) | (0,08) |
| Zahlung | CPURNSA | 1,760 | 04.11.2029 | $ 23.300 | (3.302) | (0,12) |
| Zahlung | CPURNSA | 1,883 | 20.11.2029 | 300 | (40) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,954 | 03.06.2029 | 6.200 | (766) | (0,03) |
| Zahlung | CPURNSA | 1,998 | 25.07.2029 | 1.800 | (211) | (0,01) |
| Erhalt | CPURNSA | 2,210 | 05.02.2023 | 21.840 | 1.974 | 0,07 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,263 | 09.05.2023 | 6.846 | 578 | 0,02 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,311 | 24.02.2031 | 6.500 | 629 | 0,02 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,314 | 26.02.2026 | 14.400 | 1.416 | 0,05 |
| Zahlung | CPURNSA | 2,364 | 10.05.2028 | 800 | (63) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 2,370 | 06.06.2028 | 12.900 | (1.028) | (0,04) |
| Zahlung | CPURNSA | 2,379 | 09.07.2028 | 700 | (54) | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,500 | 15.07.2022 | 38.000 | 5.022 | 0,18 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,573 | 26.08.2028 | 2.200 | 119 | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,645 | 10.09.2028 | 3.600 | 166 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,690 | 01.06.2026 | 2.300 | 171 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,703 | 25.05.2026 | 8.980 | 666 | 0,02 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,768 | 13.05.2026 | 13.900 | 1.003 | 0,04 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,813 | 14.05.2026 | 20.100 | 1.403 | 0,05 |
| Erhalt | UKRPI | 4,140 | 15.10.2031 | £ 35.400 | 532 | 0,02 |
| Erhalt | UKRPI | 4,250 | 15.11.2031 | 17.860 | 214 | 0,01 |
| Erhalt | UKRPI | 5,200 | 15.06.2024 | 5.500 | 19 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 5,330 | 15.06.2024 | 11.900 | 3 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 6,290 | 15.03.2024 | 5.500 | 143 | 0,01 |
| Erhalt | UKRPI | 6,440 | 15.05.2024 | 2.200 | 20 | 0,00 |
| Zahlung | UKRPI | 6,500 | 15.03.2024 | 61.500 | (1.269) | (0,05) |
| Erhalt | UKRPI | 6,600 | 15.05.2024 | 5.400 | 26 | 0,00 |
| | | | | | $ 8.447 | 0,30 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 8.483** | **0,30** |

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

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

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

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

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

## OPTIONSKAUF

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,195 % | 02.11.2022 | 7.350 | $ 5 | $ 3.136 | 0,11 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,197 | 04.11.2022 | 8.440 | 642 | 3.597 | 0,13 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,000 | 15.03.2023 | 4.500 | 505 | 2.124 | 0,07 |
| BRC | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,410 | 02.02.2023 | 179.700 | 898 | 152 | 0,01 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,197 | 04.11.2022 | 4.360 | 326 | 1.858 | 0,07 |
| CBK | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,720 | 23.02.2023 | 27.800 | 153 | 47 | 0,00 |
| DUB | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,237 | 17.11.2023 | 27.000 | 1.676 | 4.246 | 0,15 |
| GLM | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,200 | 26.04.2023 | 29.200 | 312 | 295 | 0,01 |
| JPM | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,710 | 25.01.2023 | 29.500 | 180 | 39 | 0,00 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,000 | 15.03.2023 | 5.900 | 650 | 2.785 | 0,10 |
| MYC | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,428 | 31.01.2023 | 179.200 | 916 | 152 | 0,01 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,190 | 02.11.2022 | 7.000 | 510 | 2.995 | 0,11 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,200 | 31.05.2023 | 85.000 | 1.020 | 953 | 0,03 |
| | | | | | | | $ 7.793 | $ 22.379 | 0,80 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### INFLATION-CAPPED OPTIONS

| Kontrahent | Beschreibung | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfalls-datum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | Cap - OTC CPALEMU | $ 100,151 | Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0 | 22.06.2035 | 7.800 | $ (356) | $ (112) | 0,00 |
| JPM | Cap - OTC CPURNSA | 233,916 | Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0 | 22.04.2024 | 37.600 | (273) | (2) | 0,00 |
| | Cap - OTC CPURNSA | 234,781 | Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0 | 16.05.2024 | 3.100 | (22) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (651) | $ (114) | 0,00 |

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,000 % | 02.11.2022 | 22.100 | $ 0 | $ (4.824) | (0,17) |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,000 | 04.11.2022 | 25.850 | (641) | (5.648) | (0,20) |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,175 | 15.03.2023 | 13.500 | (495) | (3.243) | (0,12) |
| BRC | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,558 | 02.02.2023 | 39.300 | (899) | (98) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,000 | 04.11.2022 | 12.450 | (305) | (2.720) | (0,10) |
| CBK | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,736 | 23.02.2023 | 6.600 | (163) | (28) | 0,00 |
| DUB | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,350 | 08.08.2022 | 6.500 | (25) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,550 | 08.08.2022 | 6.500 | (25) | (130) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,340 | 17.11.2023 | 133.200 | (1.678) | (5.473) | (0,20) |
| GLM | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,350 | 26.04.2023 | 16.600 | (328) | (281) | (0,01) |
| JPM | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,785 | 25.01.2023 | 7.000 | (194) | (27) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,175 | 15.03.2023 | 17.700 | (638) | (4.252) | (0,15) |
| MYC | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,579 | 31.01.2023 | 39.100 | (914) | (100) | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,350 | 31.05.2023 | 46.800 | (1.020) | (868) | (0,03) |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,000 | 02.11.2022 | 21.100 | (512) | (4.605) | (0,17) |
| | | | | | | | $ (7.837) | $ (32.298) | (1,15) |

### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPM | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2052 | $ 96,906 | 04.08.2022 | 500 | $ (2) | $ (6) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,141 | 07.09.2022 | 800 | (3) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,156 | 07.09.2022 | 1.300 | (5) | (9) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,656 | 07.09.2022 | 2.300 | (9) | (19) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 101,141 | 07.09.2022 | 800 | (2) | (3) | 0,00 |
| SAL | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | 94,688 | 07.09.2022 | 2.800 | (17) | (15) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 99,156 | 07.07.2022 | 7.800 | (56) | (49) | (0,01) |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 99,563 | 07.07.2022 | 1.900 | (10) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 100,281 | 07.07.2022 | 4.600 | (23) | (10) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 98,234 | 07.09.2022 | 4.700 | (26) | (21) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,406 | 07.09.2022 | 1.700 | (6) | (13) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,656 | 07.09.2022 | 2.200 | (8) | (18) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 100,234 | 07.09.2022 | 4.700 | (21) | (38) | 0,00 |
| | | | | | $ (188) | $ (207) | (0,01) |

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 % | 17.10.2057 | $ 12.200 | $ (713) | $ 722 | $ 9 | 0,00 |
| SAL | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 2.500 | (5) | (22) | (27) | 0,00 |
| | | | | | $ (718) | $ 700 | $ (18) | 0,00 |

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

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

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | AUD | 312 | $ | 216 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 186.837 | DKK | 1.310.858 | 0 | (2.556) | (2.556) | (0,09) |
| | 07.2022 | | 62.862 | € | 58.647 | 0 | (1.549) | (1.549) | (0,06) |
| | 07.2022 | | 5.078 | £ | 4.054 | 0 | (155) | (155) | (0,01) |
| | 08.2022 | DKK | 1.193.847 | $ | 170.153 | 2.018 | 0 | 2.018 | 0,07 |
| | 09.2022 | PEN | 16.727 | | 4.331 | 0 | (43) | (43) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CHF | 121 | | 126 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK | 75.325 | | 10.684 | 95 | 0 | 95 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 14.404 | | 15.468 | 410 | 0 | 410 | 0,02 |
| | 07.2022 | ¥ | 1.046.100 | | 7.756 | 56 | 0 | 56 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 49.713 | DKK | 342.935 | 39 | (1.542) | (1.503) | (0,05) |
| | 07.2022 | | 119.844 | € | 113.192 | 0 | (1.507) | (1.507) | (0,05) |
| | 07.2022 | | 3.996 | £ | 3.220 | 4 | (90) | (86) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | £ | 1.270 | $ | 1.550 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.337 | £ | 1.093 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 65.762 | ¥ | 8.920.653 | 0 | (99) | (99) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 29.969 | SEK | 304.529 | 0 | (251) | (251) | (0,01) |
| | 08.2022 | ¥ | 8.906.165 | $ | 65.762 | 97 | 0 | 97 | 0,00 |
| | 08.2022 | SEK | 304.277 | | 29.969 | 247 | 0 | 247 | 0,01 |
| CBK | 07.2022 | $ | 9.827 | DKK | 69.065 | 0 | (118) | (118) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 3.579 | € | 3.333 | 0 | (94) | (94) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 66.533 | £ | 52.996 | 0 | (2.172) | (2.172) | (0,08) |
| | 08.2022 | PEN | 2.544 | $ | 672 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 1.388 | PEN | 5.193 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| | 12.2022 | PEN | 8.075 | $ | 1.925 | 0 | (169) | (169) | (0,01) |
| DUB | 07.2022 | DKK | 484.360 | | 71.725 | 3.634 | 0 | 3.634 | 0,13 |
| JPM | 07.2022 | $ | 2.987 | DKK | 21.215 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 13.630 | £ | 10.820 | 0 | (490) | (490) | (0,02) |
| MBC | 07.2022 | CAD | 3.918 | $ | 3.103 | 66 | 0 | 66 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 380.600 | | 409.884 | 12.048 | (62) | 11.986 | 0,43 |
| | 07.2022 | £ | 1.991 | | 2.448 | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| | 07.2022 | NZD | 66.885 | | 43.561 | 1.975 | 0 | 1.975 | 0,07 |
| | 07.2022 | $ | 50.874 | AUD | 73.852 | 0 | (89) | (89) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 6.636 | DKK | 44.460 | 0 | (386) | (386) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 733.948 | € | 697.615 | 0 | (4.627) | (4.627) | (0,17) |
| | 07.2022 | | 5.000 | ¥ | 663.900 | 0 | (113) | (113) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 72.198 | $ | 49.729 | 72 | 0 | 72 | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 682.621 | | 719.423 | 4.459 | 0 | 4.459 | 0,16 |
| MYI | 07.2022 | DKK | 1.674.047 | | 248.194 | 12.855 | 0 | 12.855 | 0,46 |
| | 07.2022 | € | 46 | | 48 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 6.412 | | 7.945 | 160 | (2) | 158 | 0,01 |
| | 07.2022 | SGD | 1 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 31 | CHF | 29 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 49.783 | DKK | 345.361 | 0 | (1.232) | (1.232) | (0,04) |
| | 07.2022 | | 605 | € | 575 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 8.352 | £ | 6.889 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 13.159 | ¥ | 1.791.635 | 29 | 0 | 29 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 241.222 | $ | 34.354 | 381 | 0 | 381 | 0,01 |
| | 08.2022 | ¥ | 1.788.733 | | 13.159 | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| RBC | 07.2022 | $ | 8.573 | CAD | 11.023 | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 11.024 | $ | 8.573 | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | SEK | 304.947 | | 31.205 | 1.447 | 0 | 1.447 | 0,05 |
| | 07.2022 | $ | 8.528 | DKK | 58.645 | 0 | (284) | (284) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 101 | ILS | 341 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 10.229 | ¥ | 1.392.556 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 1.390.298 | $ | 10.229 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | € | 477.783 | | 513.525 | 14.027 | 0 | 14.027 | 0,50 |
| TOR | 07.2022 | CAD | 47.954 | | 37.545 | 369 | 0 | 369 | 0,01 |
| | 07.2022 | £ | 757.529 | | 955.032 | 35.051 | 0 | 35.051 | 1,25 |
| | 07.2022 | ¥ | 12.469.289 | | 98.239 | 6.455 | 0 | 6.455 | 0,23 |
| | 07.2022 | $ | 25.876 | CAD | 33.289 | 4 | (74) | (70) | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 33.291 | $ | 25.876 | 74 | (5) | 69 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | AUD | 73.852 | | 52.752 | 1.967 | 0 | 1.967 | 0,07 |
| | 07.2022 | $ | 6.049 | DKK | 41.035 | 0 | (280) | (280) | (0,01) |
| | | | | | | $ 98.149 | $ (18.117) | $ 80.032 | 2,86 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend und Investor CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | $ | 33.739 | CHF | 32.242 | $ 1 | $ (62) | $ (61) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CHF | 1.686 | $ | 1.752 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 59 | CHF | 56 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | | 33.661 | | 32.219 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | CHF | 29.752 | $ | 31.322 | 245 | 0 | 245 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 33.661 | CHF | 32.287 | 64 | 0 | 64 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 31.322 | | 29.703 | 0 | (243) | (243) | (0,01) |
| JPM | 07.2022 | CHF | 5 | $ | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | $ | 4 | CHF | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | CHF | 3.506 | $ | 3.654 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.549 | CHF | 1.482 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | | 120 | | 118 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | | | | | | $ 313 | $ (329) | $ (16) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | AUD | 294 | $ | 205 | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | NZD | 42 | | 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 205 | AUD | 294 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | AUD | 503 | $ | 349 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK | 872 | | 124 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | SEK | 316 | | 31 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 16.463 | £ | 13.021 | 0 | (650) | (650) | (0,03) |
| | 08.2022 | | 349 | AUD | 503 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 124 | DKK | 870 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | € | 9.419 | $ | 9.907 | 60 | 0 | 60 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 608 | | 766 | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 1.437 | | 11 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 150 | DKK | 1.055 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 9.925 | € | 9.419 | 0 | (60) | (60) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | £ | 1.107 | $ | 1.354 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | € | 487 | | 522 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 541 | | 679 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | CAD | 116 | | 90 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | AUD | 81 | | 56 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 964 | | 1.021 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 15 | CAD | 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 296 | NZD | 454 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 349 | SEK | 3.407 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | DKK | 183 | $ | 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 19.138 | | 141 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 26 | DKK | 183 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 1.606 | ¥ | 206.353 | 0 | (87) | (87) | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | £ | 10.765 | $ | 13.101 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 11.683 | € | 10.870 | 0 | (319) | (319) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 13.107 | £ | 10.765 | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | | 960 | CAD | 1.226 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | | 617 | AUD | 864 | 0 | (23) | (23) | 0,00 |
| | | | | | | $ 183 | $ (1.215) | $ (1.032) | (0,04) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | € | 18.677 | $ | 19.768 | $ 243 | $ 0 | $ 243 | 0,01 |
| BPS | 07.2022 | | 460.572 | | 484.822 | 3.318 | 0 | 3.318 | 0,12 |
| | 07.2022 | $ | 2.200 | € | 2.075 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 458.088 | | 434.736 | 0 | (2.754) | (2.754) | (0,10) |
| CBK | 07.2022 | € | 27.426 | $ | 29.441 | 769 | 0 | 769 | 0,03 |
| MBC | 07.2022 | | 451.282 | | 474.742 | 2.958 | (9) | 2.949 | 0,10 |
| | 07.2022 | $ | 507.398 | € | 470.514 | 0 | (15.499) | (15.499) | (0,56) |
| | 08.2022 | | 458.174 | | 434.736 | 0 | (2.840) | (2.840) | (0,10) |
| SOG | 07.2022 | | 504.184 | | 469.092 | 0 | (13.772) | (13.772) | (0,49) |
| UAG | 07.2022 | | 465.845 | | 433.505 | 0 | (12.637) | (12.637) | (0,45) |
| | | | | | | $ 7.288 | $ (47.542) | $ (40.254) | (1,44) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Class E GBP (Hedged) ausschüttend und Class R GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | £ | 377 | $ | 473 | $ 14 | $ 0 | $ 14 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 117.993 | £ | 93.320 | 0 | (4.660) | (4.660) | (0,17) |
| BPS | 07.2022 | £ | 5.394 | $ | 6.785 | 236 | (1) | 235 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 1.988 | £ | 1.630 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | £ | 3.751 | $ | 4.579 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 118.171 | £ | 93.684 | 0 | (4.397) | (4.397) | (0,16) |
| CBK | 07.2022 | £ | 3.614 | $ | 4.537 | 148 | 0 | 148 | 0,01 |
| MBC | 07.2022 | $ | 23.444 | £ | 19.131 | 0 | (210) | (210) | (0,01) |
| MYI | 07.2022 | | 108 | | 89 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | £ | 1 | $ | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 7.332 | £ | 5.833 | 0 | (249) | (249) | (0,01) |
| SOG | 07.2022 | £ | 94.536 | $ | 115.050 | 241 | 0 | 241 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 115.104 | £ | 94.536 | 0 | (239) | (239) | (0,01) |
| TOR | 07.2022 | | 116.848 | | 92.684 | 0 | (4.288) | (4.288) | (0,15) |
| | | | | | | $ 663 | $ (14.053) | $ (13.390) | (0,48) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | SGD | 41.946 | $ | 30.184 | $ 43 | $ 0 | $ 43 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 71.370 | SGD | 97.786 | 0 | (1.106) | (1.106) | (0,04) |
| | 08.2022 | | 30.184 | | 41.946 | 0 | (43) | (43) | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | SGD | 84.127 | $ | 60.553 | 104 | 0 | 104 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 60.553 | SGD | 84.129 | 0 | (101) | (101) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | SGD | 2.069 | $ | 1.488 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | | 5.469 | | 3.986 | 56 | 0 | 56 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | $ | 68.793 | SGD | 94.017 | 0 | (1.238) | (1.238) | (0,04) |
| UAG | 07.2022 | SGD | 3.605 | $ | 2.621 | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 71.219 | SGD | 97.520 | 0 | (1.146) | (1.146) | (0,04) |
| | | | | | | $ 236 | $ (3.634) | $ (3.398) | (0,12) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 11.684** | **0,42** |
| **Summe Anlagen** | **$ 3.657.357** | **130,76** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ (860.294)** | **(30,76)** |
| **Nettovermögen** | **$ 2.797.063** | **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**

**^** **Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a)** **Nullkuponwertpapier.**

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

**(c)** **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

**(d)** **Mit dem Fonds verbunden.**

**(e)** **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 788.129 als Sicherheiten verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von USD 27.538 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 38.920 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 3.569.598 | $ 0 | $ 3.569.598 |
| Investmentfonds | 65.301 | 0 | 0 | 65.301 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 1.506 | 0 | 1.506 |
| Finanzderivate[3] | (1.446) | 22.398 | 0 | 20.952 |
| **Summen** | **$ 63.855** | **$ 3.593.502** | **$ 0** | **$ 3.657.357** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 4.811.615 | $ 0 | $ 4.811.615 |
| Investmentfonds | 192 | 0 | 0 | 192 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 5.680 | 0 | 5.680 |
| Finanzderivate[3] | 9.953 | 7.569 | 0 | 17.522 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (311) | 0 | (311) |
| **Summen** | **$ 10.145** | **$ 4.824.553** | **$ 0** | **$ 4.834.698** |

(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 2022:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | (0,350) % | 30.06.2022 | 13.09.2022 | € (16.616) | $ (17.371) | (0,62) |
| NOM | 1,190 | 02.06.2022 | 19.07.2022 | $ (556.971) | (557.505) | (19,93) |
| | 1,190 | 27.06.2022 | 19.07.2022 | (213.658) | (213.687) | (7,64) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (788.563)** | **(28,19)** |

**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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (8.504) | $ 8.660 | $ 156 |
| BPS | (6.615) | 6.460 | (155) |
| BRC | (5.180) | 4.930 | (250) |
| CBK | (1.607) | 1.460 | (147) |
| DUB | 2.342 | (2.010) | 332 |
| GLM | (95) | 0 | (95) |
| GST | 9 | 0 | 9 |
| JPM | (1.994) | 1.980 | (14) |
| MBC | (2.242) | 2.080 | (162) |
| MYC | (1.473) | 1.223 | (250) |
| MYI | 12.231 | (11.830) | 401 |
| SAL | (192) | 380 | 188 |
| SCX | (425) | 480 | 55 |
| SOG | (62) | 0 | (62) |
| TOR | 37.576 | (39.610) | (2.034) |
| UAG | (12.085) | 10.960 | (1.125) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 113,97 | 118,77 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 13,41 | 10,95 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 0,25 | 0,21 |
| Investmentfonds | 2,33 | 0,01 |
| Pensionsgeschäfte | 0,05 | 0,15 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,03 | 0,24 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,30 | (0,04) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,42 | 0,27 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | k. A. | (0,01) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (28,19) | (20,86) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | k. A. | (9,07) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Australien | 1,68 | 1,68 |
| Belgien | 0,07 | k. A. |
| Kanada | 1,36 | 1,32 |
| Cayman-Inseln | 1,32 | 0,93 |
| Dänemark | 7,11 | 9,64 |
| Frankreich | 10,95 | 12,23 |
| Deutschland | 0,00 | 0,00 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Guernsey, Kanalinseln | 0,09 | 0,07 |
| Irland | 4,59 | 3,63 |
| Italien | 8,55 | 10,58 |
| Japan | 3,24 | 4,17 |
| Luxemburg | 0,02 | 0,01 |
| Multinational | k. A. | 0,01 |
| Niederlande | 0,15 | 0,33 |
| Neuseeland | 1,46 | 1,24 |
| Peru | 0,16 | 0,17 |
| Slowenien | 0,04 | 0,03 |
| Spanien | 1,59 | 2,04 |
| Schweden | 1,08 | 0,94 |
| Großbritannien | 28,79 | 30,24 |
| USA | 55,37 | 50,67 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,01 | k. A. |
| Investmentfonds | 2,33 | 0,01 |
| Pensionsgeschäfte | 0,05 | 0,15 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,03 | 0,24 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,00 | 0,00 |
| Zinsswaps | 0,30 | (0,04) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoptionen | 0,80 | 0,20 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | k. A. | 0,00 |
| Inflation-Capped Options | 0,00 | 0,00 |
| Zinsswapoptionen | (1,15) | (0,23) |
| Optionen auf Wertpapiere | (0,01) | (0,01) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | 0,00 | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | 2,86 | (0,49) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (2,08) | 0,80 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | k. A. | (0,01) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (30,76) | (30,55) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **AAdvantage Loyalty IP Ltd.** | | | | |
| 5,813 % fällig am 20.04.2028 | $ | 65.500 | $ 62.749 | 0,11 |
| **Air Canada** | | | | |
| 4,250 % fällig am 11.08.2028 | | 22.700 | 20.941 | 0,04 |
| **AmSurg Corp.** | | | | |
| TBD % fällig am 30.04.2027 µ | | 8.862 | 8.751 | 0,02 |
| TBD % fällig am 30.04.2027 | | 48.738 | 48.129 | 0,08 |
| 13,000 % fällig am 30.04.2028 | | 115.414 | 107.335 | 0,19 |
| **Aramark Services, Inc.** | | | | |
| 3,416 % fällig am 11.03.2025 | | 6.716 | 6.439 | 0,01 |
| **Avantor Funding, Inc.** | | | | |
| 3,666 % fällig am 21.11.2024 | | 513 | 511 | 0,00 |
| **Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC** | | | | |
| 3,095 % fällig am 12.02.2027 | | 10.019 | 9.488 | 0,02 |
| 3,345 % fällig am 15.01.2025 | | 21.326 | 20.353 | 0,04 |
| 3,845 % fällig am 01.12.2027 | | 10.616 | 10.115 | 0,02 |
| **Axalta Coating Systems U.S. Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.06.2024 | | 2.344 | 2.296 | 0,00 |
| **Caesars Resort Collection LLC** | | | | |
| 4,416 % fällig am 23.12.2024 | | 141.831 | 136.926 | 0,24 |
| 5,166 % fällig am 21.07.2025 | | 63.001 | 60.895 | 0,11 |
| **Carnival Corp.** | | | | |
| 3,750 % - 3,975 % fällig am 30.06.2025 | € | 55.673 | 53.983 | 0,09 |
| 3,750 % - 3,975 % fällig am 30.06.2025 | $ | 130.108 | 121.456 | 0,21 |
| 6,127 % fällig am 18.10.2028 | | 52.673 | 47.406 | 0,08 |
| **Cengage Learning, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 14.07.2026 | | 45.718 | 41.397 | 0,07 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 3,420 % fällig am 01.02.2027 | | 65.079 | 62.262 | 0,11 |
| **Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,739 % fällig am 21.08.2026 | | 29.773 | 25.633 | 0,05 |
| **CommScope, Inc.** | | | | |
| 4,916 % fällig am 06.04.2026 | | 15.899 | 14.362 | 0,03 |
| **Delos Finance SARL** | | | | |
| 4,000 % fällig am 06.10.2023 | | 8.226 | 8.144 | 0,01 |
| **DirecTV Financing LLC** | | | | |
| 6,666 % fällig am 02.08.2027 | | 38.419 | 35.531 | 0,06 |
| **Emerald TopCo, Inc.** | | | | |
| 4,739 % - 5,166 % fällig am 24.07.2026 | | 3.613 | 3.374 | 0,01 |
| **GVC Holdings PLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 29.03.2024 | € | 5.200 | 5.151 | 0,01 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | |
| 3,374 % fällig am 22.06.2026 | $ | 64.007 | 61.462 | 0,11 |
| **iHeartCommunications, Inc.** | | | | |
| 4,666 % fällig am 01.05.2026 | | 267.190 | 248.820 | 0,44 |
| 4,916 % fällig am 01.05.2026 | | 32.351 | 30.147 | 0,05 |
| **II-VI, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 14.01.2028 | | 26.340 | 25.319 | 0,04 |
| **INEOS Finance PLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.04.2024 | € | 89.902 | 89.964 | 0,16 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | |
| 4,920 % fällig am 01.02.2029 | $ | 95.427 | 87.554 | 0,15 |
| **IQVIA, Inc.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 07.03.2024 | € | 5.000 | 5.030 | 0,01 |
| **Lealand Finance Company BV** | | | | |
| 4,666 % fällig am 28.06.2024 | $ | 2.771 | 1.732 | 0,00 |
| **Lealand Finance Company BV (2,666 % bar oder 3,000 % PIK)** | | | | |
| 2,666 % - 3,000 % fällig am 30.06.2025 (c) | | 6.407 | 3.284 | 0,01 |
| **Marriott Ownership Resorts, Inc.** | | | | |
| 3,416 % fällig am 29.08.2025 | | 2.034 | 1.940 | 0,00 |
| **MH Sub LLC** | | | | |
| 5,416 % fällig am 13.09.2024 | | 3.366 | 3.184 | 0,01 |
| **Nielsen Finance LLC** | | | | |
| 3,190 % fällig am 04.10.2023 | | 2.628 | 2.617 | 0,00 |
| **Petco Health & Wellness Co., Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 03.03.2028 | | 15.318 | 14.460 | 0,03 |
| **PetSmart, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 11.02.2028 | | 38.208 | 36.022 | 0,06 |
| **PUG LLC** | | | | |
| 5,166 % fällig am 12.02.2027 | $ | 4.300 | $ 3.940 | 0,01 |
| **RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,416 % fällig am 16.11.2025 | | 5.539 | 5.180 | 0,01 |
| **Sequa Mezzanine Holdings LLC** | | | | |
| 8,303 % fällig am 28.11.2023 | | 20.172 | 20.088 | 0,04 |
| **Serta Simmons Bedding LLC** | | | | |
| 4,563 % - 4,714 % fällig am 08.11.2023 | | 1.421 | 394 | 0,00 |
| **Sierra Hamilton LLC** | | | | |
| 15,000 % fällig am 12.09.2023 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Sigma Bidco BV** | | | | |
| 3,500 % fällig am 02.07.2025 | € | 28.800 | 22.845 | 0,04 |
| **SkyMiles IP Ltd.** | | | | |
| 4,813 % fällig am 20.10.2027 | $ | 61.145 | 60.719 | 0,11 |
| **Sotera Health Holdings LLC** | | | | |
| 4,416 % fällig am 11.12.2026 | | 17.409 | 16.582 | 0,03 |
| **SS&C European Holdings SARL** | | | | |
| 3,416 % fällig am 16.04.2025 | | 8.876 | 8.490 | 0,01 |
| **SS&C Technologies, Inc.** | | | | |
| 3,416 % fällig am 16.04.2025 | | 16.689 | 15.959 | 0,03 |
| **Sunshine Luxembourg SARL** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.10.2026 | | 30.699 | 28.512 | 0,05 |
| **Syniverse Holdings, Inc.** | | | | |
| 8,286 % fällig am 13.05.2027 | | 9.678 | 8.541 | 0,01 |
| **TransDigm, Inc.** | | | | |
| 3,916 % fällig am 22.08.2024 | | 26.794 | 25.866 | 0,05 |
| 3,916 % fällig am 30.05.2025 | | 32.056 | 30.542 | 0,05 |
| 3,916 % fällig am 09.12.2025 | | 55.631 | 52.963 | 0,09 |
| **U.S. Renal Care, Inc.** | | | | |
| 6,688 % fällig am 26.06.2026 | | 182 | 125 | 0,00 |
| **Uber Technologies, Inc.** | | | | |
| 5,075 % fällig am 04.04.2025 | | 39.040 | 37.564 | 0,07 |
| 5,075 % fällig am 25.02.2027 | | 23.895 | 22.959 | 0,04 |
| **United Airlines, Inc.** | | | | |
| 5,392 % fällig am 21.04.2028 | | 43.494 | 40.493 | 0,07 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | | |
| 4,416 % fällig am 15.03.2024 | | 79.276 | 77.988 | 0,14 |
| **Westmoreland Coal Co. (15,000 % PIK)** | | | | |
| TBD % - 15,000 % fällig am 15.03.2029 (c) | | 4.450 | 2.670 | 0,00 |
| **Windstream Services LLC** | | | | |
| 7,916 % fällig am 21.09.2027 | | 10.028 | 9.427 | 0,02 |
| **Wyndham Hotels & Resorts, Inc.** | | | | |
| 3,416 % fällig am 30.05.2025 | | 5.362 | 5.188 | 0,01 |
| **Zayo Group Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,666 % fällig am 09.03.2027 | | 30.404 | 27.296 | 0,05 |
| | | | 2.049.493 | 3,61 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **AGFC Capital Trust** | | | | |
| 2,794 % fällig am 15.01.2067 | | 23.000 | 12.568 | 0,02 |
| **AIB Group PLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 30.05.2031 | € | 14.600 | 13.854 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 23.06.2025 (h)(j) | | 25.000 | 24.404 | 0,04 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.11.2031 | $ | 2.846 | 3.118 | 0,01 |
| **Ambac Assurance Corp.** | | | | |
| 5,100 % (h) | | 0 | 0 | 0,00 |
| **American Assets Trust LP** | | | | |
| 3,375 % fällig am 01.02.2031 | | 6.900 | 5.912 | 0,01 |
| **Army Hawaii Family Housing Trust Certificates** | | | | |
| 1,724 % fällig am 15.06.2050 | | 103.700 | 81.151 | 0,14 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | | 1.000 | 927 | 0,00 |
| **Asian Development Bank** | | | | |
| 4,700 % fällig am 12.03.2024 | MXN | 99.000 | 4.480 | 0,01 |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | |
| 2,528 % fällig am 18.11.2027 | $ | 183.112 | 149.423 | 0,26 |
| 3,950 % fällig am 01.07.2024 | | 6.940 | 6.650 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 15.05.2024 | | 11.906 | 11.707 | 0,02 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 1,875 % fällig am 09.01.2026 | € | 21.500 | $ 18.825 | 0,03 |
| 2,625 % fällig am 28.04.2025 | | 5.400 | 5.015 | 0,01 |
| 3,625 % fällig am 24.09.2024 | | 4.800 | 4.643 | 0,01 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (h)(j) | | 6.800 | 6.846 | 0,01 |
| **Banco BTG Pactual S.A.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 10.01.2025 | $ | 8.400 | 8.101 | 0,01 |
| **Banco de Credito del Peru S.A.** | | | | |
| 4,650 % fällig am 17.09.2024 | PEN | 95.500 | 23.274 | 0,04 |
| **Banco Espirito Santo S.A.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 08.05.2017 ^ | € | 16.200 | 2.964 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2018 ^ | | 8.100 | 1.482 | 0,00 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 12.11.2027 (h)(j) | | 70.800 | 55.689 | 0,10 |
| **Bank of Ireland Group PLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.09.2025 (h)(j) | | 2.900 | 2.801 | 0,01 |
| 7,500 % fällig am 19.05.2025 (h)(j) | | 150.039 | 155.878 | 0,27 |
| **Bank of Nova Scotia** | | | | |
| 4,900 % fällig am 04.06.2025 (h)(j) | $ | 5.007 | 4.655 | 0,01 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (j) | | 37.782 | 38.161 | 0,07 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 4,972 % fällig am 16.05.2029 | | 96.015 | 94.456 | 0,17 |
| 5,875 % fällig am 15.09.2024 (h)(j) | £ | 47.658 | 53.628 | 0,09 |
| 6,125 % fällig am 15.12.2025 (h)(j) | $ | 44.800 | 41.652 | 0,07 |
| 6,375 % fällig am 15.12.2025 (h)(j) | £ | 25.880 | 29.006 | 0,05 |
| 7,125 % fällig am 15.06.2025 (h)(j) | | 87.185 | 101.858 | 0,18 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (h)(j) | | 69.909 | 83.695 | 0,15 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (h)(j) | $ | 85.688 | 84.403 | 0,15 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2022 (h)(j) | £ | 69.589 | 84.353 | 0,15 |
| 8,000 % fällig am 15.06.2024 (h)(j) | $ | 44.550 | 43.882 | 0,08 |
| **Bevco Lux SARL** | | | | |
| 1,000 % fällig am 16.01.2030 | € | 15.000 | 12.405 | 0,02 |
| **BGC Partners, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.10.2024 | $ | 9.586 | 9.365 | 0,02 |
| **BNP Paribas Issuance BV** | | | | |
| 0,000 % fällig am 12.04.2024 | | 10 | 1.677.021 | 2,96 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 25.02.2031 (h)(j) | | 50.000 | 37.025 | 0,07 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 13.10.2046 (j) | € | 20.000 | 15.070 | 0,03 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.02.2029 | | 19.800 | 20.477 | 0,04 |
| 6,000 % fällig am 18.07.2022 (h)(j) | | 1.200 | 1.256 | 0,00 |
| 6,750 % fällig am 13.06.2024 (h)(j) | | 800 | 808 | 0,00 |
| **CDBL Funding** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.08.2022 | $ | 7.800 | 7.797 | 0,01 |
| **CIFI Holdings Group Co. Ltd.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 12.04.2027 | | 400 | 217 | 0,00 |
| 4,450 % fällig am 17.08.2026 | | 700 | 398 | 0,00 |
| 4,800 % fällig am 17.05.2028 | | 700 | 382 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 13.05.2026 | | 1.100 | 625 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 16.07.2025 | | 600 | 362 | 0,00 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 3,100 % fällig am 29.06.2028 (h)(j) | € | 8.000 | 6.305 | 0,01 |
| **Corestate Capital Holding S.A.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.04.2023 (m) | | 30.000 | 7.068 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 12.07.2026 | $ | 1.300 | $ 610 | 0,00 |
| 3,125 % fällig am 22.10.2025 | | 3.800 | 1.872 | 0,00 |
| 3,875 % fällig am 22.10.2030 | | 2.900 | 1.225 | 0,00 |
| 4,800 % fällig am 06.08.2030 | | 1.000 | 426 | 0,00 |
| 5,125 % fällig am 17.01.2025 | | 1.600 | 877 | 0,00 |
| 5,400 % fällig am 27.05.2025 | | 1.600 | 868 | 0,00 |
| 5,625 % fällig am 14.01.2030 | | 700 | 313 | 0,00 |
| 6,150 % fällig am 17.09.2025 | | 1.000 | 541 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 08.04.2024 | | 500 | 301 | 0,00 |
| 8,000 % fällig am 27.01.2024 | | 2.800 | 1.862 | 0,00 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 12.05.2026 | € | 5.900 | 5.496 | 0,01 |
| 2,750 % fällig am 22.01.2028 | £ | 5.050 | 4.742 | 0,01 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 23.01.2024 (h)(j) | $ | 550 | 544 | 0,00 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (j) | | 59.125 | 59.273 | 0,10 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 3,091 % fällig am 14.05.2032 | | 54.600 | 43.508 | 0,08 |
| 3,869 % fällig am 12.01.2029 | | 300 | 270 | 0,00 |
| 4,194 % fällig am 01.04.2031 | | 3.900 | 3.455 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 11.02.2027 (h)(j) | | 8.700 | 6.742 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 18.12.2024 (h)(j) | | 5.220 | 4.768 | 0,01 |
| 6,375 % fällig am 21.08.2026 (h)(j) | | 11.570 | 9.589 | 0,02 |
| 7,125 % fällig am 29.07.2022 (h)(j) | | 18.389 | 18.379 | 0,03 |
| 7,250 % fällig am 12.09.2025 (h)(j) | | 11.500 | 9.993 | 0,02 |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (h)(j) | | 45.544 | 42.128 | 0,07 |
| 7,500 % fällig am 11.12.2023 (h)(j) | | 63.308 | 60.468 | 0,11 |
| **Dalian Wanda Commercial Management Group Co. Ltd.** | | | | |
| 4,890 % fällig am 17.04.2023 | CNY | 10.000 | 1.287 | 0,00 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 1,375 % fällig am 17.02.2032 | € | 98.600 | 78.806 | 0,14 |
| 1,750 % fällig am 19.11.2030 | | 42.600 | 36.781 | 0,06 |
| 3,035 % fällig am 28.05.2032 (l) | $ | 45.920 | 36.381 | 0,06 |
| 3,547 % fällig am 18.09.2031 | | 20.300 | 17.014 | 0,03 |
| 4,625 % fällig am 30.10.2027 (h)(j) | € | 57.800 | 46.666 | 0,08 |
| 5,625 % fällig am 19.05.2031 | | 7.000 | 7.320 | 0,01 |
| **Doric Nimrod Air Alpha Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,250 % fällig am 30.05.2025 | $ | 357 | 353 | 0,00 |
| **Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.11.2024 | | 194 | 193 | 0,00 |
| **EPR Properties** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.12.2026 | | 7.623 | 7.169 | 0,01 |
| 4,950 % fällig am 15.04.2028 | | 2.170 | 1.998 | 0,00 |
| **Erste Group Bank AG** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.10.2027 (h)(j) | € | 29.000 | 23.982 | 0,04 |
| 6,500 % fällig am 15.04.2024 (h)(j) | | 2.800 | 2.856 | 0,01 |
| **Essential Properties LP** | | | | |
| 2,950 % fällig am 15.07.2031 | $ | 4.000 | 3.138 | 0,01 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 03.03.2031 | CAD | 21.500 | 14.576 | 0,03 |
| 4,230 % fällig am 14.06.2029 | | 3.100 | 2.221 | 0,00 |
| 4,850 % fällig am 17.04.2028 | $ | 6.620 | 6.585 | 0,01 |
| **FCE Bank PLC** | | | | |
| 1,615 % fällig am 11.05.2023 (m) | € | 1.000 | 1.035 | 0,00 |
| **First-Citizens Bank & Trust Co.** | | | | |
| 2,969 % fällig am 27.09.2025 | $ | 5.300 | 5.110 | 0,01 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 0,346 % fällig am 01.12.2024 | € | 10.000 | 9.757 | 0,02 |
| 1,744 % fällig am 19.07.2024 | | 28.089 | 27.197 | 0,05 |
| 2,330 % fällig am 25.11.2025 | | 4.280 | 3.974 | 0,01 |
| 2,386 % fällig am 17.02.2026 | | 450 | 413 | 0,00 |
| 2,748 % fällig am 14.06.2024 | £ | 55.500 | 62.341 | 0,11 |
| 2,979 % fällig am 03.08.2022 | $ | 23.881 | 23.881 | 0,04 |
| 3,021 % fällig am 06.03.2024 | € | 1.400 | 1.407 | 0,00 |
| 3,350 % fällig am 01.11.2022 | $ | 47.272 | 47.021 | 0,08 |
| 3,550 % fällig am 07.10.2022 | | 49.800 | 49.636 | 0,09 |
| 4,250 % fällig am 20.09.2022 | | 28.934 | 28.926 | 0,05 |
| 4,535 % fällig am 06.03.2025 | £ | 9.479 | 10.801 | 0,02 |
| 4,687 % fällig am 09.06.2025 | $ | 1.434 | 1.358 | 0,00 |
| 5,125 % fällig am 16.06.2025 | | 15.200 | 14.547 | 0,03 |
| **Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.10.2025 | | 34.273 | 32.401 | 0,06 |
| **Gateway Casinos & Entertainment Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 12.03.2038 | CAD | 48.698 | 32.634 | 0,06 |
| **GLP Capital LP** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.01.2032 | $ | 2.900 | 2.330 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 15.01.2031 | | 16.467 | 14.228 | 0,03 |
| 5,250 % fällig am 01.06.2025 | $ | 3.502 | $ 3.441 | 0,01 |
| 5,300 % fällig am 15.01.2029 | | 16.214 | 15.524 | 0,03 |
| **Goodman U.S. Finance Three LLC** | | | | |
| 3,700 % fällig am 15.03.2028 | | 11.640 | 11.154 | 0,02 |
| **Host Hotels & Resorts LP** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.12.2029 | | 800 | 678 | 0,00 |
| 3,500 % fällig am 15.09.2030 | | 5.000 | 4.276 | 0,01 |
| 3,875 % fällig am 01.04.2024 | | 7.000 | 6.920 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 15.06.2025 | | 1.430 | 1.400 | 0,00 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 2,357 % fällig am 18.08.2031 | | 46.700 | 37.895 | 0,07 |
| 2,804 % fällig am 24.05.2032 | | 25.700 | 21.130 | 0,04 |
| 2,848 % fällig am 04.06.2031 | | 3.600 | 3.045 | 0,01 |
| 3,973 % fällig am 22.05.2030 | | 46.600 | 42.845 | 0,08 |
| 4,583 % fällig am 19.06.2029 | | 15.300 | 14.765 | 0,03 |
| 4,950 % fällig am 31.03.2030 | | 1.600 | 1.582 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 16.09.2022 (h)(j) | € | 4.800 | 4.958 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 29.09.2023 (h)(j) | | 27.640 | 28.652 | 0,05 |
| 6,500 % fällig am 23.03.2028 (h)(j) | $ | 44.345 | 40.269 | 0,07 |
| **Huarong Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 24.02.2030 | | 3.193 | 2.407 | 0,00 |
| 3,625 % fällig am 30.09.2030 | | 7.270 | 5.598 | 0,01 |
| 3,875 % fällig am 13.11.2029 | | 7.798 | 6.229 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 07.11.2027 | | 2.700 | 2.356 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 29.05.2029 | | 13.916 | 11.602 | 0,02 |
| 4,625 % fällig am 03.06.2026 | | 1.729 | 1.589 | 0,00 |
| 4,750 % fällig am 27.04.2027 | | 7.390 | 6.679 | 0,01 |
| 4,950 % fällig am 07.11.2047 | | 4.700 | 3.313 | 0,01 |
| **InCaps Funding Ltd.** | | | | |
| 3,580 % fällig am 01.06.2033 | | 655 | 619 | 0,00 |
| 3,598 % fällig am 01.06.2033 | | 3.273 | 3.093 | 0,01 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 4,875 % fällig am 16.05.2029 (h)(j) | | 7.298 | 5.980 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 16.11.2026 (h)(j) | | 10.850 | 9.937 | 0,02 |
| **International Finance Corp.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 09.10.2023 | IDR | 129.400.000 | 8.964 | 0,02 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.09.2031 (h)(j) | € | 400 | 327 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 16.05.2024 (h)(j) | | 400 | 399 | 0,00 |
| 7,750 % fällig am 11.01.2027 (h)(j) | | 14.475 | 14.401 | 0,03 |
| **Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.11.2025 | | 9.400 | 9.128 | 0,02 |
| **Legal & General Group PLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 24.03.2031 (h)(j) | £ | 18.600 | 19.133 | 0,03 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 4,947 % fällig am 27.06.2025 (h)(j) | € | 19.577 | 19.267 | 0,03 |
| 7,500 % fällig am 27.06.2024 (h)(j) | $ | 24.502 | 23.814 | 0,04 |
| 7,500 % fällig am 27.09.2025 (h)(j) | | 28.400 | 27.752 | 0,05 |
| 7,625 % fällig am 27.06.2023 (h)(j) | £ | 93.302 | 113.424 | 0,20 |
| 7,875 % fällig am 27.06.2029 (h)(j) | | 61.872 | 74.402 | 0,13 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 0,000 % fällig am 02.04.2032 (l) | $ | 68.500 | 42.779 | 0,08 |
| **MPT Operating Partnership LP** | | | | |
| 0,993 % fällig am 15.10.2026 | € | 5.900 | 5.092 | 0,01 |
| 2,500 % fällig am 24.03.2026 | £ | 6.800 | 7.327 | 0,01 |
| 3,375 % fällig am 24.04.2030 | | 9.600 | 9.354 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 15.03.2031 | $ | 30.300 | 23.971 | 0,04 |
| 3,692 % fällig am 05.06.2028 | £ | 1.472 | 1.551 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 15.10.2027 | $ | 23.020 | 21.103 | 0,04 |
| 5,250 % fällig am 01.08.2026 | | 750 | 710 | 0,00 |
| **National Health Investors, Inc.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.02.2031 | | 9.900 | 7.609 | 0,01 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 3,960 % fällig am 18.07.2030 | | 163.883 | 152.242 | 0,27 |
| 4,302 % fällig am 08.03.2029 | | 34.100 | 32.667 | 0,06 |
| 5,750 % fällig am 20.06.2027 (h)(j) | £ | 57.320 | $ 62.408 | 0,11 |
| 5,875 % fällig am 20.12.2024 (h)(j) | | 19.500 | 22.487 | 0,04 |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 4,445 % fällig am 08.05.2030 | $ | 121.125 | 114.147 | 0,20 |
| 4,600 % fällig am 28.06.2031 (h)(j) | | 19.100 | 14.110 | 0,03 |
| 4,892 % fällig am 18.05.2029 | | 62.833 | 60.953 | 0,11 |
| 5,076 % fällig am 27.01.2030 | | 134.670 | 131.953 | 0,23 |
| 5,125 % fällig am 12.05.2027 (h)(j) | £ | 5.100 | 5.252 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 29.12.2025 (h)(j) | $ | 80.200 | 74.418 | 0,13 |
| 8,000 % fällig am 10.08.2025 (h)(j) | | 45.366 | 45.002 | 0,08 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.01.2023 | | 26.350 | 26.169 | 0,05 |
| 5,625 % fällig am 25.01.2025 | | 3.549 | 3.346 | 0,01 |
| **New Metro Global Ltd.** | | | | |
| 4,800 % fällig am 15.12.2024 | | 1.200 | 660 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 08.08.2022 | | 400 | 391 | 0,00 |
| 6,800 % fällig am 05.08.2023 | | 300 | 206 | 0,00 |
| **Newmark Group, Inc.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.11.2023 | | 10.044 | 10.024 | 0,02 |
| **Nissan Motor Acceptance Co. LLC** | | | | |
| 2,600 % fällig am 28.09.2022 | | 5.800 | 5.772 | 0,01 |
| 2,650 % fällig am 13.07.2022 | | 1.800 | 1.800 | 0,00 |
| 2,750 % fällig am 09.03.2028 | | 21.400 | 17.912 | 0,03 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | | |
| 2,924 % fällig am 28.09.2022 | | 2.300 | 2.292 | 0,00 |
| **Nomura Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,172 % fällig am 14.07.2028 | | 14.968 | 12.623 | 0,02 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | DKK | 0 | 0 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.07.2037 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Omega Healthcare Investors, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.04.2033 | $ | 12.852 | 9.748 | 0,02 |
| 3,625 % fällig am 01.10.2029 | | 9.874 | 8.390 | 0,02 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2028 | | 2.670 | 2.532 | 0,00 |
| **OneMain Finance Corp.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.03.2023 | | 111.724 | 110.449 | 0,19 |
| 6,125 % fällig am 15.03.2024 | | 75.410 | 72.202 | 0,13 |
| **Owl Rock Capital Corp.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 11.06.2028 | | 5.600 | 4.403 | 0,01 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2023 | | 40.005 | 39.871 | 0,07 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2024 | | 13.831 | 13.728 | 0,02 |
| **Preferred Term Securities Ltd.** | | | | |
| 2,029 % fällig am 22.12.2036 | | 382 | 344 | 0,00 |
| 2,119 % fällig am 22.06.2037 | | 18.648 | 16.900 | 0,03 |
| 2,129 % fällig am 22.03.2037 | | 17.492 | 16.027 | 0,03 |
| 2,129 % fällig am 22.09.2037 | | 16.962 | 15.371 | 0,03 |
| 2,139 % fällig am 22.12.2036 | | 20.750 | 19.272 | 0,03 |
| 2,169 % fällig am 22.09.2036 | | 1.522 | 1.389 | 0,00 |
| 2,179 % fällig am 22.12.2035 | | 9.723 | 8.873 | 0,02 |
| 2,179 % fällig am 22.03.2038 | | 10.338 | 9.627 | 0,02 |
| 2,199 % fällig am 22.09.2037 | | 11.820 | 10.224 | 0,02 |
| 2,209 % fällig am 23.09.2035 | | 1.376 | 1.364 | 0,00 |
| 2,209 % fällig am 22.03.2037 | | 13.164 | 11.189 | 0,02 |
| 2,229 % fällig am 22.03.2038 | | 13.086 | 11.724 | 0,02 |
| 2,259 % fällig am 22.12.2035 | | 2.211 | 1.940 | 0,00 |
| 2,279 % fällig am 22.03.2038 | | 9.253 | 8.189 | 0,01 |
| 2,309 % fällig am 23.09.2035 | | 6.666 | 6.000 | 0,01 |
| 2,409 % fällig am 23.03.2035 | | 10.000 | 9.100 | 0,02 |
| 2,543 % fällig am 26.09.2034 | | 9.008 | 8.400 | 0,01 |
| 2,729 % fällig am 22.03.2038 | | 834 | 789 | 0,00 |
| 3,057 % fällig am 03.07.2033 | | 900 | 841 | 0,00 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.04.2047 | DKK | 0 | 0 | 0,00 |
| **Sabra Health Care LP** | | | | |
| 3,200 % fällig am 01.12.2031 | $ | 15.700 | 12.477 | 0,02 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 3,823 % fällig am 03.11.2028 | | 17.900 | 16.631 | 0,03 |
| 6,750 % fällig am 24.06.2024 (h)(j) | £ | 65.803 | 77.114 | 0,14 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 29.10.2022 ^ | $ | 6.100 | 427 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Seazen Group Ltd.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 13.07.2025 | $ | 1.100 | $ 646 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 12.08.2024 | | 1.600 | 960 | 0,00 |
| 6,150 % fällig am 15.04.2023 | | 200 | 149 | 0,00 |
| **Sitka Holdings LLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 06.07.2026 | | 87.221 | 84.426 | 0,15 |
| **SLM Corp.** | | | | |
| 4,200 % fällig am 29.10.2025 | | 2.686 | 2.438 | 0,00 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,269 % fällig am 15.12.2033 | € | 14.361 | 14.188 | 0,03 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 2,889 % fällig am 09.06.2032 | $ | 14.300 | 11.433 | 0,02 |
| 4,750 % fällig am 26.05.2026 (h)(j) | | 1.500 | 1.223 | 0,00 |
| 5,375 % fällig am 18.11.2030 (h)(j) | | 4.000 | 3.110 | 0,01 |
| 6,750 % fällig am 06.04.2028 (h)(j) | | 11.802 | 10.480 | 0,02 |
| 7,375 % fällig am 04.10.2023 (h)(j) | | 49.230 | 47.450 | 0,08 |
| 7,875 % fällig am 18.12.2023 (h)(j) | | 22.755 | 22.352 | 0,04 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 2,678 % fällig am 29.06.2032 | | 3.500 | 2.813 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 14.01.2031 (h)(j) | | 24.300 | 18.627 | 0,03 |
| 7,750 % fällig am 02.04.2023 (h)(j) | | 900 | 890 | 0,00 |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | |
| 6,500 % (h) | € | 206.326 | 210.047 | 0,37 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 10.01.2025 ^ | $ | 1.700 | 255 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 26.01.2026 ^ | | 600 | 89 | 0,00 |
| 6,650 % fällig am 03.08.2024 ^ | | 700 | 103 | 0,00 |
| 7,500 % fällig am 01.02.2024 ^ | | 800 | 122 | 0,00 |
| 8,350 % fällig am 19.04.2023 ^ | | 5.300 | 808 | 0,00 |
| **Svenska Handelsbanken AB** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.03.2031 (h)(j) | | 9.600 | 7.895 | 0,01 |
| **Tesco Property Finance PLC** | | | | |
| 5,411 % fällig am 13.07.2044 | £ | 38.218 | 47.076 | 0,08 |
| 5,661 % fällig am 13.10.2041 | | 3.913 | 4.936 | 0,01 |
| 5,744 % fällig am 13.04.2040 | | 6.477 | 8.299 | 0,01 |
| 5,801 % fällig am 13.10.2040 | | 26.107 | 33.528 | 0,06 |
| 6,052 % fällig am 13.10.2039 | | 11.637 | 15.332 | 0,03 |
| **TP ICAP Finance PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 29.05.2026 | | 42.839 | 50.889 | 0,09 |
| **U.S. Capital Funding Ltd.** | | | | |
| 1,269 % fällig am 10.07.2043 | $ | 5.523 | 5.019 | 0,01 |
| 2,036 % fällig am 01.08.2034 | | 1.727 | 1.703 | 0,00 |
| **UBS AG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (j) | | 62.545 | 62.532 | 0,11 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (j) | | 7.116 | 7.137 | 0,01 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 4,375 % fällig am 10.02.2031 (h)(j) | | 29.500 | 21.656 | 0,04 |
| 4,875 % fällig am 12.02.2027 (h)(j) | | 11.100 | 9.312 | 0,02 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | | 324.870 | 336.539 | 0,59 |
| **Unique Pub Finance Co. PLC** | | | | |
| 7,395 % fällig am 28.03.2024 | £ | 4.396 | 5.495 | 0,01 |
| **Uniti Group LP** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.04.2028 | $ | 11.366 | 9.373 | 0,02 |
| 7,875 % fällig am 15.02.2025 | | 92.456 | 89.501 | 0,16 |
| **VICI Properties LP** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.02.2025 | | 42.516 | 39.835 | 0,07 |
| 3,750 % fällig am 15.02.2027 | | 39.100 | 34.471 | 0,06 |
| 3,875 % fällig am 15.02.2029 | | 2.180 | 1.879 | 0,00 |
| 4,125 % fällig am 15.08.2030 | | 5.116 | 4.424 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 01.12.2026 | | 31.400 | 28.744 | 0,05 |
| 4,500 % fällig am 01.09.2026 | | 11.028 | 10.166 | 0,02 |
| 4,500 % fällig am 15.01.2028 | | 900 | 822 | 0,00 |
| 4,625 % fällig am 15.06.2025 | | 5.648 | 5.382 | 0,01 |
| 4,625 % fällig am 01.12.2029 | | 32.600 | 29.205 | 0,05 |
| 5,625 % fällig am 01.05.2024 | | 9.505 | 9.406 | 0,02 |
| 5,750 % fällig am 01.02.2027 | | 24.955 | 23.725 | 0,04 |
| **Voyager Aviation Holdings LLC** | | | | |
| 8,500 % fällig am 09.05.2026 | | 4.668 | 4.178 | 0,01 |
| **Yango Group Co. Ltd.** | | | | |
| 6,900 % fällig am 31.10.2022 ^ | CNY | 50.000 | 2.047 | 0,00 |
| | | | 7.384.542 | 13,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 31.07.2043 | £ | 16.680 | $ 20.158 | 0,04 |
| 5,500 % fällig am 31.07.2050 | | 4.875 | 5.788 | 0,01 |
| **Aeroporti di Roma SpA** | | | | |
| 1,750 % fällig am 30.07.2031 | € | 18.300 | 14.668 | 0,03 |
| **Air Canada** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.08.2026 | $ | 21.146 | 17.931 | 0,03 |
| **Air Canada Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.10.2030 | | 32.722 | 32.755 | 0,06 |
| **Alaska Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,800 % fällig am 15.02.2029 | | 17.537 | 17.339 | 0,03 |
| **Altice Financing S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.08.2029 | € | 9.490 | 7.515 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 15.08.2029 | $ | 71.503 | 57.584 | 0,10 |
| **Altice France S.A.** | | | | |
| 8,125 % fällig am 01.02.2027 | | 24.392 | 22.493 | 0,04 |
| **Amdocs Ltd.** | | | | |
| 2,538 % fällig am 15.06.2030 | | 14.600 | 12.312 | 0,02 |
| **American Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,875 % fällig am 11.01.2036 | | 21.819 | 18.648 | 0,03 |
| 3,000 % fällig am 15.04.2030 | | 1.814 | 1.648 | 0,00 |
| 3,150 % fällig am 15.08.2033 | | 1.070 | 949 | 0,00 |
| 3,350 % fällig am 15.04.2031 | | 10.977 | 10.110 | 0,02 |
| 3,375 % fällig am 01.11.2028 | | 15.268 | 13.713 | 0,02 |
| 3,575 % fällig am 15.07.2029 | | 3.991 | 3.713 | 0,01 |
| 3,700 % fällig am 01.04.2028 | | 16.641 | 14.445 | 0,03 |
| 4,000 % fällig am 15.08.2030 | | 5.606 | 4.947 | 0,01 |
| **American Airlines, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 20.04.2026 | | 70.412 | 64.941 | 0,11 |
| 5,750 % fällig am 20.04.2029 | | 26.070 | 22.346 | 0,04 |
| **Atlantia SpA** | | | | |
| 1,875 % fällig am 12.02.2028 | € | 68.400 | 55.850 | 0,10 |
| **Baptist Healthcare System Obligated Group** | | | | |
| 3,540 % fällig am 15.08.2050 | $ | 13.100 | 10.455 | 0,02 |
| **Boeing Co.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 01.02.2035 | | 1.300 | 985 | 0,00 |
| 3,600 % fällig am 01.05.2034 | | 6.900 | 5.515 | 0,01 |
| 5,705 % fällig am 01.05.2040 | | 48.775 | 45.580 | 0,08 |
| 5,805 % fällig am 01.05.2050 | | 222.513 | 204.775 | 0,36 |
| 5,930 % fällig am 01.05.2060 | | 132.049 | 120.523 | 0,21 |
| 6,125 % fällig am 15.02.2033 | | 14.822 | 14.940 | 0,03 |
| **Bombardier, Inc.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.03.2025 | | 13.804 | 12.513 | 0,02 |
| 7,875 % fällig am 15.04.2027 | | 5.256 | 4.389 | 0,01 |
| **Bon Secours Mercy Health, Inc.** | | | | |
| 3,205 % fällig am 01.06.2050 | | 6.000 | 4.493 | 0,01 |
| **British Airways Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,900 % fällig am 15.09.2036 | | 7.579 | 6.697 | 0,01 |
| 3,300 % fällig am 15.06.2034 | | 3.527 | 3.152 | 0,01 |
| 3,800 % fällig am 20.03.2033 | | 2.728 | 2.584 | 0,00 |
| 4,250 % fällig am 15.05.2034 | | 7.002 | 6.753 | 0,01 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 15.02.2031 | | 57.900 | 46.577 | 0,08 |
| 2,600 % fällig am 15.02.2033 | | 34.200 | 26.339 | 0,05 |
| 3,137 % fällig am 15.11.2035 | | 28.844 | 21.944 | 0,04 |
| 3,187 % fällig am 15.11.2036 | | 99.231 | 75.572 | 0,13 |
| 3,419 % fällig am 15.04.2033 | | 38.242 | 31.665 | 0,06 |
| 3,469 % fällig am 15.04.2034 | | 147.100 | 119.915 | 0,21 |
| 3,500 % fällig am 15.02.2041 | | 30.200 | 22.826 | 0,04 |
| 3,750 % fällig am 15.02.2051 | | 12.800 | 9.504 | 0,02 |
| 4,150 % fällig am 15.11.2030 | | 17.584 | 16.129 | 0,03 |
| 4,300 % fällig am 15.11.2032 | | 30.873 | 28.081 | 0,05 |
| 4,926 % fällig am 15.05.2037 | | 37.710 | 33.861 | 0,06 |
| **Caesars Entertainment, Inc.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 01.07.2025 | | 47.290 | 45.735 | 0,08 |
| **California Institute of Technology** | | | | |
| 4,283 % fällig am 01.09.2116 | | 9.100 | 8.027 | 0,01 |
| **Cameron LNG LLC** | | | | |
| 3,402 % fällig am 15.01.2038 | | 867 | 739 | 0,00 |
| **Carnival Corp.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2028 | | 94.306 | 77.665 | 0,14 |
| 10,500 % fällig am 01.02.2026 | | 3.132 | 3.124 | 0,01 |
| **Carvana Co.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.04.2027 | | 39.694 | 25.671 | 0,05 |
| 10,250 % fällig am 01.05.2030 | | 204.910 | 168.704 | 0,30 |
| **CDW LLC** | | | | |
| 2,670 % fällig am 01.12.2026 | | 7.600 | 6.785 | 0,01 |
| 3,569 % fällig am 01.12.2031 | | 26.300 | 21.777 | 0,04 |
| **Cellnex Finance Co. S.A.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 07.07.2041 | $ | 10.800 | $ 7.433 | 0,01 |
| **Centene Corp.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 15.07.2028 | | 21.100 | 17.655 | 0,03 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Champion Path Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 27.01.2026 | | 10.800 | 6.858 | 0,01 |
| 4,850 % fällig am 27.01.2028 | | 28.700 | 16.866 | 0,03 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.06.2041 | | 22.200 | 15.573 | 0,03 |
| 3,500 % fällig am 01.03.2042 | | 8.300 | 5.773 | 0,01 |
| 3,700 % fällig am 01.04.2051 | | 20.286 | 13.765 | 0,02 |
| 3,850 % fällig am 01.04.2061 | | 34.100 | 22.492 | 0,04 |
| 3,900 % fällig am 01.06.2052 | | 112.300 | 78.176 | 0,14 |
| 3,950 % fällig am 30.06.2062 | | 47.000 | 31.490 | 0,06 |
| 4,400 % fällig am 01.12.2061 | | 59.300 | 42.770 | 0,08 |
| 4,800 % fällig am 01.03.2050 | | 20.349 | 16.165 | 0,03 |
| **Citrix Systems, Inc.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 01.03.2030 | | 7.676 | 7.495 | 0,01 |
| **CommonSpirit Health** | | | | |
| 3,910 % fällig am 01.10.2050 | | 1.000 | 805 | 0,00 |
| **Community Health Systems, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.03.2027 | | 167.529 | 142.248 | 0,25 |
| 8,000 % fällig am 15.03.2026 | | 102.191 | 93.359 | 0,16 |
| **Constellation Oil Services Holding S.A.** | | | | |
| 13,500 % fällig am 30.06.2025 | | 1.250 | 1.253 | 0,00 |
| **Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar oder 4,000 % PIK)** | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.12.2026 (c) | | 2.878 | 2.126 | 0,00 |
| **Corning, Inc.** | | | | |
| 5,450 % fällig am 15.11.2079 | | 663 | 599 | 0,00 |
| **CoStar Group, Inc.** | | | | |
| 2,800 % fällig am 15.07.2030 | | 11.362 | 9.471 | 0,02 |
| **CSC Holdings LLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.09.2022 | | 5.000 | 4.982 | 0,01 |
| **CVS Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,163 % fällig am 11.08.2036 | | 1.485 | 1.422 | 0,00 |
| 4,704 % fällig am 10.01.2036 | | 5.564 | 5.339 | 0,01 |
| 5,926 % fällig am 10.01.2034 | | 790 | 812 | 0,00 |
| 6,036 % fällig am 10.12.2028 | | 2.941 | 3.020 | 0,01 |
| 6,943 % fällig am 10.01.2030 | | 5.738 | 6.113 | 0,01 |
| 7,507 % fällig am 10.01.2032 | | 6.423 | 7.007 | 0,01 |
| 8,353 % fällig am 10.07.2031 | | 5.052 | 5.781 | 0,01 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 5,300 % fällig am 01.10.2029 | | 17.205 | 16.978 | 0,03 |
| **Delta Air Lines, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 20.10.2025 | | 22.940 | 22.312 | 0,04 |
| 4,750 % fällig am 20.10.2028 | | 20.908 | 19.766 | 0,03 |
| 7,000 % fällig am 01.05.2025 | | 5.898 | 5.978 | 0,01 |
| **Directv Financing LLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.08.2027 | | 34.600 | 29.628 | 0,05 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.12.2026 | | 72.570 | 57.019 | 0,10 |
| 5,750 % fällig am 01.12.2028 | | 81.200 | 60.274 | 0,11 |
| 5,875 % fällig am 15.07.2022 | | 22.164 | 22.106 | 0,04 |
| **Dufry One BV** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.04.2026 | CHF | 2.687 | 2.488 | 0,00 |
| **Energy Transfer LP** | | | | |
| 4,950 % fällig am 15.05.2028 | $ | 2.500 | 2.446 | 0,00 |
| 5,300 % fällig am 01.04.2044 | | 900 | 782 | 0,00 |
| **Exela Intermediate LLC** | | | | |
| 11,500 % fällig am 15.07.2026 | | 5.923 | 1.984 | 0,00 |
| **Expedia Group, Inc.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 15.03.2031 | | 25.967 | 20.681 | 0,04 |
| 3,250 % fällig am 15.02.2030 | | 6.547 | 5.466 | 0,01 |
| 4,625 % fällig am 01.08.2027 | | 3.571 | 3.434 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 01.05.2025 | | 4.892 | 5.044 | 0,01 |
| **Ford Foundation** | | | | |
| 2,415 % fällig am 01.06.2050 | | 4.100 | 2.933 | 0,01 |
| 2,815 % fällig am 01.06.2070 | | 7.900 | 5.452 | 0,01 |
| **Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide** | | | | |
| 1,875 % fällig am 31.03.2028 | € | 11.200 | 10.277 | 0,02 |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 22.11.2024 | | 500 | 170 | 0,00 |
| 2,949 % fällig am 24.01.2024 | | 56.890 | 19.330 | 0,03 |
| 4,250 % fällig am 06.04.2024 | £ | 500 | 205 | 0,00 |
| 4,950 % fällig am 19.07.2022 | $ | 1.600 | 1.240 | 0,00 |
| 4,950 % fällig am 23.03.2027 | | 20.300 | 6.090 | 0,01 |
| 4,950 % fällig am 06.02.2028 | | 24.600 | 9.163 | 0,02 |
| 5,150 % fällig am 11.02.2026 | | 32.700 | 10.628 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| 7,288 % fällig am 16.08.2037 | $ | 18.510 | $ | 6.479 | 0,01 |
| 8,625 % fällig am 28.04.2034 | | 38.699 | | 14.512 | 0,03 |
| **goeasy Ltd.** | | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.12.2024 | | 900 | | 827 | 0,00 |
| **Greene King Finance PLC** | | | | | |
| 4,064 % fällig am 15.03.2035 | £ | 4.101 | | 4.716 | 0,01 |
| 5,106 % fällig am 15.03.2034 | | 3.297 | | 4.087 | 0,01 |
| **Hilton Domestic Operating Co., Inc.** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.05.2029 | $ | 28.200 | | 23.955 | 0,04 |
| 4,000 % fällig am 01.05.2031 | | 38.551 | | 32.152 | 0,06 |
| **Hyatt Hotels Corp.** | | | | | |
| 2,563 % fällig am 01.10.2023 | | 4.500 | | 4.493 | 0,01 |
| 4,850 % fällig am 15.03.2026 | | 3.300 | | 3.292 | 0,01 |
| **iHeartCommunications, Inc.** | | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.05.2026 | | 25.413 | | 23.581 | 0,04 |
| 8,375 % fällig am 01.05.2027 | | 40.687 | | 32.420 | 0,06 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK)** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2025 (c) | € | 13.327 | | 12.183 | 0,02 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (6,000 % bar oder 6,750 % PIK)** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.05.2027 (c) | $ | 11.602 | | 10.345 | 0,02 |
| **Imperial Brands Finance Netherlands BV** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 18.03.2033 | € | 5.290 | | 4.020 | 0,01 |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 26.07.2026 | $ | 2.794 | | 2.622 | 0,00 |
| **Integris Baptist Medical Center, Inc.** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.08.2050 | | 10.500 | | 8.955 | 0,02 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.03.2030 | | 337.627 | | 279.386 | 0,49 |
| **JetBlue Pass-Through Trust** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.05.2034 | | 42.256 | | 39.391 | 0,07 |
| **Las Vegas Sands Corp.** | | | | | |
| 3,200 % fällig am 08.08.2024 | | 2.307 | | 2.182 | 0,00 |
| 3,500 % fällig am 18.08.2026 | | 1.400 | | 1.219 | 0,00 |
| 3,900 % fällig am 08.08.2029 | | 6.366 | | 5.206 | 0,01 |
| **Live Nation Entertainment, Inc.** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.01.2028 | | 6.000 | | 5.190 | 0,01 |
| **Magallanes, Inc.** | | | | | |
| 3,755 % fällig am 15.03.2027 | | 14.900 | | 13.989 | 0,02 |
| 4,279 % fällig am 15.03.2032 | | 14.100 | | 12.615 | 0,02 |
| 5,050 % fällig am 15.03.2042 | | 11.600 | | 9.887 | 0,02 |
| 5,141 % fällig am 15.03.2052 | | 15.300 | | 12.862 | 0,02 |
| 5,391 % fällig am 15.03.2062 | | 5.100 | | 4.274 | 0,01 |
| **Market Bidco Finco PLC** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 04.11.2027 | € | 103.700 | | 86.405 | 0,15 |
| **Marriott International, Inc.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.10.2033 | $ | 6.500 | | 5.120 | 0,01 |
| 2,850 % fällig am 15.04.2031 | | 7.200 | | 5.978 | 0,01 |
| 4,625 % fällig am 15.06.2030 | | 2.396 | | 2.299 | 0,00 |
| **Massachusetts Institute of Technology** | | | | | |
| 4,678 % fällig am 01.07.2114 | | 375 | | 377 | 0,00 |
| 5,600 % fällig am 01.07.2111 | | 597 | | 720 | 0,00 |
| **Melco Resorts Finance Ltd.** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 06.06.2025 | | 200 | | 150 | 0,00 |
| 5,375 % fällig am 04.12.2029 | | 50.780 | | 30.724 | 0,05 |
| 5,625 % fällig am 17.07.2027 | | 1.650 | | 1.108 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 21.07.2028 | | 900 | | 581 | 0,00 |
| **MGM China Holdings Ltd.** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.02.2027 | | 8.018 | | 5.678 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 18.06.2025 | | 19.681 | | 15.128 | 0,03 |
| 5,375 % fällig am 15.05.2024 | | 7.000 | | 5.974 | 0,01 |
| 5,875 % fällig am 15.05.2026 | | 13.375 | | 10.131 | 0,02 |
| **Micron Technology, Inc.** | | | | | |
| 4,663 % fällig am 15.02.2030 | | 23.955 | | 22.996 | 0,04 |
| **Mileage Plus Holdings LLC** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 20.06.2027 | | 11.150 | | 10.992 | 0,02 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | | |
| 2,279 % fällig am 15.12.2030 | | 4.615 | | 4.267 | 0,01 |
| 6,013 % fällig am 15.12.2030 | £ | 6.023 | | 7.463 | 0,01 |
| **Motorola Solutions, Inc.** | | | | | |
| 4,600 % fällig am 23.05.2029 | $ | 7.455 | | 7.140 | 0,01 |
| **NCL Corp. Ltd.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.02.2027 | | 8.534 | | 7.313 | 0,01 |
| **Netflix, Inc.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2027 | € | 43.360 | | 42.566 | 0,08 |
| 3,625 % fällig am 15.06.2030 | | 20.466 | | 18.566 | 0,03 |
| 3,875 % fällig am 15.11.2029 | | 74.280 | | 70.252 | 0,12 |
| 4,625 % fällig am 15.05.2029 | | 72.140 | | 71.317 | 0,13 |
| 4,875 % fällig am 15.04.2028 | $ | 1.400 | $ | 1.320 | 0,00 |
| 4,875 % fällig am 15.06.2030 | | 16.200 | | 14.857 | 0,03 |
| 5,375 % fällig am 15.11.2029 | | 7.794 | | 7.379 | 0,01 |
| 5,875 % fällig am 15.11.2028 | | 1.400 | | 1.372 | 0,00 |
| 6,375 % fällig am 15.05.2029 | | 8.300 | | 8.398 | 0,01 |
| **Nissan Motor Co. Ltd.** | | | | | |
| 3,201 % fällig am 17.09.2028 | € | 86.900 | | 80.951 | 0,14 |
| 3,522 % fällig am 17.09.2025 | $ | 58.000 | | 54.964 | 0,10 |
| 4,345 % fällig am 17.09.2027 | | 82.724 | | 76.002 | 0,13 |
| 4,810 % fällig am 17.09.2030 | | 43.097 | | 38.328 | 0,07 |
| **NMG Holding Co., Inc.** | | | | | |
| 7,125 % fällig am 01.04.2026 | | 92.700 | | 85.729 | 0,15 |
| **Noble Finance Co. (11,000 % bar oder 15,000 % PIK)** | | | | | |
| 11,000 % fällig am 15.02.2028 (c) | | 7.107 | | 7.782 | 0,01 |
| **Norfolk Southern Corp.** | | | | | |
| 4,100 % fällig am 15.05.2121 | | 5.000 | | 3.773 | 0,01 |
| **Oracle Corp.** | | | | | |
| 3,850 % fällig am 01.04.2060 | | 28.599 | | 19.661 | 0,03 |
| 3,950 % fällig am 25.03.2051 (I) | | 19.729 | | 14.521 | 0,03 |
| 4,000 % fällig am 15.07.2046 | | 3.708 | | 2.748 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 15.11.2047 | | 1.500 | | 1.115 | 0,00 |
| 4,100 % fällig am 25.03.2061 (I) | | 26.800 | | 19.016 | 0,03 |
| **PeaceHealth Obligated Group** | | | | | |
| 3,218 % fällig am 15.11.2050 | | 13.300 | | 10.016 | 0,02 |
| **Petroleos de Venezuela S.A.** | | | | | |
| 5,375 % fällig am 12.04.2027 ^ | | 53.114 | | 3.174 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 12.04.2037 ^ | | 50.574 | | 3.022 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 16.05.2024 ^ | | 47.576 | | 2.985 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 15.11.2026 ^ | | 63.177 | | 3.775 | 0,01 |
| 9,750 % fällig am 17.05.2035 ^ | | 28.330 | | 1.328 | 0,00 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 21.04.2027 | € | 7.200 | | 5.664 | 0,01 |
| 5,950 % fällig am 28.01.2031 | $ | 120.615 | | 88.586 | 0,16 |
| 6,500 % fällig am 02.06.2041 | | 3.400 | | 2.128 | 0,00 |
| 6,700 % fällig am 16.02.2032 | | 383.028 | | 292.863 | 0,52 |
| 6,750 % fällig am 21.09.2047 | | 2.959 | | 1.837 | 0,00 |
| 6,950 % fällig am 28.01.2060 | | 76.875 | | 47.559 | 0,08 |
| 7,690 % fällig am 23.01.2050 | | 14.280 | | 9.754 | 0,02 |
| **Prime Healthcare Services, Inc.** | | | | | |
| 7,250 % fällig am 01.11.2025 | | 35.984 | | 30.822 | 0,05 |
| **Prosus NV** | | | | | |
| 1,207 % fällig am 19.01.2026 | € | 7.100 | | 6.477 | 0,01 |
| 1,288 % fällig am 13.07.2029 | | 5.300 | | 4.146 | 0,01 |
| 1,985 % fällig am 13.07.2033 | | 13.800 | | 9.696 | 0,02 |
| 2,085 % fällig am 19.01.2030 | | 13.900 | | 11.132 | 0,02 |
| 2,778 % fällig am 19.01.2034 | | 11.700 | | 8.546 | 0,02 |
| 3,061 % fällig am 13.07.2031 | $ | 29.400 | | 21.674 | 0,04 |
| 3,257 % fällig am 19.01.2027 | | 10.800 | | 9.395 | 0,02 |
| 4,193 % fällig am 19.01.2032 | | 19.600 | | 15.669 | 0,03 |
| 4,987 % fällig am 19.01.2052 | | 16.400 | | 11.802 | 0,02 |
| **PTC, Inc.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.02.2025 | | 973 | | 922 | 0,00 |
| **Rede D'or Finance SARL** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 22.01.2030 | | 600 | | 507 | 0,00 |
| **RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.** | | | | | |
| 9,750 % fällig am 01.12.2026 | | 2.700 | | 2.631 | 0,00 |
| **Roadster Finance DAC** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 08.12.2032 | € | 7.000 | | 6.100 | 0,01 |
| **Rockefeller Foundation** | | | | | |
| 2,492 % fällig am 01.10.2050 | $ | 2.200 | | 1.604 | 0,00 |
| **Rolls-Royce PLC** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 09.05.2028 | € | 4.455 | | 3.487 | 0,01 |
| 3,375 % fällig am 18.06.2026 | £ | 25.843 | | 27.274 | 0,05 |
| 3,625 % fällig am 14.10.2025 | $ | 30.232 | | 26.989 | 0,05 |
| 4,625 % fällig am 16.02.2026 | € | 75.700 | | 74.539 | 0,13 |
| 5,750 % fällig am 15.10.2027 | £ | 24.271 | | 27.818 | 0,05 |
| 5,750 % fällig am 15.10.2027 | $ | 16.482 | | 14.898 | 0,03 |
| **Royal Caribbean Cruises Ltd.** | | | | | |
| 9,125 % fällig am 15.06.2023 | | 20.884 | | 20.703 | 0,04 |
| 10,875 % fällig am 01.06.2023 | | 21.974 | | 22.100 | 0,04 |
| 11,500 % fällig am 01.06.2025 | | 29.606 | | 30.493 | 0,05 |
| **Russian Railways Via RZD Capital PLC** | | | | | |
| 7,487 % fällig am 25.03.2031 ^ | £ | 13.950 | | 1.694 | 0,00 |
| **Sands China Ltd.** | | | | | |
| 2,550 % fällig am 08.03.2027 | $ | 15.600 | | 11.387 | 0,02 |
| 3,100 % fällig am 08.03.2029 | | 11.200 | | 7.944 | 0,01 |
| 3,250 % fällig am 08.08.2031 | | 9.900 | | 6.557 | 0,01 |
| 3,800 % fällig am 08.01.2026 | | 15.937 | | 12.794 | 0,02 |
| 4,875 % fällig am 18.06.2030 | | 11.980 | | 8.777 | 0,02 |
| 5,125 % fällig am 08.08.2025 | $ | 46.640 | $ | 39.204 | 0,07 |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028 | | 47.410 | | 36.631 | 0,06 |
| **Santos Finance Ltd.** | | | | | |
| 3,649 % fällig am 29.04.2031 | | 16.900 | | 14.353 | 0,03 |
| **Seagate HDD Cayman** | | | | | |
| 4,091 % fällig am 01.06.2029 | | 1.300 | | 1.120 | 0,00 |
| 4,125 % fällig am 15.01.2031 | | 15.282 | | 12.520 | 0,02 |
| 5,750 % fällig am 01.12.2034 | | 1.300 | | 1.146 | 0,00 |
| **Spirit Airlines Pass-Through Trust** | | | | | |
| 4,100 % fällig am 01.10.2029 | | 636 | | 610 | 0,00 |
| **Sprint Spectrum Co. LLC** | | | | | |
| 4,738 % fällig am 20.09.2029 | | 38.476 | | 38.511 | 0,07 |
| **Studio City Co. Ltd.** | | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.02.2027 | | 8.900 | | 7.728 | 0,01 |
| **Studio City Finance Ltd.** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2029 | | 11.340 | | 5.873 | 0,01 |
| **Surgery Center Holdings, Inc.** | | | | | |
| 10,000 % fällig am 15.04.2027 | | 2.300 | | 2.231 | 0,00 |
| **Sutter Health** | | | | | |
| 3,161 % fällig am 15.08.2040 | | 2.900 | | 2.284 | 0,00 |
| 3,361 % fällig am 15.08.2050 | | 19.400 | | 14.926 | 0,03 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | | |
| 4,441 % fällig am 24.04.2023 | | 1.900 | | 1.916 | 0,00 |
| 4,892 % fällig am 24.04.2025 | | 6.200 | | 6.222 | 0,01 |
| 5,182 % fällig am 24.04.2028 | | 19.130 | | 19.384 | 0,03 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.02.2026 | | 22.200 | | 20.019 | 0,04 |
| 3,375 % fällig am 15.04.2029 | | 60.630 | | 53.227 | 0,09 |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | | | | |
| 3,840 % fällig am 22.04.2051 | | 9.800 | | 7.620 | 0,01 |
| 3,940 % fällig am 22.04.2061 | | 21.500 | | 16.406 | 0,03 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Co. BV** | | | | | |
| 2,950 % fällig am 18.12.2022 | | 4.564 | | 4.502 | 0,01 |
| **Times Square Hotel Trust** | | | | | |
| 8,528 % fällig am 01.08.2026 | | 1.871 | | 1.925 | 0,00 |
| **Topaz Solar Farms LLC** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.09.2039 | | 5.848 | | 5.072 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 30.09.2039 | | 49.499 | | 45.017 | 0,08 |
| **Transocean Guardian Ltd.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.01.2024 | | 1.254 | | 1.161 | 0,00 |
| **Transocean, Inc.** | | | | | |
| 7,250 % fällig am 01.11.2025 | | 7.112 | | 5.273 | 0,01 |
| 7,500 % fällig am 15.01.2026 | | 3.660 | | 2.622 | 0,00 |
| 8,000 % fällig am 01.02.2027 | | 18.529 | | 12.440 | 0,02 |
| **Triumph Group, Inc.** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.09.2024 | | 3.248 | | 2.901 | 0,01 |
| **U.S. Airways Pass-Through Trust** | | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.05.2027 | | 3.291 | | 3.000 | 0,01 |
| **U.S. Renal Care, Inc.** | | | | | |
| 10,625 % fällig am 15.07.2027 | | 7.490 | | 2.827 | 0,01 |
| **Uber Technologies, Inc.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.08.2029 | | 13.581 | | 11.196 | 0,02 |
| 7,500 % fällig am 15.05.2025 | | 15.117 | | 15.009 | 0,03 |
| 8,000 % fällig am 01.11.2026 | | 1.180 | | 1.177 | 0,00 |
| **United Airlines Pass-Through Trust** | | | | | |
| 2,700 % fällig am 01.11.2033 | | 20.303 | | 17.373 | 0,03 |
| 3,500 % fällig am 01.09.2031 | | 834 | | 764 | 0,00 |
| 3,750 % fällig am 03.03.2028 | | 8.768 | | 8.364 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 11.10.2027 | | 554 | | 522 | 0,00 |
| 4,150 % fällig am 11.10.2025 | | 365 | | 359 | 0,00 |
| 4,150 % fällig am 25.02.2033 | | 796 | | 750 | 0,00 |
| 4,300 % fällig am 15.02.2027 | | 628 | | 601 | 0,00 |
| 5,875 % fällig am 15.04.2029 | | 102.679 | | 101.067 | 0,18 |
| **United Airlines, Inc.** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.04.2026 | | 20.500 | | 18.137 | 0,03 |
| 4,625 % fällig am 15.04.2029 | | 31.843 | | 27.121 | 0,05 |
| **United Group BV** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.07.2024 | € | 6.077 | | 5.794 | 0,01 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.02.2025 | $ | 56.378 | | 53.164 | 0,09 |
| **Usiminas International SARL** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 18.07.2026 | | 5.800 | | 5.695 | 0,01 |
| **Valaris Ltd. (8,250 % bar oder 12,000 % PIK)** | | | | | |
| 8,250 % fällig am 30.04.2028 (c) | | 1.983 | | 1.926 | 0,00 |
| **Vale Overseas Ltd.** | | | | | |
| 6,875 % fällig am 21.11.2036 | | 3.740 | | 4.023 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Venture Global Calcasieu Pass LLC** | | | |
| 3,875 % fällig am 15.08.2029 $ | 38.600 $ | 33.870 | 0,06 |
| 3,875 % fällig am 01.11.2033 | 164.200 | 135.953 | 0,24 |
| 4,125 % fällig am 15.08.2031 | 37.800 | 32.413 | 0,06 |
| **ViaSat, Inc.** | | | |
| 5,625 % fällig am 15.09.2025 | 44.671 | 36.191 | 0,06 |
| **Viking Cruises Ltd.** | | | |
| 13,000 % fällig am 15.05.2025 | 31.212 | 32.029 | 0,06 |
| **Viking Ocean Cruises Ship Ltd.** | | | |
| 5,625 % fällig am 15.02.2029 | 4.400 | 3.475 | 0,01 |
| **VMware, Inc.** | | | |
| 2,200 % fällig am 15.08.2031 | 2.400 | 1.892 | 0,00 |
| **VOC Escrow Ltd.** | | | |
| 5,000 % fällig am 15.02.2028 | 10.500 | 8.451 | 0,02 |
| **Wabtec Transportation Netherlands BV** | | | |
| 1,250 % fällig am 03.12.2027 € | 9.496 | 8.131 | 0,01 |
| **Weir Group PLC** | | | |
| 2,200 % fällig am 13.05.2026 $ | 20.600 | 18.137 | 0,03 |
| **Wesleyan University** | | | |
| 4,781 % fällig am 01.07.2116 | 2.100 | 1.919 | 0,00 |
| **Western Midstream Operating LP** | | | |
| 2,621 % fällig am 13.01.2023 | 5.587 | 5.560 | 0,01 |
| **Windstream Escrow LLC** | | | |
| 7,750 % fällig am 15.08.2028 | 31.560 | 25.493 | 0,04 |
| **Wynn Las Vegas LLC** | | | |
| 5,250 % fällig am 15.05.2027 | 26.303 | 22.564 | 0,04 |
| 5,500 % fällig am 01.03.2025 | 13.852 | 12.702 | 0,02 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | |
| 4,875 % fällig am 01.10.2024 | 5.648 | 4.208 | 0,01 |
| 5,125 % fällig am 15.12.2029 | 23.790 | 14.804 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2026 | 53.600 | 37.204 | 0,07 |
| 5,500 % fällig am 01.10.2027 | 7.714 | 5.003 | 0,01 |
| 5,625 % fällig am 26.08.2028 | 43.978 | 27.213 | 0,05 |
| **Wynn Resorts Finance LLC** | | | |
| 7,750 % fällig am 15.04.2025 | 11.824 | 11.523 | 0,02 |
| **Zayo Group Holdings, Inc.** | | | |
| 6,125 % fällig am 01.03.2028 | 5.345 | 3.874 | 0,01 |
| | | 6.064.160 | 10,67 |

## VERSORGUNGSUNTERNEHMEN

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Cleveland Electric Illuminating Co.** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.04.2028 | 890 | 838 | 0,00 |
| **FirstEnergy Corp.** | | | |
| 3,400 % fällig am 01.03.2050 | 2.500 | 1.700 | 0,00 |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC** | | | |
| 2,950 % fällig am 27.01.2029 | 183.800 | 55.140 | 0,10 |
| **India Green Energy Holdings** | | | |
| 5,375 % fällig am 29.04.2024 | 5.000 | 4.678 | 0,01 |
| **Jersey Central Power & Light Co.** | | | |
| 2,750 % fällig am 01.03.2032 | 5.600 | 4.770 | 0,01 |
| **Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC** | | | |
| 4,100 % fällig am 15.05.2028 | 434 | 424 | 0,00 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | |
| 6,720 % fällig am 01.12.2022 ^ | 384 | 370 | 0,00 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | |
| 1,367 % fällig am 10.03.2023 | 61.700 | 60.775 | 0,11 |
| 1,700 % fällig am 15.11.2023 | 46.400 | 44.740 | 0,08 |
| 2,100 % fällig am 01.08.2027 | 7.177 | 6.022 | 0,01 |
| 2,500 % fällig am 01.02.2031 | 12.391 | 9.490 | 0,02 |
| 2,950 % fällig am 01.03.2026 ^ | 97.875 | 89.056 | 0,16 |
| 3,000 % fällig am 15.06.2028 | 31.800 | 27.435 | 0,05 |
| 3,150 % fällig am 01.01.2026 | 60.363 | 55.351 | 0,10 |
| 3,250 % fällig am 15.06.2023 ^ | 59.082 | 58.258 | 0,10 |
| 3,250 % fällig am 16.02.2024 | 66.100 | 64.421 | 0,11 |
| 3,250 % fällig am 01.06.2031 | 37.030 | 29.947 | 0,05 |
| 3,300 % fällig am 15.03.2027 ^ | 19.465 | 17.456 | 0,03 |
| 3,300 % fällig am 01.12.2027 ^ | 106.702 | 93.259 | 0,16 |
| 3,300 % fällig am 01.08.2040 | 5.115 | 3.534 | 0,01 |
| 3,400 % fällig am 15.08.2024 ^ | 51.393 | 49.436 | 0,09 |
| 3,450 % fällig am 01.07.2025 | 103.044 | 97.006 | 0,17 |
| 3,500 % fällig am 15.06.2025 ^ | 63.544 | 60.237 | 0,11 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2050 | 18.858 | 12.632 | 0,02 |
| 3,750 % fällig am 15.02.2024 ^ | 29.892 | 29.234 | 0,05 |
| 3,750 % fällig am 01.07.2028 | 113.694 | 100.477 | 0,18 |
| 3,750 % fällig am 15.08.2042 ^ | 20.803 | 14.115 | 0,02 |
| 3,850 % fällig am 15.11.2023 ^ | 17.368 | 17.143 | 0,03 |
| 3,950 % fällig am 01.12.2047 ^ | 5.300 | 3.680 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 01.12.2046 ^ | 16.783 | 11.801 | 0,02 |
| 4,200 % fällig am 01.03.2029 $ | 32.300 $ | 28.862 | 0,05 |
| 4,200 % fällig am 01.06.2041 | 4.900 | 3.596 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 01.08.2023 | 30.771 | 30.611 | 0,05 |
| 4,250 % fällig am 15.03.2046 ^ | 25.035 | 18.332 | 0,03 |
| 4,300 % fällig am 15.03.2045 ^ | 66.234 | 48.264 | 0,08 |
| 4,400 % fällig am 01.03.2032 | 33.000 | 28.684 | 0,05 |
| 4,450 % fällig am 15.04.2042 ^ | 33.949 | 25.550 | 0,04 |
| 4,500 % fällig am 01.07.2040 | 87.391 | 67.864 | 0,12 |
| 4,500 % fällig am 15.12.2041 ^ | 4.657 | 3.433 | 0,01 |
| 4,550 % fällig am 01.07.2030 | 210.515 | 187.255 | 0,33 |
| 4,600 % fällig am 15.06.2043 ^ | 41.543 | 31.767 | 0,06 |
| 4,650 % fällig am 01.08.2028 | 4.100 | 3.802 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 15.02.2044 ^ | 31.088 | 23.883 | 0,04 |
| 4,950 % fällig am 08.06.2025 | 15.300 | 15.018 | 0,03 |
| 4,950 % fällig am 01.07.2050 | 160.171 | 128.108 | 0,23 |
| 5,250 % fällig am 01.03.2052 | 33.000 | 27.250 | 0,05 |
| 5,450 % fällig am 15.06.2027 | 12.900 | 12.496 | 0,02 |
| 5,900 % fällig am 15.06.2032 | 10.000 | 9.677 | 0,02 |
| **Pennsylvania Electric Co.** | | | |
| 3,250 % fällig am 15.03.2028 | 2.360 | 2.192 | 0,00 |
| **Peru LNG SRL** | | | |
| 5,375 % fällig am 22.03.2030 | 600 | 486 | 0,00 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | |
| 6,250 % fällig am 14.12.2026 £ | 37.833 | 44.660 | 0,08 |
| 6,625 % fällig am 16.01.2034 | 6.800 | 7.602 | 0,01 |
| 6,850 % fällig am 05.06.2115 $ | 2.868 | 2.362 | 0,00 |
| **PG&E Wildfire Recovery Funding LLC** | | | |
| 4,263 % fällig am 01.06.2038 | 16.100 | 16.218 | 0,03 |
| 4,377 % fällig am 01.06.2041 | 17.800 | 17.600 | 0,03 |
| 4,451 % fällig am 01.12.2049 | 91.730 | 92.625 | 0,16 |
| 4,674 % fällig am 01.12.2053 | 20.700 | 20.720 | 0,04 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | |
| 8,200 % fällig am 06.04.2028 | 17.822 | 18.544 | 0,03 |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | 13.804 | 14.318 | 0,02 |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027 | 8.407 | 8.965 | 0,02 |
| **Southern California Edison Co.** | | | |
| 4,650 % fällig am 01.10.2043 | 27.323 | 24.866 | 0,04 |
| 4,875 % fällig am 01.03.2049 | 6.798 | 6.175 | 0,01 |
| **Sprint Capital Corp.** | | | |
| 8,750 % fällig am 15.03.2032 | 12.200 | 14.722 | 0,03 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.11.2022 | 114.116 | 114.956 | 0,20 |
| **Sprint Corp.** | | | |
| 7,125 % fällig am 15.06.2024 | 94.180 | 96.944 | 0,17 |
| 7,625 % fällig am 15.02.2025 | 600 | 626 | 0,00 |
| 7,625 % fällig am 01.03.2026 | 20.490 | 21.634 | 0,04 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2023 | 220.500 | 227.997 | 0,40 |
| **Transocean Phoenix Ltd.** | | | |
| 7,750 % fällig am 15.10.2024 | 8.795 | 8.389 | 0,01 |
| **Transocean Proteus Ltd.** | | | |
| 6,250 % fällig am 01.12.2024 | 226 | 211 | 0,00 |
| | | 2.480.689 | 4,36 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | 15.929.391 | 28,03 |

## WANDELANLEIHEN & WECHSEL

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Multiplan Corp. (6,000 % bar oder 7,000 % PIK)** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.10.2027 (c) | 30.000 | 24.795 | 0,04 |

## KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Chicago, Illinois General Obligation Bonds, Series 2015** | | | |
| 7,750 % fällig am 01.01.2042 | 952 | 1.020 | 0,00 |
| **Chicago, Illinois General Obligation Bonds, Series 2017** | | | |
| 7,045 % fällig am 01.01.2029 | 2.205 | 2.333 | 0,00 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2021** | | | |
| 0,000 % fällig am 01.07.2033 (e) | 15.405 | 8.676 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2033 | 11.971 | 10.997 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2035 | 10.760 | 9.665 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2037 | 9.235 | 8.197 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2041 | 8.240 | 7.154 | 0,01 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2022** | | | |
| 0,000 % fällig am 01.11.2043 | 59.613 | 29.732 | 0,05 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Notes, Series 2021** | | | |
| 0,000 % fällig am 01.07.2024 (e) | 6.158 | 5.639 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 01.07.2023 | 13.370 | 13.616 | 0,02 |
| **Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.06.2046 $ | 3.360 $ | 2.956 | 0,01 |
| 3,850 % fällig am 01.06.2050 | 2.500 | 2.258 | 0,00 |
| 4,214 % fällig am 01.06.2050 | 13.300 | 10.870 | 0,02 |
| **Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021** | | | |
| 1,850 % fällig am 01.06.2031 | 195 | 191 | 0,00 |
| **Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010** | | | |
| 6,630 % fällig am 01.02.2035 | 7.945 | 8.470 | 0,02 |
| 6,725 % fällig am 01.04.2035 | 2.695 | 2.859 | 0,01 |
| 7,350 % fällig am 01.07.2035 | 8.020 | 8.757 | 0,02 |
| **Illinois State General Obligation Bonds, Series 2003** | | | |
| 5,100 % fällig am 01.06.2033 | 9.630 | 9.700 | 0,02 |
| **Pennsylvania Higher Education Assistance Agency Revenue Bonds, Series 2006** | | | |
| 1,314 % fällig am 25.10.2036 | 8.213 | 8.126 | 0,01 |
| **Puerto Rico Electric Power Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | |
| 6,050 % fällig am 01.07.2032 ^ | 6.790 | 5.457 | 0,01 |
| 6,125 % fällig am 01.07.2040 ^ | 435 | 350 | 0,00 |
| **Puerto Rico Electric Power Authority Revenue Bonds, Series 2008** | | | |
| 5,375 % fällig am 01.07.2022 ^ | 2.355 | 2.005 | 0,00 |
| **University of California Revenue Bonds, Series 2012** | | | |
| 4,858 % fällig am 15.05.2112 | 12.280 | 11.711 | 0,02 |
| | | 170.739 | 0,30 |

## US-REGIERUNGSBEHÖRDEN

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Fannie Mae** | | | |
| 0,179 % fällig am 27.12.2022 (a) | 34.062 | 0 | 0,00 |
| 0,491 % fällig am 25.08.2022 (a) | 1.073 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 25.12.2027 - 25.02.2028 (a) | 6.024 | 277 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 25.06.2042 - 25.02.2046 (a) | 583 | 78 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 01.06.2051 - 01.07.2052 | 19.984 | 18.757 | 0,03 |
| 3,026 % fällig am 25.03.2035 (a) | 146 | 10 | 0,00 |
| 3,500 % fällig am 25.12.2049 (a) | 6.913 | 1.595 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 01.01.2059 | 10.741 | 10.724 | 0,02 |
| 4,376 % fällig am 25.10.2049 (a) | 44.008 | 7.683 | 0,01 |
| 4,426 % fällig am 25.04.2044 - 25.02.2049 (a) | 8.606 | 957 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 25.09.2040 | 2.563 | 2.642 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 25.12.2042 (a) | 162 | 29 | 0,00 |
| 4,576 % fällig am 25.05.2048 (a) | 17.200 | 2.995 | 0,01 |
| 5,000 % fällig am 01.05.2034 - 25.08.2037 | 7 | 7 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 01.05.2033 - 25.05.2038 | 115 | 129 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 01.12.2023 - 01.05.2038 | 0 | 0 | 0,00 |
| 6,051 % fällig am 25.08.2033 | 213 | 205 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 01.03.2029 | 0 | 0 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 01.04.2029 | 0 | 0 | 0,00 |
| 8,629 % fällig am 25.05.2041 | 40 | 37 | 0,00 |
| 29,859 % fällig am 25.07.2037 | 7 | 10 | 0,00 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 0,818 % fällig am 25.01.2023 (a) | 23.198 | 52 | 0,00 |
| 1,111 % fällig am 25.04.2029 (a) | 42.909 | 1.927 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 15.09.2027 (a) | 6.429 | 303 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 15.12.2032 - 15.04.2049 (a) | 4.300 | 1.033 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 01.11.2046 - 01.05.2049 | 2.273 | 2.154 | 0,00 |
| 3,011 % fällig am 25.12.2047 | 5.354 | 5.342 | 0,01 |
| 3,089 % fällig am 25.10.2046 | 5.553 | 5.511 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 15.12.2032 - 15.06.2049 (a) | 8.808 | 1.661 | 0,00 |
| 3,500 % fällig am 01.07.2046 - 01.05.2049 | 9.417 | 9.211 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 01.04.2025 - 01.11.2047 | 70 | 70 | 0,00 |
| 4,000& fällig am 15.06.2049 (a) | 5.022 | 1.364 | 0,00 |
| 4,318 % fällig am 25.10.2052 | 123.155 | 118.428 | 0,21 |
| 4,376 % fällig am 25.12.2049 (a) | 25.864 | 2.567 | 0,00 |
| 4,440 % fällig am 25.11.2052 | 144.888 | 144.633 | 0,25 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2048 | 9.947 | 10.049 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 4,500 % fällig am 15.05.2049 (a) | $ | 4.116$ | 943 | 0,00 |
| 4,826 % fällig am 15.11.2042 (a) | | 3.953 | 553 | 0,00 |
| 4,876 % fällig am 15.01.2042 (a) | | 252 | 29 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 15.02.2049 (a) | | 815 | 150 | 0,00 |
| 5,426 % fällig am 15.03.2037 (a) | | 85 | 11 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 01.08.2033 - 01.04.2036 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 01.01.2033 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 01.02.2032 - 25.11.2049 | | 3.233 | 3.658 | 0,01 |
| 6,818 % fällig am 15.10.2033 | | 477 | 480 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 01.12.2025 - 01.06.2037 | | 8 | 6 | 0,00 |
| 7,252 % fällig am 15.01.2041 | | 531 | 526 | 0,00 |
| 8,000 % fällig am 01.07.2030 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Ginnie Mae** | | | | |
| 0,151 % fällig am 16.05.2050 (a) | | 809 | 2 | 0,00 |
| 1,032 % fällig am 20.09.2067 | | 13.483 | 13.503 | 0,02 |
| 1,047 % fällig am 20.07.2067 | | 15.202 | 15.162 | 0,03 |
| 1,253 % fällig am 20.08.2066 | | 24 | 24 | 0,00 |
| 1,373 % fällig am 20.04.2062 | | 637 | 633 | 0,00 |
| 1,403 % fällig am 20.01.2062 | | 23 | 23 | 0,00 |
| 1,503 % fällig am 20.08.2066 | | 4.760 | 4.741 | 0,01 |
| 1,603 % fällig am 20.06.2066 | | 9.418 | 9.396 | 0,02 |
| 1,625 % fällig am 20.07.2045 | | 11.644 | 11.544 | 0,02 |
| 1,653 % fällig am 20.07.2066 | | 2.751 | 2.747 | 0,00 |
| 1,685 % fällig am 20.05.2049 (a) | | 45.286 | 2.144 | 0,00 |
| 1,723 % fällig am 20.07.2065 | | 15.473 | 15.466 | 0,03 |
| 2,205 % fällig am 20.01.2049 (a) | | 8.773 | 284 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 20.04.2052 | | 65.562 | 60.136 | 0,11 |
| 3,096 % fällig am 20.09.2066 | | 20.323 | 20.973 | 0,04 |
| 3,379 % fällig am 20.06.2067 | | 27.016 | 26.948 | 0,05 |
| 3,394 % fällig am 20.09.2066 | | 9.823 | 10.075 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 20.03.2043 (a) | | 793 | 141 | 0,00 |
| 4,641 % fällig am 16.01.2043 (a) | | 804 | 82 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 15.04.2037 - 20.11.2038 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 6,310 % fällig am 20.12.2040 | | 1.872 | 1.734 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 15.06.2023 - 15.09.2037 | | 6 | 4 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 15.05.2023 - 15.05.2038 | | 3 | 1 | 0,00 |
| 7,500 % fällig am 20.11.2022 - 20.01.2030 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 7,877 % fällig am 20.12.2040 | | 181 | 151 | 0,00 |
| 8,000 % fällig am 15.07.2024 - 15.05.2032 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 8,500 % fällig am 15.01.2031 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 17,692 % fällig am 20.04.2037 | | 9 | 10 | 0,00 |
| **Ginnie Mae, TBA** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.07.2052 | | 609.700 | 592.552 | 1,04 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2052 | | 137.100 | 136.286 | 0,24 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2052 | | 10.700 | 10.820 | 0,02 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.06.2031 - 01.03.2032 | | 407 | 399 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 01.02.2025 - 01.07.2052 | | 1.218.509 | 1.140.422 | 2,01 |
| 3,500 % fällig am 01.11.2025 - 01.07.2052 | | 734.771 | 710.773 | 1,25 |
| 4,000 % fällig am 01.11.2023 - 01.07.2051 | | 207.134 | 207.352 | 0,36 |
| 4,500 % fällig am 01.11.2023 - 01.08.2048 | | 14.469 | 14.749 | 0,03 |
| 5,000 % fällig am 01.05.2026 - 01.04.2049 | | 2.352 | 2.423 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 01.12.2034 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 01.11.2022 - 01.10.2038 | | 2 | 0 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 01.07.2022 - 01.10.2039 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 7,500 % fällig am 01.04.2029 - 01.10.2030 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 8,000 % fällig am 01.12.2022 - 01.03.2030 | $ | 1$ | 1 | 0,00 |
| 8,500 % fällig am 01.04.2025 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.07.2037 | | 200 | 187 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.07.2037 - 01.07.2052 | | 332.850 | 299.507 | 0,53 |
| 3,000 % fällig am 01.07.2037 - 01.08.2052 | | 2.590.689 | 2.415.889 | 4,25 |
| 3,500 % fällig am 01.07.2052 | | 7.056.648 | 6.783.046 | 11,93 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2052 | | 2.693.484 | 2.652.292 | 4,67 |
| 5,000 % fällig am 01.07.2052 | | 100 | 102 | 0,00 |
| | | | 15.519.523 | 27,29 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | | |
| 1,250 % fällig am 15.05.2050 | | 500.000 | 318.340 | 0,56 |
| 1,375 % fällig am 15.08.2050 | | 830.000 | 546.714 | 0,96 |
| 2,250 % fällig am 15.02.2052 | | 260.620 | 214.563 | 0,38 |
| 2,500 % fällig am 15.02.2045 (m) | | 59.000 | 50.085 | 0,09 |
| 2,875 % fällig am 15.05.2043 | | 69.079 | 63.051 | 0,11 |
| 2,875 % fällig am 15.08.2045 | | 510.010 | 463.711 | 0,81 |
| 3,000 % fällig am 15.11.2044 | | 371.252 | 344.380 | 0,61 |
| 3,000 % fällig am 15.08.2048 | | 81.815 | 77.344 | 0,14 |
| 3,000 % fällig am 15.02.2049 (m) | | 10.169 | 9.695 | 0,02 |
| 3,125 % fällig am 15.02.2043 | | 178.076 | 169.346 | 0,30 |
| 3,125 % fällig am 15.08.2044 | | 283.117 | 268.430 | 0,47 |
| 3,125 % fällig am 15.05.2048 | | 55.840 | 54.067 | 0,09 |
| 3,375 % fällig am 15.05.2044 | | 416.095 | 411.040 | 0,72 |
| 3,625 % fällig am 15.02.2044 | | 145.436 | 149.345 | 0,26 |
| 3,750 % fällig am 15.11.2043 | | 80.988 | 84.787 | 0,15 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (g)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2030 | | 285.762 | 272.733 | 0,48 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2031 | | 28.504 | 27.126 | 0,05 |
| 0,250 % fällig am 15.07.2029 | | 830.919 | 806.244 | 1,42 |
| 0,250 % fällig am 15.02.2050 | | 109.171 | 86.375 | 0,15 |
| 0,375 % fällig am 15.01.2027 | | 18.214 | 18.154 | 0,03 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2027 | | 4.916 | 4.900 | 0,01 |
| 0,625 % fällig am 15.02.2043 | | 15.213 | 13.466 | 0,02 |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 | | 162.182 | 163.437 | 0,29 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2042 | | 43.110 | 39.456 | 0,07 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2045 | | 143.214 | 128.480 | 0,22 |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 | | 194.940 | 196.882 | 0,35 |
| 0,875 % fällig am 15.02.2047 | | 110.764 | 102.552 | 0,18 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2046 | | 59.411 | 56.407 | 0,10 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2048 | | 131.636 | 125.913 | 0,22 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2049 | | 346.244 | 333.907 | 0,59 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 | | 16.620 | 17.029 | 0,03 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2040 | | 21.933 | 25.639 | 0,04 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2041 | | 9.900 | 11.519 | 0,02 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.08.2026 | | 56.200 | 52.793 | 0,09 |
| 2,000 % fällig am 15.02.2025 | | 15.000 | 14.619 | 0,03 |
| 2,000 % fällig am 15.08.2025 | | 110.000 | 106.601 | 0,19 |
| 2,000 % fällig am 15.11.2026 | | 9.100 | 8.702 | 0,02 |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 | | 132.200 | 128.993 | 0,23 |
| 2,250 % fällig am 15.11.2025 | | 57.430 | 55.954 | 0,10 |
| 2,250 % fällig am 15.02.2027 | | 262.600 | 253.255 | 0,45 |
| 2,375 % fällig am 31.03.2029 | | 139.700 | 133.749 | 0,23 |
| 2,375 % fällig am 15.05.2029 | | 255.400 | 244.710 | 0,43 |
| 2,625 % fällig am 31.01.2026 | | 631.400 | 622.435 | 1,09 |
| 2,875 % fällig am 15.08.2028 | | 500 | 494 | 0,00 |
| 2,875 % fällig am 15.05.2032 | | 248.790 | 246.030 | 0,43 |
| | | | 7.523.452 | 13,23 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **20 Times Square Trust** | | | | |
| 3,203 % fällig am 15.05.2035 | | 54.000 | 51.985 | 0,09 |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 1,864 % fällig am 25.08.2036 | | 12.616 | 5.221 | 0,01 |
| 1,964 % fällig am 25.05.2036 | | 5.875 | 2.385 | 0,01 |
| 2,044 % fällig am 25.06.2037 | | 3.052 | 3.177 | 0,01 |
| 2,144 % fällig am 25.01.2036 | | 293 | 270 | 0,00 |
| 2,164 % fällig am 25.02.2036 | | 194 | 124 | 0,00 |
| 2,755 % fällig am 25.08.2035 | | 322 | 243 | 0,00 |
| 2,774 % fällig am 25.01.2035 ^ | | 1.703 | 1.498 | 0,00 |
| 2,774 % fällig am 25.03.2035 | | 2.225 | 1.932 | 0,00 |
| 2,828 % fällig am 25.01.2036 | | 590 | 492 | 0,00 |
| 2,850 % fällig am 25.04.2035 | $ | 6 $ | 6 | 0,00 |
| 2,918 % fällig am 25.09.2035 | | 3.360 | 2.885 | 0,01 |
| 3,223 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 131 | 120 | 0,00 |
| 3,743 % fällig am 25.03.2037 | | 869 | 761 | 0,00 |
| 5,463 % fällig am 25.11.2037 ^ | | 821 | 634 | 0,00 |
| **Alba PLC** | | | | |
| 1,059 % fällig am 17.03.2039 | £ | 5.037 | 5.911 | 0,01 |
| **Alliance Bancorp Trust** | | | | |
| 2,104 % fällig am 25.07.2037 | $ | 1.055 | 916 | 0,00 |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | | |
| 1,176 % fällig am 25.02.2047 | | 25.468 | 11.887 | 0,02 |
| 1,396 % fällig am 25.11.2046 | | 31.468 | 10.273 | 0,02 |
| 1,416 % fällig am 25.10.2046 | | 4.428 | 3.301 | 0,01 |
| 1,744 % fällig am 25.10.2046 | | 4.848 | 4.235 | 0,01 |
| 1,749 % fällig am 25.03.2047 | | 1.459 | 1.315 | 0,00 |
| 1,814 % fällig am 25.10.2046 | | 11.215 | 7.316 | 0,01 |
| 2,004 % fällig am 25.09.2046 ^ | | 2.624 | 2.363 | 0,01 |
| 2,204 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 2.134 | 1.981 | 0,00 |
| 2,770 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 1.588 | 1.320 | 0,00 |
| 6,750 % fällig am 25.11.2046 | | 7.019 | 6.153 | 0,01 |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 1,814 % fällig am 25.05.2047 | | 2.293 | 1.301 | 0,00 |
| 1,904 % fällig am 25.03.2046 | | 8.416 | 7.686 | 0,01 |
| 1,984 % fällig am 25.12.2046 | | 7.801 | 6.795 | 0,01 |
| 2,024 % fällig am 25.03.2046 | | 3.254 | 2.995 | 0,01 |
| 2,224 % fällig am 25.09.2045 | | 1.384 | 1.250 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.11.2045 | | 6.053 | 4.549 | 0,01 |
| 2,449 % fällig am 25.02.2045 | | 8.258 | 7.949 | 0,02 |
| 3,687 % fällig am 25.09.2035 | | 3.561 | 1.726 | 0,00 |
| 3,836 % fällig am 25.12.2036 | | 4.677 | 4.059 | 0,01 |
| 5,883 % fällig am 25.09.2035 | | 13.514 | 8.319 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 25.03.2047 | | 810 | 666 | 0,00 |
| 6,950 % fällig am 25.06.2036 | | 7.599 | 1.511 | 0,00 |
| **Angel Oak Mortgage Trust** | | | | |
| 1,469 % fällig am 25.06.2065 | | 2.284 | 2.190 | 0,00 |
| **APS Resecuritization Trust** | | | | |
| 1,294 % fällig am 27.06.2049 | | 2.326 | 2.149 | 0,00 |
| **Ashford Hospitality Trust** | | | | |
| 2,724 % fällig am 15.04.2035 | | 2.500 | 2.376 | 0,01 |
| **Atlas Funding PLC** | | | | |
| 1,388 % fällig am 25.07.2058 | £ | 23.884 | 28.740 | 0,05 |
| **Avon Finance PLC** | | | | |
| 1,690 % fällig am 20.09.2048 | | 65.038 | 78.587 | 0,14 |
| **Banc of America Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,024 % fällig am 25.01.2037 ^ | $ | 2.064 | 1.599 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 175 | 162 | 0,00 |
| 5,913 % fällig am 25.10.2036 | | 10.467 | 3.526 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 226 | 202 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 389 | 331 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2046 ^ | | 599 | 544 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2046 | | 1.605 | 1.253 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2046 ^ | | 1.682 | 1.471 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 2.265 | 2.071 | 0,00 |
| **Banc of America Funding Corp.** | | | | |
| 4,017 % fällig am 25.09.2048 | | 1.881 | 1.778 | 0,00 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 1,136 % fällig am 26.10.2036 | | 9.922 | 9.116 | 0,02 |
| 1,144 % fällig am 27.08.2036 | | 17.659 | 16.532 | 0,03 |
| 1,266 % fällig am 26.07.2036 | | 5.061 | 3.862 | 0,01 |
| 1,684 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 2.553 | 2.318 | 0,01 |
| 1,724 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 3.485 | 3.249 | 0,01 |
| 1,759 % fällig am 29.04.2037 | | 7.196 | 6.291 | 0,01 |
| 1,843 % fällig am 26.05.2037 | | 7.479 | 6.749 | 0,01 |
| 1,862 % fällig am 20.05.2035 | | 160 | 160 | 0,00 |
| 1,904 % fällig am 25.07.2037 | | 217 | 202 | 0,00 |
| 1,914 % fällig am 25.05.2037 | | 5.036 | 4.708 | 0,01 |
| 1,914 % fällig am 25.07.2037 | | 2.136 | 1.986 | 0,00 |
| 1,932 % fällig am 20.02.2047 | | 3.729 | 3.486 | 0,01 |
| 1,992 % fällig am 20.10.2036 | | 2.562 | 2.007 | 0,00 |
| 1,992 % fällig am 20.12.2046 ^ | | 1.121 | 1.048 | 0,00 |
| 2,032 % fällig am 20.04.2047 ^ | | 740 | 693 | 0,00 |
| 2,032 % fällig am 20.06.2047 | | 606 | 518 | 0,00 |
| 2,172 % fällig am 20.06.2047 | | 2.490 | 2.152 | 0,00 |
| 2,212 % fällig am 20.05.2047 | | 1.659 | 1.550 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 203 | 186 | 0,00 |
| 2,501 % fällig am 20.06.2032 | | 3 | 3 | 0,00 |
| 2,522 % fällig am 20.11.2034 | | 43 | 42 | 0,00 |
| 2,561 % fällig am 20.11.2035 ^ | | 244 | 234 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 20.09.2035 ^ | | 830 | 734 | 0,00 |
| 2,683 % fällig am 20.05.2036 | | 1.421 | 1.358 | 0,00 |
| 2,694 % fällig am 20.07.2036 | | 137 | 132 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 2,711 % fällig am 20.05.2036 ^ | $ | 282 $ | 267 | 0,00 |
| 2,742 % fällig am 20.02.2036 ^ | | 49 | 45 | 0,00 |
| 2,810 % fällig am 20.05.2036 ^ | | 233 | 223 | 0,00 |
| 2,949 % fällig am 20.09.2046 ^ | | 91 | 81 | 0,00 |
| 2,972 % fällig am 20.06.2047 | | 4.914 | 4.313 | 0,01 |
| 3,212 % fällig am 20.07.2047 ^ | | 933 | 912 | 0,00 |
| 3,218 % fällig am 20.11.2035 | | 3.516 | 3.062 | 0,01 |
| 3,258 % fällig am 20.05.2035 ^ | | 824 | 760 | 0,00 |
| 3,266 % fällig am 20.01.2047 ^ | | 178 | 161 | 0,00 |
| 3,461 % fällig am 20.01.2047 ^ | | 1.843 | 1.737 | 0,00 |
| 4,446 % fällig am 20.07.2036 | | 2.274 | 2.235 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.01.2036 | | 38 | 38 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 60 | 53 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.11.2035 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2036 | | 121 | 107 | 0,00 |
| 5,763 % fällig am 25.10.2036 | | 220 | 203 | 0,00 |
| 5,773 % fällig am 25.05.2037 | | 94 | 91 | 0,00 |
| 5,846 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 214 | 200 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 617 | 528 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 | | 229 | 207 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 805 | 709 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 1.776 | 1.566 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 26.10.2037 | | 1.419 | 1.263 | 0,00 |
| 6,347 % fällig am 25.01.2037 | | 667 | 619 | 0,00 |
| 6,479 % fällig am 25.10.2036 | | 562 | 517 | 0,00 |
| 13,099 % fällig am 26.07.2035 | | 138 | 132 | 0,00 |
| **Banc of America Merrill Linch Trust** | | | | |
| 6,018 % fällig am 17.06.2050 | | 200 | 66 | 0,00 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | | |
| 2,485 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 677 | 549 | 0,00 |
| 2,562 % fällig am 25.01.2035 | | 893 | 873 | 0,00 |
| 2,618 % fällig am 20.10.2046 ^ | | 250 | 233 | 0,00 |
| 2,874 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 1.528 | 1.481 | 0,00 |
| 2,945 % fällig am 20.11.2046 ^ | | 182 | 166 | 0,00 |
| 2,954 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 78 | 70 | 0,00 |
| 3,066 % fällig am 25.07.2035 | | 1.192 | 1.124 | 0,00 |
| 3,337 % fällig am 25.02.2036 | | 340 | 291 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 670 | 578 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 | | 232 | 193 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2046 ^ | | 20 | 17 | 0,00 |
| **Barclays Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 3,715 % fällig am 15.07.2037 | | 28.583 | 27.322 | 0,05 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 0,000 % fällig am 26.08.2036 | | 1.246 | 554 | 0,00 |
| 1,176 % fällig am 26.01.2037 | | 4.709 | 4.156 | 0,01 |
| 1,804 % fällig am 25.03.2037 | | 6.726 | 6.209 | 0,01 |
| 1,904 % fällig am 25.04.2037 | | 1.835 | 1.698 | 0,00 |
| 2,004 % fällig am 25.10.2036 | | 64 | 61 | 0,00 |
| 2,044 % fällig am 25.04.2037 | | 72 | 68 | 0,00 |
| 2,044 % fällig am 25.05.2047 | | 270 | 252 | 0,00 |
| 2,124 % fällig am 25.02.2047 | | 1.143 | 1.041 | 0,00 |
| 2,824 % fällig am 25.10.2047 | | 2.749 | 2.381 | 0,01 |
| 2,844 % fällig am 26.02.2036 | | 1.367 | 1.369 | 0,00 |
| 2,924 % fällig am 25.09.2047 | | 1.225 | 1.143 | 0,00 |
| 3,012 % fällig am 26.04.2047 | | 3.432 | 3.224 | 0,01 |
| 3,053 % fällig am 26.03.2037 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 3,104 % fällig am 26.07.2037 | | 3.925 | 3.624 | 0,01 |
| 3,367 % fällig am 26.07.2037 | | 602 | 551 | 0,00 |
| 4,737 % fällig am 26.03.2037 | | 253 | 251 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 26.05.2037 | | 2.849 | 1.639 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 26.02.2036 | | 974 | 757 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 26.08.2036 | | 3.247 | 1.757 | 0,00 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,116 % fällig am 25.12.2046 ^ | | 5.246 | 4.477 | 0,01 |
| 2,535 % fällig am 25.10.2033 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,718 % fällig am 25.02.2047 | | 2.664 | 2.440 | 0,01 |
| 2,769 % fällig am 25.06.2035 ^ | | 267 | 264 | 0,00 |
| 2,793 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 850 | 724 | 0,00 |
| 2,876 % fällig am 25.10.2035 | | 535 | 523 | 0,00 |
| 2,984 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 2.504 | 2.227 | 0,00 |
| 3,068 % fällig am 25.10.2046 | | 1.824 | 1.589 | 0,00 |
| 3,090 % fällig am 25.08.2047 ^ | | 1.970 | 1.691 | 0,00 |
| 3,243 % fällig am 25.03.2035 | | 19 | 19 | 0,00 |
| 3,250 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 221 | 198 | 0,00 |
| 3,260 % fällig am 25.05.2047 ^ | | 128 | 110 | 0,00 |
| 3,278 % fällig am 25.05.2047 ^ | | 3.652 | 3.428 | 0,01 |
| 3,333 % fällig am 25.06.2035 ^ | | 23 | 22 | 0,00 |
| 3,820 % fällig am 25.07.2034 | | 1 | 1 | 0,00 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.08.2036 | | 6.610 | 6.037 | 0,01 |
| 1,944 % fällig am 25.06.2046 ^ | | 3.599 | 3.165 | 0,01 |
| 1,964 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 18.200 | 16.791 | 0,03 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 1,964 % fällig am 25.12.2046 ^ | $ | 6.193 $ | 5.678 | 0,01 |
| 2,064 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 3.214 | 4.798 | 0,01 |
| 2,104 % fällig am 25.02.2036 | | 1.569 | 1.550 | 0,00 |
| 2,124 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 797 | 1.076 | 0,00 |
| 2,164 % fällig am 25.10.2035 | | 4.396 | 4.257 | 0,01 |
| 2,264 % fällig am 25.04.2034 | | 3 | 3 | 0,00 |
| 2,324 % fällig am 25.10.2035 | | 438 | 409 | 0,00 |
| 2,344 % fällig am 25.08.2035 | | 5.645 | 5.347 | 0,01 |
| 2,596 % fällig am 25.09.2034 | | 263 | 245 | 0,00 |
| 2,749 % fällig am 25.01.2035 | | 1.625 | 1.691 | 0,00 |
| 2,752 % fällig am 25.05.2035 | | 403 | 388 | 0,00 |
| 2,929 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 3.758 | 1.805 | 0,00 |
| 2,943 % fällig am 25.09.2035 | | 1.689 | 1.461 | 0,00 |
| 2,944 % fällig am 25.08.2046 ^ | | 4.774 | 3.524 | 0,01 |
| 2,954 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 5.377 | 3.037 | 0,01 |
| 2,994 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 938 | 917 | 0,00 |
| 3,011 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 1.825 | 843 | 0,00 |
| 3,044 % fällig am 25.10.2033 | | 3 | 3 | 0,00 |
| 3,047 % fällig am 25.01.2047 | | 595 | 364 | 0,00 |
| 3,074 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 1.629 | 1.082 | 0,00 |
| 3,282 % fällig am 25.12.2046 ^ | | 265 | 201 | 0,00 |
| 3,361 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 1.408 | 1.309 | 0,00 |
| 3,370 % fällig am 25.09.2047 | | 20.315 | 13.145 | 0,02 |
| 3,497 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 1.976 | 1.138 | 0,00 |
| 3,566 % fällig am 25.07.2035 | | 795 | 704 | 0,00 |
| 4,040 % fällig am 25.07.2035 ^ | | 333 | 255 | 0,00 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,024 % fällig am 25.10.2034 | | 68 | 65 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 3.117 | 1.748 | 0,00 |
| 5,125 % fällig am 25.03.2034 | | 443 | 452 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.08.2035 | | 2.252 | 1.627 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 | | 208 | 188 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.11.2034 ^ | | 1.757 | 1.571 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.03.2037 | | 1.476 | 1.245 | 0,00 |
| **Bear Stearns Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.03.2037 | | 2.624 | 2.288 | 0,01 |
| 1,784 % fällig am 25.12.2046 | | 3.121 | 2.776 | 0,01 |
| 1,784 % fällig am 25.06.2047 | | 3.083 | 2.729 | 0,01 |
| 1,794 % fällig am 25.06.2047 | | 7.411 | 6.576 | 0,01 |
| 1,804 % fällig am 25.10.2036 | | 1.071 | 922 | 0,00 |
| 1,814 % fällig am 25.01.2037 | | 1.947 | 1.735 | 0,00 |
| 1,824 % fällig am 25.09.2047 | | 12.442 | 11.632 | 0,02 |
| 2,024 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 9.493 | 8.660 | 0,02 |
| **Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust** | | | | |
| 2,999 % fällig am 26.12.2046 ^ | | 2.081 | 1.734 | 0,00 |
| 3,490 % fällig am 26.01.2036 ^ | | 2.101 | 1.741 | 0,00 |
| **BellaVista Mortgage Trust** | | | | |
| 2,346 % fällig am 22.01.2045 | | 573 | 513 | 0,00 |
| **BNPP Mortgage Securities LLC Trust** | | | | |
| 0,000 % fällig am 27.08.2037 | | 1.122 | 435 | 0,00 |
| **Business Mortgage Finance PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.08.2040 | € | 4 | 4 | 0,00 |
| **BX Trust** | | | | |
| 4,474 % fällig am 15.07.2034 | $ | 41.885 | 41.144 | 0,07 |
| 5,574 % fällig am 15.07.2034 | | 4.250 | 4.125 | 0,01 |
| **BXP Trust** | | | | |
| 3,379 % fällig am 13.06.2039 | | 90.000 | 84.261 | 0,15 |
| **Canada Square Funding PLC** | | | | |
| 1,550 % fällig am 17.10.2051 | £ | 21.137 | 25.650 | 0,05 |
| 1,720 % fällig am 17.06.2058 | | 18.179 | 21.785 | 0,04 |
| 2,020 % fällig am 17.12.2057 | | 13.068 | 15.687 | 0,03 |
| **Canterbury Finance PLC** | | | | |
| 1,953 % fällig am 16.05.2056 | | 4.477 | 5.448 | 0,01 |
| **Cascade Funding Mortgage Trust** | | | | |
| 4,000 % fällig am 25.10.2068 | $ | 12.710 | 12.492 | 0,02 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | | |
| 2,656 % fällig am 25.07.2037 | | 160 | 103 | 0,00 |
| 2,894 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 2.701 | 2.510 | 0,01 |
| 2,911 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 100 | 90 | 0,00 |
| 2,968 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 626 | 567 | 0,00 |
| 3,057 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 861 | 823 | 0,00 |
| 3,080 % fällig am 25.02.2037 | | 215 | 209 | 0,00 |
| 3,124 % fällig am 25.02.2037 | | 1.393 | 1.363 | 0,00 |
| 3,342 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 3.396 | 3.258 | 0,01 |
| 3,515 % fällig am 25.02.2037 | | 1.339 | 1.311 | 0,00 |
| 3,718 % fällig am 25.07.2037 | | 550 | 484 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 25.05.2035 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 | | 2.280 | 1.849 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 | | 2.866 | 1.563 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 974 | 519 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 2.580 | 1.440 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ChaseFlex Trust** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.07.2037 | $ | 7.245 $ | 6.829 | 0,01 |
| 4,461 % fällig am 25.09.2036 | | 663 | 611 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 1.460 | 958 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2035 | | 1.845 | 1.584 | 0,00 |
| **ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 1,954 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 659 | 596 | 0,00 |
| 2,084 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 6.319 | 5.574 | 0,01 |
| **Chester A PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 17.03.2046 (I) | £ | 13.675 | 13.812 | 0,03 |
| 0,000 % fällig am 20.05.2046 (I) | | 1 | 8.350 | 0,02 |
| 1,570 % fällig am 17.03.2046 (I) | | 73.646 | 89.649 | 0,16 |
| 2,020 % fällig am 17.03.2046 (I) | | 14.727 | 17.715 | 0,03 |
| 2,520 % fällig am 17.03.2046 (I) | | 13.675 | 16.383 | 0,03 |
| 3,020 % fällig am 17.03.2046 (I) | | 8.415 | 10.027 | 0,02 |
| 3,770 % fällig am 17.03.2046 (I) | | 4.207 | 5.024 | 0,01 |
| **Chester B1 Issuer PLC** | | | | |
| 1,750 % fällig am 17.01.2058 | | 20.776 | 25.151 | 0,05 |
| 2,050 % fällig am 17.01.2058 | | 2.045 | 2.468 | 0,01 |
| **Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates** | | | | |
| 1,172 % fällig am 25.08.2035 | $ | 985 | 806 | 0,00 |
| 1,774 % fällig am 25.01.2036 | | 307 | 277 | 0,00 |
| 1,804 % fällig am 25.05.2036 | | 875 | 780 | 0,00 |
| 1,824 % fällig am 25.01.2036 | | 835 | 761 | 0,00 |
| 1,824 % fällig am 25.10.2036 | | 1.163 | 1.055 | 0,00 |
| 1,854 % fällig am 25.10.2035 | | 870 | 821 | 0,00 |
| 1,874 % fällig am 25.08.2035 | | 871 | 817 | 0,00 |
| 1,894 % fällig am 25.05.2035 | | 726 | 697 | 0,00 |
| 1,904 % fällig am 25.01.2035 | | 439 | 420 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.08.2035 | | 145 | 136 | 0,00 |
| 1,944 % fällig am 25.05.2035 | | 200 | 193 | 0,00 |
| 1,984 % fällig am 25.03.2035 | | 195 | 190 | 0,00 |
| 2,204 % fällig am 25.10.2035 | | 414 | 393 | 0,00 |
| 2,304 % fällig am 25.10.2034 | | 505 | 483 | 0,00 |
| **CIM Trust** | | | | |
| 2,138 % fällig am 25.09.2058 | | 4.816 | 4.711 | 0,01 |
| **Citigroup Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 0,455 % fällig am 10.03.2047 (a) | | 25.416 | 120 | 0,00 |
| 2,424 % fällig am 15.07.2030 | | 3.299 | 3.298 | 0,01 |
| 3,124 % fällig am 15.12.2036 | | 3.000 | 2.845 | 0,01 |
| 3,635 % fällig am 10.05.2035 | | 6.710 | 6.261 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,146 % fällig am 25.08.2036 | | 12.006 | 5.090 | 0,01 |
| 1,754 % fällig am 25.06.2036 | | 6.037 | 5.621 | 0,01 |
| 1,944 % fällig am 25.09.2036 | | 502 | 477 | 0,00 |
| 2,124 % fällig am 25.09.2036 | | 4.659 | 4.430 | 0,01 |
| 2,200 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 361 | 312 | 0,00 |
| 2,595 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 140 | 103 | 0,00 |
| 2,604 % fällig am 20.02.2036 | | 1.906 | 1.717 | 0,00 |
| 2,639 % fällig am 25.05.2042 | | 1.074 | 1.051 | 0,00 |
| 2,752 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 399 | 381 | 0,00 |
| 2,780 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 3.034 | 2.821 | 0,01 |
| 2,820 % fällig am 25.11.2036 | | 711 | 555 | 0,00 |
| 2,829 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 383 | 309 | 0,00 |
| 2,849 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 1.888 | 1.444 | 0,00 |
| 2,882 % fällig am 25.02.2037 | | 3.349 | 2.670 | 0,01 |
| 2,906 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 4.234 | 3.678 | 0,01 |
| 2,979 % fällig am 25.08.2047 ^ | | 241 | 221 | 0,00 |
| 3,023 % fällig am 25.04.2036 | | 844 | 549 | 0,00 |
| 3,041 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 340 | 304 | 0,00 |
| 3,076 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 88 | 79 | 0,00 |
| 3,162 % fällig am 25.11.2038 | | 117 | 117 | 0,00 |
| 3,313 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 1.370 | 1.228 | 0,00 |
| 3,328 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 1.525 | 1.364 | 0,00 |
| 3,396 % fällig am 25.09.2037 | | 2.531 | 2.265 | 0,01 |
| 3,479 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 1.664 | 1.538 | 0,00 |
| 4,145 % fällig am 25.01.2082 | | 29.020 | 26.526 | 0,05 |
| 4,299 % fällig am 25.09.2064 | | 14.825 | 12.160 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 | | 1.121 | 1.103 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2035 | | 1.617 | 1.550 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036 | | 57 | 56 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 | | 1.436 | 698 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 2,370 % fällig am 25.04.2035 | | 435 | 414 | 0,00 |
| 2,883 % fällig am 25.05.2035 | | 43 | 42 | 0,00 |
| 2,904 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 593 | 410 | 0,00 |
| 3,799 % fällig am 25.08.2035 | | 2.431 | 1.854 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 3.170 | 2.536 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,266 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 1.271 | 1.140 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,124 % fällig am 25.05.2037 | $ 4.696 | $ 3.968 | 0,01 |
| 2,174 % fällig am 25.01.2037 | 5.279 | 4.465 | 0,01 |
| 2,174 % fällig am 25.02.2037 ^ | 1.621 | 1.366 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.03.2037 | 2.883 | 2.458 | 0,01 |
| 2,274 % fällig am 25.12.2036 | 1.278 | 1.081 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.12.2036 ^ | 2.126 | 1.872 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.04.2037 | 4.060 | 3.707 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.09.2036 | 221 | 195 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 ^ | 233 | 212 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036 | 3.513 | 3.318 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | 485 | 455 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 | 7.459 | 6.778 | 0,01 |
| **Clavis Securities PLC** | | | |
| 1,759 % fällig am 15.12.2032 | £ 205 | 239 | 0,00 |
| **Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 0,250 % fällig am 10.04.2047 (a) | $ 58.900 | 169 | 0,00 |
| 1,145 % fällig am 10.08.2046 (a) | 13.853 | 113 | 0,00 |
| 1,454 % fällig am 10.10.2049 (a) | 67.957 | 2.891 | 0,01 |
| 1,536 % fällig am 15.08.2045 (a) | 3.941 | 0 | 0,00 |
| 2,324 % fällig am 15.09.2033 | 8.708 | 8.288 | 0,02 |
| 3,140 % fällig am 10.10.2036 | 10.000 | 9.215 | 0,02 |
| 3,505 % fällig am 10.08.2048 | 8.414 | 8.209 | 0,02 |
| 3,651 % fällig am 10.02.2049 | 14.213 | 13.930 | 0,03 |
| 3,961 % fällig am 10.05.2051 | 40.000 | 38.943 | 0,07 |
| **Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 ^ | 302 | 201 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.08.2037 | 1.303 | 811 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 25.01.2037 ^ | 287 | 71 | 0,00 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | |
| 1,326 % fällig am 25.11.2046 | 6.351 | 5.467 | 0,01 |
| 1,346 % fällig am 25.11.2036 | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,346 % fällig am 25.07.2046 | 5 | 0 | 0,00 |
| 1,416 % fällig am 25.06.2046 | 5.321 | 4.456 | 0,01 |
| 1,476 % fällig am 25.12.2035 | 1.057 | 978 | 0,00 |
| 1,476 % fällig am 25.02.2036 | 153 | 138 | 0,00 |
| 1,786 % fällig am 20.07.2035 ^ | 104 | 90 | 0,00 |
| 1,792 % fällig am 20.02.2047 ^ | 1.823 | 1.417 | 0,00 |
| 1,802 % fällig am 20.03.2047 | 5.826 | 4.717 | 0,01 |
| 1,807 % fällig am 20.12.2046 ^ | 9.386 | 7.880 | 0,01 |
| 1,826 % fällig am 25.08.2035 ^ | 423 | 365 | 0,00 |
| 1,856 % fällig am 25.11.2047 ^ | 4.739 | 4.136 | 0,01 |
| 1,864 % fällig am 25.06.2036 | 1.973 | 1.858 | 0,00 |
| 1,864 % fällig am 25.12.2046 | 767 | 684 | 0,00 |
| 1,876 % fällig am 25.08.2035 | 763 | 712 | 0,00 |
| 1,884 % fällig am 25.03.2047 ^ | 5.462 | 4.332 | 0,01 |
| 1,892 % fällig am 20.09.2046 | 6.205 | 4.166 | 0,01 |
| 1,904 % fällig am 25.08.2037 | 7.963 | 7.361 | 0,01 |
| 1,904 % fällig am 25.04.2047 | 6.317 | 5.537 | 0,01 |
| 1,924 % fällig am 25.08.2035 ^ | 295 | 206 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.11.2035 ^ | 1.241 | 83 | 0,00 |
| 1,944 % fällig am 25.09.2047 | 3.891 | 3.563 | 0,01 |
| 1,964 % fällig am 25.05.2047 | 3.907 | 3.431 | 0,01 |
| 1,974 % fällig am 25.05.2036 ^ | 2.212 | 963 | 0,00 |
| 1,974 % fällig am 25.10.2036 ^ | 1.535 | 769 | 0,00 |
| 1,974 % fällig am 25.11.2036 | 5.993 | 5.192 | 0,01 |
| 1,984 % fällig am 25.09.2046 | 2.145 | 1.925 | 0,00 |
| 1,984 % fällig am 25.06.2047 | 5.227 | 4.328 | 0,01 |
| 1,994 % fällig am 25.02.2037 ^ | 839 | 279 | 0,00 |
| 2,004 % fällig am 25.07.2046 ^ | 2.019 | 1.930 | 0,00 |
| 2,004 % fällig am 25.08.2046 | 15.679 | 13.275 | 0,02 |
| 2,024 % fällig am 25.05.2036 | 4.346 | 3.779 | 0,01 |
| 2,024 % fällig am 25.12.2036 ^ | 4.191 | 597 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.04.2037 ^ | 2.106 | 720 | 0,00 |
| 2,032 % fällig am 20.03.2046 | 5.827 | 4.606 | 0,01 |
| 2,032 % fällig am 20.05.2046 ^ | 17.514 | 15.045 | 0,03 |
| 2,044 % fällig am 25.07.2046 | 5.008 | 4.557 | 0,01 |
| 2,064 % fällig am 25.09.2047 | 4.723 | 4.187 | 0,01 |
| 2,074 % fällig am 25.09.2035 ^ | 2.096 | 1.327 | 0,00 |
| 2,076 % fällig am 25.08.2035 ^ | 2.135 | 1.854 | 0,00 |
| 2,084 % fällig am 25.03.2036 | 3.465 | 3.409 | 0,01 |
| 2,084 % fällig am 25.11.2036 ^ | 5.223 | 4.863 | 0,01 |
| 2,086 % fällig am 20.07.2035 | 1.877 | 1.781 | 0,00 |
| 2,104 % fällig am 25.07.2035 | 1.519 | 1.239 | 0,00 |
| 2,104 % fällig am 25.01.2037 | 3.690 | 3.136 | 0,01 |
| 2,121 % fällig am 25.06.2035 | 2.134 | 1.922 | 0,00 |
| 2,124 % fällig am 25.05.2035 ^ | 3.431 | 2.702 | 0,01 |
| 2,124 % fällig am 25.06.2035 ^ | 3.837 | 2.955 | 0,01 |
| 2,124 % fällig am 25.12.2035 | 1.728 | 1.104 | 0,00 |
| 2,124 % fällig am 25.07.2036 ^ | 2.416 | 1.167 | 0,00 |
| 2,124 % fällig am 25.09.2036 | 119 | 57 | 0,00 |
| 2,124 % fällig am 25.05.2037 | 156 | 81 | 0,00 |
| 2,124 % fällig am 25.05.2037 ^ | $ 1.810 | $ 718 | 0,00 |
| 2,124 % fällig am 25.06.2037 | 3.885 | 3.220 | 0,01 |
| 2,124 % fällig am 25.09.2037 | 877 | 413 | 0,00 |
| 2,124 % fällig am 25.07.2046 | 2.938 | 2.721 | 0,01 |
| 2,144 % fällig am 25.07.2035 | 1.352 | 1.217 | 0,00 |
| 2,144 % fällig am 25.12.2035 | 215 | 196 | 0,00 |
| 2,164 % fällig am 25.01.2036 | 2.730 | 2.489 | 0,01 |
| 2,164 % fällig am 25.07.2036 | 3.102 | 2.831 | 0,01 |
| 2,174 % fällig am 25.08.2035 ^ | 3.194 | 2.728 | 0,01 |
| 2,184 % fällig am 25.08.2035 | 3.538 | 3.210 | 0,01 |
| 2,184 % fällig am 25.02.2037 | 5.303 | 4.349 | 0,01 |
| 2,184 % fällig am 25.10.2046 | 8.096 | 7.387 | 0,01 |
| 2,184 % fällig am 25.08.2047 ^ | 6.009 | 5.416 | 0,01 |
| 2,204 % fällig am 25.02.2036 ^ | 1.235 | 1.151 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.12.2035 | 1.890 | 1.472 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.01.2036 | 1.449 | 1.335 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.10.2036 | 667 | 264 | 0,00 |
| 2,226 % fällig am 20.11.2035 | 1.902 | 1.757 | 0,00 |
| 2,241 % fällig am 25.09.2034 | 40 | 39 | 0,00 |
| 2,244 % fällig am 25.08.2035 ^ | 1.622 | 1.413 | 0,00 |
| 2,264 % fällig am 25.11.2035 | 880 | 727 | 0,00 |
| 2,266 % fällig am 20.11.2035 | 7.575 | 6.498 | 0,01 |
| 2,272 % fällig am 20.11.2035 | 10.238 | 9.278 | 0,02 |
| 2,304 % fällig am 25.09.2035 | 646 | 405 | 0,00 |
| 2,324 % fällig am 25.09.2035 | 5.122 | 4.692 | 0,01 |
| 2,324 % fällig am 25.02.2036 | 3.323 | 2.230 | 0,00 |
| 2,324 % fällig am 25.05.2036 | 4.437 | 2.012 | 0,00 |
| 2,351 % fällig am 25.10.2035 ^ | 172 | 149 | 0,00 |
| 2,374 % fällig am 25.01.2036 ^ | 81 | 55 | 0,00 |
| 2,424 % fällig am 25.12.2035 ^ | 367 | 318 | 0,00 |
| 2,497 % fällig am 25.05.2035 ^ | 2.471 | 1.704 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.12.2036 ^ | 790 | 279 | 0,00 |
| 2,718 % fällig am 25.09.2034 ^ | 1.308 | 1.225 | 0,00 |
| 2,724 % fällig am 25.02.2036 ^ | 77 | 64 | 0,00 |
| 2,813 % fällig am 25.04.2036 ^ | 301 | 260 | 0,00 |
| 2,841 % fällig am 25.03.2047 | 817 | 772 | 0,00 |
| 2,950 % fällig am 25.06.2037 ^ | 9.198 | 7.936 | 0,02 |
| 3,028 % fällig am 25.03.2047 ^ | 1.066 | 927 | 0,00 |
| 3,084 % fällig am 25.11.2035 | 7.131 | 6.646 | 0,01 |
| 3,723 % fällig am 25.07.2021 ^ | 5 | 4 | 0,00 |
| 4,876 % fällig am 25.09.2037 (a) | 877 | 194 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 25.08.2035 ^ | 2.749 | 2.133 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 25.06.2035 | 800 | 666 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 25.06.2035 ^ | 803 | 668 | 0,00 |
| 5,326 % fällig am 25.10.2037 ^(a) | 1.626 | 394 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.04.2035 | 2.744 | 2.497 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.05.2035 | 1.066 | 900 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.06.2035 ^ | 894 | 594 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.07.2035 ^ | 310 | 259 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 ^ | 5.115 | 4.159 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | 3.331 | 2.392 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 | 12 | 8 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 | 5.771 | 4.336 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 ^ | 3.566 | 3.308 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.01.2036 ^ | 926 | 748 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.02.2036 | 1.865 | 1.597 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.02.2036 ^ | 1.779 | 1.297 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.04.2036 | 601 | 511 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.04.2037 ^ | 512 | 315 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.07.2035 ^ | 122 | 87 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.05.2036 | 3.347 | 1.637 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.05.2036 ^ | 5.737 | 2.772 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2037 ^ | 4.044 | 2.537 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2037 | 827 | 754 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.06.2037 | 12.860 | 7.076 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2027 ^ | 24 | 24 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2034 | 803 | 750 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2035 | 2.249 | 1.980 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2035 ^ | 60 | 32 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2035 ^ | 4.192 | 3.438 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2036 ^ | 2.200 | 1.731 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2036 | 3.429 | 1.847 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 ^ | 6.650 | 3.726 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 | 1.620 | 1.007 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 ^ | 43 | 23 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 ^ | 18.275 | 13.551 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 ^ | 1.868 | 1.184 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036 ^ | 3.115 | 2.103 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036 ^ | 2.119 | 771 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 ^ | 1.427 | 1.052 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | 10.827 | 4.949 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 | 1.942 | 947 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 ^ | 2.094 | 1.021 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | $ 2.675 | $ 1.727 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | 10.927 | 5.806 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 | 6.505 | 3.844 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | 15.990 | 9.600 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2047 ^ | 2.222 | 1.281 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.11.2036 ^ | 417 | 234 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2032 | 8 | 8 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2037 ^ | 9.339 | 4.471 | 0,01 |
| 6,750 % fällig am 25.10.2036 ^ | 1.427 | 511 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 25.10.2037 | 5.855 | 2.621 | 0,01 |
| 7,500 % fällig am 25.07.2036 | 2.004 | 1.722 | 0,00 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | |
| 2,104 % fällig am 25.04.2036 ^ | 863 | 751 | 0,00 |
| 2,344 % fällig am 25.11.2035 | 158 | 153 | 0,00 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 1,924 % fällig am 25.05.2036 | 337 | 118 | 0,00 |
| 1,991 % fällig am 20.02.2036 ^ | 1.815 | 1.730 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.08.2035 | 2.593 | 1.981 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.09.2037 ^ | 4.245 | 1.989 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.04.2046 | 1.861 | 1.535 | 0,00 |
| 2,104 % fällig am 25.03.2036 | 3.931 | 3.526 | 0,01 |
| 2,204 % fällig am 25.04.2035 | 1.418 | 1.253 | 0,00 |
| 2,217 % fällig am 25.02.2035 | 2.355 | 1.948 | 0,00 |
| 2,241 % fällig am 20.10.2034 | 238 | 211 | 0,00 |
| 2,244 % fällig am 25.03.2035 | 108 | 101 | 0,00 |
| 2,264 % fällig am 25.03.2035 | 1.562 | 1.364 | 0,00 |
| 2,265 % fällig am 20.01.2035 | 65 | 59 | 0,00 |
| 2,278 % fällig am 20.04.2035 | 130 | 131 | 0,00 |
| 2,284 % fällig am 25.02.2035 | 2.277 | 1.888 | 0,00 |
| 2,304 % fällig am 25.04.2046 | 6.868 | 2.273 | 0,01 |
| 2,312 % fällig am 25.08.2034 ^ | 436 | 398 | 0,00 |
| 2,324 % fällig am 25.02.2035 | 3.341 | 2.951 | 0,01 |
| 2,344 % fällig am 25.03.2035 | 827 | 686 | 0,00 |
| 2,364 % fällig am 25.02.2035 | 2.721 | 2.380 | 0,01 |
| 2,384 % fällig am 25.09.2034 | 127 | 123 | 0,00 |
| 2,427 % fällig am 25.03.2037 | 1.175 | 1.112 | 0,00 |
| 2,492 % fällig am 25.01.2036 ^ | 200 | 189 | 0,00 |
| 2,528 % fällig am 20.09.2035 | 98 | 82 | 0,00 |
| 2,552 % fällig am 25.05.2047 | 2.612 | 2.285 | 0,01 |
| 2,592 % fällig am 25.04.2035 ^ | 2.123 | 1.633 | 0,00 |
| 2,648 % fällig am 20.04.2035 | 577 | 548 | 0,00 |
| 2,681 % fällig am 20.03.2036 | 474 | 437 | 0,00 |
| 2,741 % fällig am 20.07.2034 | 172 | 161 | 0,00 |
| 2,772 % fällig am 20.05.2036 | 1.944 | 1.767 | 0,00 |
| 2,773 % fällig am 25.04.2037 ^ | 1.856 | 1.717 | 0,00 |
| 2,776 % fällig am 20.09.2035 | 1.574 | 1.457 | 0,00 |
| 2,874 % fällig am 25.11.2037 | 1.624 | 1.546 | 0,00 |
| 2,879 % fällig am 20.02.2036 | 1.688 | 1.609 | 0,00 |
| 2,903 % fällig am 20.12.2035 | 49 | 49 | 0,00 |
| 2,930 % fällig am 20.04.2036 | 513 | 475 | 0,00 |
| 2,939 % fällig am 20.09.2036 ^ | 2.593 | 2.347 | 0,01 |
| 3,030 % fällig am 20.06.2035 | 25 | 24 | 0,00 |
| 3,075 % fällig am 20.12.2035 | 388 | 368 | 0,00 |
| 3,179 % fällig am 20.05.2036 ^ | 1.411 | 1.306 | 0,00 |
| 3,238 % fällig am 20.02.2036 | 2.668 | 2.556 | 0,01 |
| 3,279 % fällig am 20.06.2036 | 1.977 | 1.782 | 0,00 |
| 3,288 % fällig am 25.11.2037 | 1.766 | 1.602 | 0,00 |
| 3,492 % fällig am 20.10.2034 | 503 | 483 | 0,00 |
| 3,571 % fällig am 25.08.2034 ^ | 10 | 10 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.05.2035 | 678 | 563 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 ^ | 465 | 445 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.10.2035 ^ | 981 | 687 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | 520 | 350 | 0,00 |
| 5,576 % fällig am 25.05.2036 (a) | 337 | 64 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.12.2035 ^ | 1.449 | 847 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.06.2037 | 1.965 | 1.158 | 0,00 |
| 5,850 % fällig am 25.05.2036 ^ | 264 | 142 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 | 1.199 | 732 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 | 2.244 | 1.232 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | 2.613 | 1.615 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | 43 | 25 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 | 1.492 | 903 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 ^ | 2.863 | 1.616 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 | 1.393 | 806 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | 741 | 441 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 | 2.110 | 1.248 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | 8.855 | 4.697 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 ^ | 32 | 18 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 | 1.089 | 571 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 | 3.615 | 2.023 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2037 | 1.348 | 1.067 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2038 ^ | 7.200 | 3.995 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 25.09.2036 ^ | 493 | 260 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.12.2037 | 4.822 | 2.487 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust** | | | | | |
| 4,377 % fällig am 25.01.2034 ^ | $ | 204 | $ | 182 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2035 ^ | | 377 | | 363 | 0,00 |
| **Countrywide Mortgage-Backed Securities, Inc.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 27.11.2035 | | 321 | | 303 | 0,00 |
| **Countrywide, Inc.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 27.11.2035 | | 0 | | 0 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | | |
| 2,339 % fällig am 25.03.2033 | | 75 | | 75 | 0,00 |
| 3,209 % fällig am 25.06.2046 | | 29.452 | | 27.590 | 0,05 |
| 5,000 % fällig am 25.07.2035 ^ | | 639 | | 593 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.07.2035 | | 2.156 | | 1.983 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2035 | | 1.948 | | 1.025 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 473 | | 288 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 1.296 | | 297 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 4.818 | | 886 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates** | | | | | |
| 2,053 % fällig am 25.10.2033 | | 5 | | 5 | 0,00 |
| 5,632 % fällig am 25.07.2035 | | 2.345 | | 2.275 | 0,01 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | | | |
| 1,176 % fällig am 27.11.2036 | | 14.484 | | 16.898 | 0,03 |
| 1,206 % fällig am 27.02.2046 | | 7.505 | | 4.027 | 0,01 |
| 1,286 % fällig am 27.10.2036 | | 9.955 | | 8.034 | 0,02 |
| 1,296 % fällig am 27.07.2037 | | 1.120 | | 991 | 0,00 |
| 1,506 % fällig am 30.11.2037 | | 8.035 | | 7.350 | 0,01 |
| 2,833 % fällig am 27.01.2036 | | 3.533 | | 3.439 | 0,01 |
| 3,050 % fällig am 26.08.2036 | | 4.748 | | 4.169 | 0,01 |
| 3,058 % fällig am 26.06.2036 | | 5.081 | | 4.796 | 0,01 |
| 3,168 % fällig am 27.02.2036 | | 2.578 | | 1.979 | 0,00 |
| 3,176 % fällig am 27.07.2037 | | 783 | | 785 | 0,00 |
| 3,348 % fällig am 27.11.2037 | | 973 | | 972 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 26.12.2035 | | 416 | | 322 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 1.122 | | 1.003 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 1.344 | | 1.055 | 0,00 |
| 5,942 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 1.072 | | 283 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2021 ^ | | 11 | | 6 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 1.503 | | 763 | 0,00 |
| 6,396 % fällig am 25.04.2036 | | 299 | | 177 | 0,00 |
| 6,421 % fällig am 25.10.2037 | | 4.604 | | 3.421 | 0,01 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Trust** | | | | | |
| 2,074 % fällig am 15.07.2032 | | 48.000 | | 45.604 | 0,08 |
| 2,324 % fällig am 15.07.2032 | | 22.200 | | 20.973 | 0,04 |
| 2,500 % fällig am 25.07.2057 | | 66.796 | | 61.090 | 0,11 |
| 2,798 % fällig am 25.07.2057 | | 3.875 | | 3.168 | 0,01 |
| 3,046 % fällig am 25.07.2057 | | 53.094 | | 35.576 | 0,06 |
| 3,047 % fällig am 25.06.2048 | | 53.358 | | 49.042 | 0,09 |
| 3,054 % fällig am 01.06.2050 | | 125.641 | | 126.363 | 0,22 |
| 3,086 % fällig am 25.02.2056 | | 167.987 | | 145.044 | 0,26 |
| 3,253 % fällig am 25.07.2058 | | 295.352 | | 247.377 | 0,44 |
| 3,341 % fällig am 25.09.2048 | | 13.812 | | 12.327 | 0,02 |
| 3,726 % fällig am 25.10.2058 | | 576 | | 516 | 0,00 |
| 3,824 % fällig am 25.04.2058 | | 57.738 | | 56.726 | 0,10 |
| 4,292 % fällig am 25.09.2057 | | 32.162 | | 30.030 | 0,05 |
| 4,400 % fällig am 25.12.2048 | | 13.416 | | 12.155 | 0,02 |
| 5,150 % fällig am 25.09.2057 | | 1.376 | | 1.260 | 0,00 |
| **Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.07.2047 | | 9.911 | | 8.926 | 0,02 |
| 1,824 % fällig am 25.08.2047 | | 3.080 | | 2.711 | 0,01 |
| 1,864 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 572 | | 544 | 0,00 |
| 1,884 % fällig am 25.08.2047 | | 566 | | 505 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 6.670 | | 6.557 | 0,01 |
| 1,924 % fällig am 25.09.2047 ^ | | 12.275 | | 11.103 | 0,02 |
| 1,944 % fällig am 25.03.2037 | | 14.614 | | 8.120 | 0,02 |
| 1,954 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 13.631 | | 11.942 | 0,02 |
| 1,984 % fällig am 25.01.2047 | | 2.292 | | 2.172 | 0,00 |
| 2,004 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 16.562 | | 6.102 | 0,01 |
| 2,004 % fällig am 25.12.2036 | | 2.040 | | 807 | 0,00 |
| 2,004 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 2.711 | | 2.448 | 0,01 |
| 2,104 % fällig am 25.01.2047 | | 3.031 | | 2.772 | 0,01 |
| 2,184 % fällig am 25.08.2036 | | 3.855 | | 3.681 | 0,01 |
| **Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 1,824 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 2 | | 1 | 0,00 |
| 2,014 % fällig am 25.11.2035 | | 936 | | 892 | 0,00 |
| 2,143 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 291 | | 270 | 0,00 |
| 2,787 % fällig am 25.10.2035 | | 2.445 | | 2.284 | 0,00 |
| 3,168 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 381 | | 293 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 716 | | 614 | 0,00 |
| **Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 6,005 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 1.519 | | 1.368 | 0,00 |
| 6,445 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 4.222 | | 3.958 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Deutsche ALT-B Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 4,914 % fällig am 25.06.2036 | $ | 288 | $ | 260 | 0,00 |
| 4,914 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 19 | | 17 | 0,00 |
| **Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.** | | | | | |
| 6,498 % fällig am 27.07.2037 | | 589 | | 502 | 0,00 |
| **Deutsche Mortgage Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,599 % fällig am 25.06.2034 | | 710 | | 709 | 0,00 |
| **Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates** | | | | | |
| 3,478 % fällig am 27.06.2037 | | 550 | | 532 | 0,00 |
| **Domi BV** | | | | | |
| 0,569 % fällig am 15.06.2051 | € | 7.345 | | 7.661 | 0,01 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 1,802 % fällig am 19.10.2036 | $ | 6.634 | | 5.823 | 0,01 |
| 1,812 % fällig am 19.10.2036 | | 4.100 | | 2.990 | 0,01 |
| 2,192 % fällig am 19.10.2045 | | 1.546 | | 1.349 | 0,00 |
| 2,352 % fällig am 19.10.2045 | | 2.945 | | 2.774 | 0,01 |
| 2,432 % fällig am 19.09.2044 | | 8 | | 7 | 0,00 |
| **Dragon Finance BV** | | | | | |
| 1,074 % fällig am 13.07.2023 | £ | 2.742 | | 3.281 | 0,01 |
| **Dutch Property Finance BV** | | | | | |
| 0,235 % fällig am 28.07.2054 | € | 16.769 | | 17.358 | 0,03 |
| 0,250 % fällig am 28.01.2048 | | 31.187 | | 32.612 | 0,06 |
| **Eurohome UK Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,739 % fällig am 15.06.2044 | £ | 5.045 | | 5.974 | 0,01 |
| 1,939 % fällig am 15.09.2044 | | 6.850 | | 7.909 | 0,01 |
| 2,189 % fällig am 15.09.2044 | | 7.250 | | 7.971 | 0,02 |
| **European Loan Conduit DAC** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 23.04.2029 | € | 12.131 | | 12.581 | 0,02 |
| 1,000 % fällig am 17.02.2030 | | 66.672 | | 68.797 | 0,12 |
| **Eurosail PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 13.03.2045 | | 5.610 | | 5.632 | 0,01 |
| 0,148 % fällig am 10.09.2044 | | 3.200 | | 3.139 | 0,01 |
| 1,740 % fällig am 13.03.2045 | £ | 2.323 | | 2.789 | 0,01 |
| 1,750 % fällig am 13.03.2045 | | 8 | | 10 | 0,00 |
| 1,988 % fällig am 10.09.2044 | | 3.200 | | 3.669 | 0,01 |
| 2,360 % fällig am 13.09.2045 | | 15.089 | | 17.365 | 0,03 |
| 2,540 % fällig am 13.06.2045 | | 5.814 | | 6.990 | 0,01 |
| 2,590 % fällig am 13.06.2045 | | 1.537 | | 1.751 | 0,00 |
| **Fingal Securities RMBS DAC** | | | | | |
| 1,070 % fällig am 28.07.2055 | € | 32.308 | | 33.755 | 0,06 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | | |
| 1,775 % fällig am 16.12.2069 | £ | 15.503 | | 18.744 | 0,03 |
| 1,795 % fällig am 16.09.2069 | | 13.678 | | 16.597 | 0,03 |
| 2,065 % fällig am 16.06.2070 | | 19.649 | | 23.779 | 0,04 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | | | |
| 2,790 % fällig am 25.11.2035 ^ | $ | 1.581 | | 1.134 | 0,00 |
| 2,801 % fällig am 25.03.2035 | | 653 | | 442 | 0,00 |
| 2,820 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 898 | | 681 | 0,00 |
| 2,827 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 174 | | 151 | 0,00 |
| 2,940 % fällig am 25.02.2036 | | 118 | | 94 | 0,00 |
| 3,137 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 943 | | 758 | 0,00 |
| 3,325 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 406 | | 249 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 | | 76 | | 47 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 747 | | 400 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 772 | | 379 | 0,00 |
| **First Horizon Asset Securities, Inc.** | | | | | |
| 2,831 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 36 | | 25 | 0,00 |
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust** | | | | | |
| 2,432 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 402 | | 293 | 0,00 |
| 2,612 % fällig am 25.09.2035 | | 6 | | 5 | 0,00 |
| 2,998 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 241 | | 100 | 0,00 |
| 3,009 % fällig am 25.11.2037 ^ | | 528 | | 476 | 0,00 |
| 3,290 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 245 | | 171 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 | | 185 | | 110 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 247 | | 115 | 0,00 |
| **FirstMac Mortgage Funding Trust** | | | | | |
| 1,860 % fällig am 08.03.2049 | AUD | 3.840 | | 2.638 | 0,01 |
| **Fondo de Titulizacion de Activos UCI** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 16.06.2049 | € | 13.483 | | 13.626 | 0,03 |
| **FWD Securitization Trust** | | | | | |
| 2,240 % fällig am 25.01.2050 | $ | 8.196 | | 7.967 | 0,02 |
| 2,810 % fällig am 25.06.2049 | | 2.020 | | 1.978 | 0,00 |
| **GC Pastor Hipotecario FTA** | | | | | |
| 0,001 % fällig am 21.06.2046 | € | 1.623 | | 1.519 | 0,00 |
| **Glen Securities Finance DAC** | | | | | |
| 1,670 % fällig am 28.10.2038 | | 4.097 | | 4.187 | 0,01 |
| 2,670 % fällig am 28.10.2038 | € | 3.096 | $ | 3.128 | 0,01 |
| 3,470 % fällig am 28.10.2038 | | 1.480 | | 1.497 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **GMAC Commercial Mortgage Asset Corp.** | | | | | |
| 5,456 % fällig am 10.03.2051 | $ | 18.431 | | 17.481 | 0,03 |
| 5,550 % fällig am 10.08.2038 | | 19.782 | | 18.774 | 0,03 |
| **GMAC Mortgage Corp. Loan Trust** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 19.07.2035 | | 157 | | 138 | 0,00 |
| 2,900 % fällig am 19.04.2036 ^ | | 117 | | 94 | 0,00 |
| 3,077 % fällig am 19.11.2035 ^ | | 61 | | 56 | 0,00 |
| 3,220 % fällig am 18.03.2035 | | 16 | | 15 | 0,00 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,048 % fällig am 18.06.2038 | £ | 5.076 | | 6.084 | 0,01 |
| 1,743 % fällig am 18.03.2039 | | 6.372 | | 7.623 | 0,01 |
| 1,753 % fällig am 18.06.2039 | | 167 | | 199 | 0,00 |
| 2,193 % fällig am 18.06.2039 | $ | 338 | | 331 | 0,00 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | | | |
| 2,024 % fällig am 25.10.2046 | | 7.759 | | 7.155 | 0,01 |
| 2,064 % fällig am 25.06.2045 | | 773 | | 723 | 0,00 |
| 2,144 % fällig am 25.10.2045 | | 3.848 | | 3.773 | 0,01 |
| 2,204 % fällig am 25.02.2036 | | 1.663 | | 1.517 | 0,00 |
| 2,244 % fällig am 25.10.2045 | | 2.676 | | 2.423 | 0,01 |
| **Grifonas Finance PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 28.08.2039 | € | 22.317 | | 22.091 | 0,04 |
| **GS Mortgage Securities Corp.** | | | | | |
| 1,606 % fällig am 10.02.2046 (a) | $ | 27.235 | | 125 | 0,00 |
| **GS Mortgage Securities Corp. Trust** | | | | | |
| 3,419 % fällig am 10.10.2032 | | 26.700 | | 26.639 | 0,05 |
| 4,744 % fällig am 10.10.2032 | | 35.288 | | 34.343 | 0,06 |
| **GS Mortgage Securities Corp. Trust** | | | | | |
| 3,124 % fällig am 15.07.2025 | | 12.349 | | 11.667 | 0,02 |
| 4,324 % fällig am 15.11.2032 | | 19.350 | | 18.236 | 0,03 |
| **GSC Capital Corp. Mortgage Trust** | | | | | |
| 2,024 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 1.910 | | 1.820 | 0,00 |
| **GSMPS Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 1,974 % fällig am 25.03.2035 | | 6.885 | | 6.667 | 0,01 |
| 1,974 % fällig am 25.09.2035 | | 7.818 | | 6.812 | 0,01 |
| 2,024 % fällig am 25.06.2034 | | 1.524 | | 1.315 | 0,00 |
| 3,478 % fällig am 25.06.2034 | | 4.922 | | 4.593 | 0,01 |
| 7,064 % fällig am 20.10.2032 | | 1.385 | | 1.257 | 0,00 |
| **GSMSC Resecuritization Trust** | | | | | |
| 1,186 % fällig am 26.09.2036 | | 8.711 | | 5.944 | 0,01 |
| 3,490 % fällig am 26.08.2035 | | 146 | | 146 | 0,00 |
| 9,289 % fällig am 26.04.2037 | | 9.344 | | 2.914 | 0,01 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 1,854 % fällig am 25.05.2037 | | 12.845 | | 7.734 | 0,01 |
| 2,867 % fällig am 25.01.2036 | | 914 | | 908 | 0,00 |
| 2,975 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 1.330 | | 799 | 0,00 |
| 3,009 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 103 | | 97 | 0,00 |
| 3,082 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 164 | | 150 | 0,00 |
| 3,096 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 3.911 | | 2.854 | 0,01 |
| 3,259 % fällig am 25.05.2037 | | 3.958 | | 3.717 | 0,01 |
| 3,760 % fällig am 25.05.2034 | | 29 | | 25 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.07.2035 | | 524 | | 504 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 270 | | 267 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 236 | | 402 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2036 | | 1.921 | | 1.119 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | | 2.050 | | 1.370 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 467 | | 349 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.08.2036 | | 1.172 | | 465 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.05.2036 | | 994 | | 365 | 0,00 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 1,326 % fällig am 19.12.2036 ^ | | 1.928 | | 1.759 | 0,00 |
| 1,792 % fällig am 19.11.2036 | | 1.250 | | 1.150 | 0,00 |
| 1,792 % fällig am 19.11.2046 ^ | | 967 | | 709 | 0,00 |
| 1,802 % fällig am 19.09.2037 | | 9.802 | | 8.999 | 0,02 |
| 1,802 % fällig am 19.01.2038 | | 10.881 | | 9.874 | 0,02 |
| 1,817 % fällig am 19.12.2036 | | 38.205 | | 33.592 | 0,06 |
| 1,872 % fällig am 19.03.2037 | | 1.188 | | 1.069 | 0,00 |
| 1,912 % fällig am 25.01.2047 | | 12.881 | | 11.449 | 0,02 |
| 1,952 % fällig am 19.12.2036 ^ | | 852 | | 742 | 0,00 |
| 1,976 % fällig am 19.09.2035 ^ | | 121 | | 108 | 0,00 |
| 2,032 % fällig am 19.11.2036 | | 15.327 | | 13.416 | 0,02 |
| 2,052 % fällig am 19.05.2035 | | 3.165 | | 2.916 | 0,01 |
| 2,152 % fällig am 19.03.2035 | | 702 | | 688 | 0,00 |
| 2,172 % fällig am 20.10.2045 | | 4.133 | | 2.700 | 0,01 |
| 2,195 % fällig am 19.04.2034 | | 82 | | 76 | 0,00 |
| 2,232 % fällig am 19.09.2035 | | 9.085 | | 5.076 | 0,01 |
| 2,232 % fällig am 19.11.2035 | | 337 | | 275 | 0,00 |
| 2,242 % fällig am 19.11.2034 | | 352 | | 341 | 0,00 |
| 2,252 % fällig am 19.08.2045 | | 2.593 | | 2.107 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| 2,292 % fällig am 19.01.2035 | $ 181 | $ 178 | 0,00 |
| 2,476 % fällig am 19.10.2035 | 7.028 | 4.464 | 0,01 |
| 2,476 % fällig am 19.01.2036 ^ | 1.005 | 479 | 0,00 |
| 2,591 % fällig am 19.12.2035 ^ | 682 | 638 | 0,00 |
| 2,624 % fällig am 25.10.2037 | 13.839 | 13.610 | 0,02 |
| 2,721 % fällig am 25.02.2036 ^ | 147 | 59 | 0,00 |
| 2,899 % fällig am 19.06.2036 ^ | 2.269 | 1.319 | 0,00 |
| 3,152 % fällig am 19.02.2036 | 1.929 | 1.196 | 0,00 |
| **Harbour Energy PLC** | | | |
| 1,305 % fällig am 28.01.2054 | £ 1.600 | 1.920 | 0,00 |
| 1,405 % fällig am 28.01.2054 | 14.500 | 17.164 | 0,03 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | |
| 1,703 % fällig am 25.05.2053 | 47.601 | 57.704 | 0,10 |
| **Hilton Orlando Trust** | | | |
| 5,124 % fällig am 15.12.2034 | $ 2.213 | 2.099 | 0,00 |
| **Hipocat FTA** | | | |
| 0,000 % fällig am 24.10.2039 | € 2.702 | 2.790 | 0,01 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | |
| 2,144 % fällig am 25.01.2036 | $ 960 | 930 | 0,00 |
| 2,359 % fällig am 25.01.2036 | 8.088 | 6.952 | 0,01 |
| 2,690 % fällig am 25.04.2037 | 900 | 803 | 0,00 |
| 3,012 % fällig am 25.04.2047 | 1.283 | 1.184 | 0,00 |
| **Hops Hill No. 1 PLC** | | | |
| 1,922 % fällig am 27.05.2054 | £ 29.188 | 35.275 | 0,06 |
| **HSI Asset Loan Obligation Trust** | | | |
| 1,994 % fällig am 25.12.2036 | $ 1.954 | 421 | 0,00 |
| 5,006 % fällig am 25.12.2036 (a) | 1.522 | 220 | 0,00 |
| **IM Pastor Fondo de Titluzacion Hipotecaria** | | | |
| 0,002 % fällig am 22.09.2041 | € 74 | 77 | 0,00 |
| **Impac CMB Trust** | | | |
| 2,164 % fällig am 25.05.2035 | $ 207 | 195 | 0,00 |
| 2,264 % fällig am 25.11.2034 | 1.719 | 1.687 | 0,00 |
| 2,264 % fällig am 25.03.2035 | 3.151 | 2.961 | 0,01 |
| 2,304 % fällig am 25.01.2035 | 2.625 | 2.543 | 0,01 |
| 6,060 % fällig am 25.10.2034 | 375 | 396 | 0,00 |
| **Impac Secured Assets CMN Owner Trust** | | | |
| 5,450 % fällig am 25.03.2033 | 278 | 270 | 0,00 |
| **Impac Secured Assets Corp.** | | | |
| 2,264 % fällig am 25.03.2036 | 1.542 | 1.311 | 0,00 |
| 3,049 % fällig am 25.02.2035 | 609 | 612 | 0,00 |
| **Impac Secured Assets Trust** | | | |
| 1,734 % fällig am 25.05.2037 ^ | 639 | 569 | 0,00 |
| 1,944 % fällig am 25.03.2037 ^ | 85 | 85 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.11.2036 | 1.377 | 1.339 | 0,00 |
| 2,104 % fällig am 25.09.2037 ^ | 3.165 | 2.690 | 0,01 |
| 2,144 % fällig am 25.01.2037 | 10.157 | 9.276 | 0,02 |
| 2,164 % fällig am 25.11.2036 | 6.482 | 4.910 | 0,01 |
| 2,164 % fällig am 25.02.2037 ^ | 5.646 | 5.026 | 0,01 |
| 2,324 % fällig am 25.05.2036 | 407 | 378 | 0,00 |
| 2,344 % fällig am 25.09.2037 | 2.699 | 2.253 | 0,00 |
| **IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 1,686 % fällig am 25.01.2032 | 1 | 1 | 0,00 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,794 % fällig am 25.01.2037 ^ | 2.276 | 2.143 | 0,00 |
| 1,804 % fällig am 25.02.2037 ^ | 6.124 | 5.697 | 0,01 |
| 1,814 % fällig am 25.04.2037 | 1.724 | 1.439 | 0,00 |
| 1,834 % fällig am 25.11.2036 | 169 | 163 | 0,00 |
| 1,864 % fällig am 25.07.2036 | 5.064 | 4.757 | 0,01 |
| 1,874 % fällig am 25.09.2037 | 4.454 | 4.138 | 0,01 |
| 1,884 % fällig am 25.10.2036 | 3.003 | 2.731 | 0,01 |
| 1,928 % fällig am 25.09.2035 ^ | 78 | 69 | 0,00 |
| 1,974 % fällig am 25.06.2036 | 3.064 | 2.597 | 0,01 |
| 1,984 % fällig am 25.08.2036 | 8.664 | 6.479 | 0,01 |
| 1,984 % fällig am 25.07.2047 | 3.731 | 2.717 | 0,01 |
| 2,004 % fällig am 25.10.2036 | 5.294 | 2.598 | 0,01 |
| 2,024 % fällig am 25.06.2046 | 6.282 | 5.535 | 0,01 |
| 2,024 % fällig am 25.11.2046 | 7.796 | 7.475 | 0,01 |
| 2,044 % fällig am 25.05.2046 | 8.222 | 7.468 | 0,01 |
| 2,084 % fällig am 25.04.2035 | 290 | 263 | 0,00 |
| 2,144 % fällig am 25.07.2035 | 6.144 | 4.496 | 0,01 |
| 2,164 % fällig am 25.10.2036 | 2.156 | 1.078 | 0,00 |
| 2,204 % fällig am 25.01.2036 | 3.229 | 2.336 | 0,01 |
| 2,224 % fällig am 25.07.2035 | 1.161 | 995 | 0,00 |
| 2,404 % fällig am 25.12.2034 | 927 | 744 | 0,00 |
| 2,424 % fällig am 25.07.2046 | 5.018 | 4.556 | 0,01 |
| 2,444 % fällig am 25.11.2034 ^ | 1.089 | 949 | 0,00 |
| 2,484 % fällig am 25.09.2034 | 49 | 44 | 0,00 |
| 2,646 % fällig am 25.09.2036 | 1.499 | 1.091 | 0,00 |
| 2,726 % fällig am 25.11.2035 ^ | 38 | 29 | 0,00 |
| 2,735 % fällig am 25.09.2036 ^ | 139 | 119 | 0,00 |
| 2,775 % fällig am 25.05.2035 ^ | $ 292 | $ 246 | 0,00 |
| 2,783 % fällig am 25.09.2036 ^ | 123 | 109 | 0,00 |
| 2,796 % fällig am 25.11.2035 ^ | 1.558 | 1.363 | 0,00 |
| 2,808 % fällig am 25.05.2035 ^ | 73 | 57 | 0,00 |
| 2,810 % fällig am 25.06.2037 ^ | 3.363 | 2.862 | 0,01 |
| 2,876 % fällig am 25.09.2037 | 14.373 | 12.009 | 0,02 |
| 2,880 % fällig am 25.06.2037 ^ | 1.882 | 1.761 | 0,00 |
| 2,888 % fällig am 25.09.2035 ^ | 312 | 231 | 0,00 |
| 2,899 % fällig am 25.12.2035 | 4.077 | 3.380 | 0,01 |
| 2,917 % fällig am 25.03.2036 ^ | 3.717 | 3.027 | 0,01 |
| 2,978 % fällig am 25.08.2036 | 182 | 157 | 0,00 |
| 2,981 % fällig am 25.06.2037 ^ | 6.642 | 4.892 | 0,01 |
| 2,984 % fällig am 25.05.2037 ^ | 1.623 | 1.393 | 0,00 |
| 2,985 % fällig am 25.08.2035 | 69 | 57 | 0,00 |
| 3,007 % fällig am 25.03.2037 ^ | 17 | 15 | 0,00 |
| 3,031 % fällig am 25.01.2037 ^ | 165 | 142 | 0,00 |
| 3,044 % fällig am 25.07.2037 | 7.466 | 6.937 | 0,01 |
| 3,054 % fällig am 25.06.2036 | 5.814 | 4.193 | 0,01 |
| 3,066 % fällig am 25.05.2036 ^ | 199 | 163 | 0,00 |
| 3,072 % fällig am 25.04.2037 | 7.515 | 6.702 | 0,01 |
| 3,087 % fällig am 25.08.2037 ^ | 4.989 | 4.136 | 0,01 |
| 3,089 % fällig am 25.05.2037 ^ | 2.138 | 1.507 | 0,00 |
| 3,131 % fällig am 25.08.2037 | 2.965 | 2.160 | 0,00 |
| 3,197 % fällig am 25.07.2036 | 3.644 | 2.951 | 0,01 |
| 3,201 % fällig am 25.04.2037 | 3.975 | 3.493 | 0,01 |
| 3,308 % fällig am 25.08.2034 | 88 | 86 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 ^ | 716 | 599 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | 194 | 91 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 | 780 | 366 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.07.2037 ^ | 369 | 156 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2037 ^ | 1.846 | 1.253 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.10.2037 | 2.710 | 1.670 | 0,00 |
| **InTown Hotel Portfolio Trust** | | | |
| 2,775 % fällig am 15.01.2033 | 6.700 | 6.619 | 0,01 |
| 2,975 % fällig am 15.01.2033 | 9.480 | 9.354 | 0,02 |
| 3,775 % fällig am 15.01.2033 | 20.900 | 20.600 | 0,04 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,144 % fällig am 25.01.2036 | 15 | 15 | 0,00 |
| 2,184 % fällig am 25.06.2037 | 18.608 | 8.677 | 0,02 |
| 2,184 % fällig am 25.04.2047 | 3.681 | 3.715 | 0,01 |
| 2,711 % fällig am 25.10.2036 | 4.847 | 4.418 | 0,01 |
| 2,897 % fällig am 25.03.2036 | 818 | 721 | 0,00 |
| 3,197 % fällig am 25.01.2036 | 389 | 281 | 0,00 |
| 3,385 % fällig am 25.03.2037 ^ | 1.074 | 1.072 | 0,00 |
| 5,843 % fällig am 26.05.2037 | 3.113 | 2.662 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 27.12.2036 | 1.180 | 705 | 0,00 |
| 6,180 % fällig am 25.03.2036 | 6.943 | 6.105 | 0,01 |
| 6,210 % fällig am 25.12.2036 ^ | 187 | 182 | 0,00 |
| 6,460 % fällig am 25.12.2036 ^ | 1.220 | 1.180 | 0,00 |
| 6,550 % fällig am 25.05.2036 | 128 | 127 | 0,00 |
| 6,620 % fällig am 25.08.2036 ^ | 245 | 236 | 0,00 |
| 6,920 % fällig am 25.08.2036 ^ | 3.975 | 3.246 | 0,01 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp.** | | | |
| 2,274 % fällig am 15.02.2035 | 35.550 | 34.773 | 0,06 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | |
| 1,360 % fällig am 15.04.2046 (a) | 15.493 | 95 | 0,00 |
| 2,174 % fällig am 15.12.2036 | 17.100 | 16.775 | 0,03 |
| 3,881 % fällig am 05.01.2031 | 19.450 | 19.263 | 0,03 |
| 5,337 % fällig am 15.05.2047 | 2.493 | 2.297 | 0,00 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | |
| 2,207 % fällig am 25.08.2035 | 1.055 | 1.040 | 0,00 |
| 2,274 % fällig am 25.06.2034 | 15 | 14 | 0,00 |
| 2,489 % fällig am 25.04.2035 ^ | 336 | 317 | 0,00 |
| 2,610 % fällig am 25.09.2035 | 435 | 416 | 0,00 |
| 2,680 % fällig am 25.11.2035 ^ | 858 | 781 | 0,00 |
| 2,680 % fällig am 25.11.2035 | 2.834 | 2.578 | 0,01 |
| 2,753 % fällig am 25.11.2035 ^ | 1.989 | 1.705 | 0,00 |
| 2,770 % fällig am 25.05.2036 ^ | 45 | 39 | 0,00 |
| 2,800 % fällig am 25.08.2035 ^ | 192 | 170 | 0,00 |
| 2,801 % fällig am 25.08.2036 | 113 | 88 | 0,00 |
| 2,843 % fällig am 25.04.2036 ^ | 3.261 | 3.072 | 0,01 |
| 2,859 % fällig am 25.04.2037 ^ | 3 | 3 | 0,00 |
| 2,887 % fällig am 25.08.2036 | 4.010 | 3.474 | 0,01 |
| 2,908 % fällig am 25.10.2036 | 268 | 210 | 0,00 |
| 2,967 % fällig am 25.05.2036 | 3.193 | 2.807 | 0,01 |
| 3,011 % fällig am 25.10.2037 | 3.173 | 2.722 | 0,01 |
| 3,043 % fällig am 27.07.2037 | 516 | 484 | 0,00 |
| 3,137 % fällig am 25.05.2037 ^ | 429 | 391 | 0,00 |
| 3,172 % fällig am 25.01.2037 ^ | 809 | 721 | 0,00 |
| 3,232 % fällig am 25.05.2036 | 1.494 | 1.290 | 0,00 |
| 3,253 % fällig am 25.07.2035 | 312 | 292 | 0,00 |
| 3,278 % fällig am 25.05.2037 | 1.587 | 1.448 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.07.2036 | $ 3.184 | $ 2.082 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.01.2036 ^ | 991 | 558 | 0,00 |
| 5,875 % fällig am 25.06.2021 ^ | 4 | 17 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 | 2.701 | 1.657 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | 4.959 | 3.042 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 25.08.2037 | 5.126 | 1.949 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.01.2035 | 1.526 | 1.550 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.07.2036 ^ | 233 | 122 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2036 | 4.396 | 2.081 | 0,00 |
| **JPMorgan Resecuritization Trust** | | | |
| 2,866 % fällig am 26.09.2036 | 333 | 314 | 0,00 |
| 5,225 % fällig am 26.09.2037 | 1.412 | 1.138 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 26.05.2037 | 127 | 64 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 26.09.2036 | 585 | 455 | 0,00 |
| 6,497 % fällig am 26.04.2037 | 1.472 | 843 | 0,00 |
| **Kirkby RMBS PLC** | | | |
| 0,000 % fällig am 22.02.2045 | £ 1 | 3.093 | 0,01 |
| 1,559 % fällig am 22.02.2045 | 35.365 | 41.712 | 0,07 |
| 2,250 % fällig am 22.02.2045 | 4.258 | 3.568 | 0,01 |
| 2,759 % fällig am 22.02.2045 | 13.150 | 14.852 | 0,03 |
| **Landmark Mortgage Securities PLC** | | | |
| 0,038 % fällig am 17.06.2038 | € 48 | 49 | 0,00 |
| 1,804 % fällig am 17.06.2039 | £ 6.388 | 7.302 | 0,01 |
| 1,824 % fällig am 17.06.2038 | 301 | 355 | 0,00 |
| **Lanebrook Mortgage Transaction PLC** | | | |
| 1,852 % fällig am 12.06.2057 | 18.626 | 22.553 | 0,04 |
| **Lansdowne Mortgage Securities PLC** | | | |
| 0,019 % fällig am 15.06.2045 | € 3.787 | 3.815 | 0,01 |
| **Legacy Mortgage Asset Trust** | | | |
| 0,000 % fällig am 25.12.2056 (a) | $ 125.324 | 899 | 0,00 |
| 0,125 % fällig am 26.12.2057 (a) | 75.580 | 366 | 0,00 |
| 1,555 % fällig am 26.12.2057 (a) | 26.466 | 277 | 0,00 |
| 3,033 % fällig am 25.12.2056 | 125.324 | 109.582 | 0,19 |
| 3,942 % fällig am 26.08.2058 | 17.864 | 17.107 | 0,03 |
| 4,000 % fällig am 25.02.2058 | 2.884 | 2.870 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 26.08.2058 | 19.680 | 19.684 | 0,04 |
| 4,246 % fällig am 25.02.2058 | 1.575 | 1.472 | 0,00 |
| 4,248 % fällig am 25.01.2058 | 24.325 | 22.438 | 0,04 |
| 4,250 % fällig am 25.02.2058 | 1.575 | 1.546 | 0,00 |
| 4,250 % fällig am 26.08.2058 | 35.727 | 34.994 | 0,06 |
| 4,500 % fällig am 25.02.2058 | 1.575 | 1.504 | 0,00 |
| 4,805 % fällig am 26.12.2057 | 48.452 | 43.525 | 0,08 |
| **Lehman Mortgage Trust** | | | |
| 2,124 % fällig am 25.07.2037 ^ | 481 | 403 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.12.2035 ^ | 618 | 389 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.01.2037 | 318 | 221 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2036 | 2.342 | 690 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | 709 | 420 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036 | 1.227 | 1.082 | 0,00 |
| **Lehman XS Trust** | | | |
| 1,226 % fällig am 25.03.2047 | 3.082 | 2.832 | 0,01 |
| 1,476 % fällig am 25.11.2035 | 145 | 145 | 0,00 |
| 1,824 % fällig am 25.03.2047 | 15.568 | 14.959 | 0,03 |
| 1,864 % fällig am 25.08.2036 ^ | 65 | 70 | 0,00 |
| 1,874 % fällig am 25.08.2037 | 3.801 | 3.527 | 0,01 |
| 1,894 % fällig am 25.02.2036 | 343 | 313 | 0,00 |
| 1,906 % fällig am 25.08.2047 ^ | 10.982 | 9.956 | 0,02 |
| 1,924 % fällig am 25.11.2035 | 4.120 | 4.078 | 0,01 |
| 2,004 % fällig am 25.12.2036 | 6.783 | 5.677 | 0,01 |
| 2,004 % fällig am 25.09.2046 | 137 | 128 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.08.2046 | 4.785 | 4.409 | 0,01 |
| 2,024 % fällig am 25.11.2046 ^ | 847 | 815 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.06.2047 ^ | 6.443 | 5.343 | 0,01 |
| 2,034 % fällig am 25.08.2046 | 9.776 | 9.190 | 0,02 |
| 2,064 % fällig am 25.06.2047 | 6.517 | 5.911 | 0,01 |
| 2,144 % fällig am 25.02.2046 ^ | 8.032 | 6.881 | 0,01 |
| **Ludgate Funding PLC** | | | |
| 0,000 % fällig am 01.01.2061 | € 9.165 | 8.919 | 0,02 |
| 0,236 % fällig am 01.01.2061 | 6.731 | 6.580 | 0,01 |
| 1,608 % fällig am 01.12.2060 | £ 1.150 | 1.322 | 0,00 |
| 1,638 % fällig am 01.01.2061 | 26.789 | 31.432 | 0,06 |
| **Luminent Mortgage Trust** | | | |
| 1,904 % fällig am 25.01.2037 ^ | $ 2.491 | 2.115 | 0,00 |
| 1,964 % fällig am 25.12.2036 | 2.600 | 2.325 | 0,01 |
| 1,984 % fällig am 25.12.2036 ^ | 114 | 105 | 0,00 |
| 2,004 % fällig am 25.05.2046 | 908 | 780 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.02.2046 | 1.891 | 1.481 | 0,00 |
| **Mansard Mortgages PLC** | | | |
| 0,752 % fällig am 15.04.2047 | £ 2.372 | 2.728 | 0,01 |
| 2,129 % fällig am 15.12.2049 | 4.234 | 5.025 | 0,01 |
| 2,879 % fällig am 15.12.2049 | 3.763 | 4.516 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | | | |
| 2,506 % fällig am 25.09.2034 | $ | 830 | $ | 741 | 0,00 |
| 2,578 % fällig am 25.03.2035 | | 58 | | 47 | 0,00 |
| 2,660 % fällig am 25.03.2035 | | 116 | | 110 | 0,00 |
| 2,724 % fällig am 25.09.2037 | | 7.382 | | 3.526 | 0,01 |
| 2,787 % fällig am 25.03.2035 | | 577 | | 529 | 0,00 |
| 3,248 % fällig am 25.02.2035 | | 163 | | 147 | 0,00 |
| 4,446 % fällig am 25.12.2035 | | 953 | | 955 | 0,00 |
| **MASTR Alternative Loan Trust** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.04.2035 | | 2.597 | | 2.405 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 1.389 | | 833 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.05.2034 | | 70 | | 68 | 0,00 |
| **MASTR Asset Securitization Trust** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 25.07.2019 | | 0 | | 0 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 1.834 | | 1.334 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 | | 735 | | 674 | 0,00 |
| **MASTR Reperforming Loan Trust** | | | | | |
| 1,984 % fällig am 25.07.2035 ^ | | 3.269 | | 1.707 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 25.08.2034 | | 11 | | 9 | 0,00 |
| **MASTR Seasoned Securitization Trust** | | | | | |
| 2,024 % fällig am 25.10.2032 | | 24 | | 23 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust** | | | | | |
| 2,950 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 2.759 | | 1.746 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | | |
| 0,274 % fällig am 25.01.2029 (a) | | 748 | | 4 | 0,00 |
| 1,546 % fällig am 25.09.2029 | | 154 | | 147 | 0,00 |
| 2,084 % fällig am 25.04.2029 | | 537 | | 505 | 0,00 |
| 2,268 % fällig am 25.01.2037 | | 55 | | 53 | 0,00 |
| 2,284 % fällig am 25.06.2028 | | 1 | | 1 | 0,00 |
| 2,344 % fällig am 25.08.2035 | | 3.354 | | 3.189 | 0,01 |
| 2,387 % fällig am 25.11.2035 | | 97 | | 95 | 0,00 |
| 2,449 % fällig am 25.11.2029 | | 890 | | 802 | 0,00 |
| 2,569 % fällig am 25.08.2036 | | 4.817 | | 4.009 | 0,01 |
| 2,698 % fällig am 25.12.2035 | | 2.254 | | 2.153 | 0,00 |
| 2,866 % fällig am 25.12.2034 | | 146 | | 147 | 0,00 |
| 3,235 % fällig am 25.05.2036 | | 4 | | 3 | 0,00 |
| **Metlife Securitization Trust** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 25.03.2057 | | 5.757 | | 5.621 | 0,01 |
| **Miravet SARL** | | | | | |
| 0,494 % fällig am 26.05.2065 | € | 40.420 | | 42.382 | 0,08 |
| **Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust** | | | | | |
| 1,092 % fällig am 15.02.2047 (a) | $ | 4.752 | | 49 | 0,00 |
| 3,046 % fällig am 15.04.2048 | | 40.000 | | 38.432 | 0,07 |
| **Morgan Stanley Capital Trust** | | | | | |
| 3,274 % fällig am 15.07.2035 | | 34.709 | | 32.910 | 0,06 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.06.2036 | | 3.747 | | 977 | 0,00 |
| 1,964 % fällig am 25.08.2036 | | 6.172 | | 2.036 | 0,00 |
| 2,535 % fällig am 25.06.2036 | | 1.284 | | 1.267 | 0,00 |
| 2,587 % fällig am 25.11.2037 ^ | | 97 | | 70 | 0,00 |
| 2,749 % fällig am 25.09.2035 | | 2.719 | | 2.780 | 0,01 |
| 2,751 % fällig am 25.08.2034 | | 65 | | 63 | 0,00 |
| 2,789 % fällig am 25.11.2037 | | 6.946 | | 5.466 | 0,01 |
| 3,052 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 1.877 | | 1.292 | 0,00 |
| 3,118 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 48 | | 35 | 0,00 |
| 3,604 % fällig am 25.09.2035 | | 1.317 | | 1.365 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.10.2037 ^ | | 325 | | 304 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 549 | | 501 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2035 | | 2.601 | | 1.179 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 | | 1.234 | | 664 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 2.495 | | 1.848 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2037 | | 7.980 | | 4.804 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2037 ^ | | 2.293 | | 1.507 | 0,00 |
| 6,354 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 1.296 | | 297 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 101 | | 55 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Re-REMIC Trust** | | | | | |
| 3,196 % fällig am 26.12.2036 | | 3.102 | | 2.818 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Resecuritization Trust** | | | | | |
| 1,164 % fällig am 26.11.2046 | | 3.481 | | 3.154 | 0,01 |
| 1,284 % fällig am 26.06.2047 | | 6.196 | | 5.097 | 0,01 |
| **Mortgage Equity Conversion Asset Trust** | | | | | |
| 3,300 % fällig am 25.02.2042 | | 8.084 | | 7.416 | 0,01 |
| **MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,084 % fällig am 25.06.2047 | | 9.364 | | 8.991 | 0,02 |
| 2,124 % fällig am 25.09.2037 | | 3.610 | | 3.207 | 0,01 |
| **MortgageIT Trust** | | | | | |
| 2,184 % fällig am 25.10.2035 | | 116 | | 111 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.08.2035 | | 2.168 | | 2.083 | 0,00 |
| 2,244 % fällig am 25.12.2035 | | 1.900 | | 1.827 | 0,00 |
| 2,312 % fällig am 25.02.2035 | | 2 | | 2 | 0,00 |
| 2,509 % fällig am 25.02.2035 | | 462 | | 448 | 0,00 |
| **Mortimer BTL PLC** | | | | | |
| 2,090 % fällig am 20.06.2051 | £ | 14.111 | $ | 17.149 | 0,03 |
| **New Century Alternative Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 4,680 % fällig am 25.10.2036 ^ | $ | 6.357 | | 1.550 | 0,00 |
| **New Residential Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 25.05.2058 | | 19.395 | | 19.299 | 0,03 |
| **Newgate Funding PLC** | | | | | |
| 0,319 % fällig am 15.12.2050 | € | 7.557 | | 7.751 | 0,01 |
| 1,452 % fällig am 01.12.2050 | £ | 1.588 | | 1.829 | 0,00 |
| 1,578 % fällig am 01.12.2050 | | 2.761 | | 3.169 | 0,01 |
| 1,749 % fällig am 15.12.2050 | | 10.641 | | 12.230 | 0,02 |
| 2,589 % fällig am 15.12.2050 | | 3.090 | | 3.596 | 0,01 |
| **Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust** | | | | | |
| 1,874 % fällig am 25.06.2037 | $ | 650 | | 568 | 0,00 |
| 2,144 % fällig am 25.12.2035 | | 797 | | 243 | 0,00 |
| 2,624 % fällig am 25.05.2035 | | 1.380 | | 1.146 | 0,00 |
| 2,644 % fällig am 25.08.2034 | | 391 | | 382 | 0,00 |
| 3,294 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 39 | | 33 | 0,00 |
| 3,720 % fällig am 25.06.2036 | | 310 | | 249 | 0,00 |
| 5,034 % fällig am 25.05.2035 | | 1.642 | | 917 | 0,00 |
| 5,688 % fällig am 25.07.2035 | | 685 | | 672 | 0,00 |
| 6,408 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 747 | | 196 | 0,00 |
| **Nomura Resecuritization Trust** | | | | | |
| 1,556 % fällig am 26.03.2037 | | 2.614 | | 2.347 | 0,01 |
| 2,524 % fällig am 25.07.2036 | | 21.859 | | 20.876 | 0,04 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | | |
| 0,371 % fällig am 25.09.2046 | | 11.900 | | 4.412 | 0,01 |
| **OBX Trust** | | | | | |
| 2,274 % fällig am 25.06.2057 | | 2.236 | | 2.193 | 0,00 |
| 2,474 % fällig am 25.04.2048 | | 1.061 | | 1.058 | 0,00 |
| **Paragon Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,651 % fällig am 15.05.2045 | £ | 24.481 | | 29.577 | 0,05 |
| **Pepper Residential Securities Trust** | | | | | |
| 2,512 % fällig am 18.11.2060 | $ | 5.770 | | 5.762 | 0,01 |
| **PHH Alternative Mortgage Trust** | | | | | |
| 2,104 % fällig am 25.05.2037 | | 2.617 | | 2.475 | 0,01 |
| 2,324 % fällig am 25.07.2037 | | 1.172 | | 1.144 | 0,00 |
| **Polaris PLC** | | | | | |
| 2,065 % fällig am 27.05.2057 | £ | 17.373 | | 21.062 | 0,04 |
| **Precise Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 12.12.2055 (e) | | 0 | | 16.043 | 0,03 |
| 1,551 % fällig am 12.03.2055 | | 11.921 | | 14.426 | 0,03 |
| 1,870 % fällig am 16.10.2056 | | 13.408 | | 16.119 | 0,03 |
| 2,390 % fällig am 16.10.2056 | | 1.200 | | 1.437 | 0,00 |
| 2,640 % fällig am 16.10.2056 | | 1.000 | | 1.195 | 0,00 |
| 2,890 % fällig am 16.10.2056 | | 1.000 | | 1.188 | 0,00 |
| 4,040 % fällig am 16.10.2056 | | 1.000 | | 1.196 | 0,00 |
| **Prime Mortgage Trust** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.06.2036 ^ | $ | 1 | | 1 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 40 | | 38 | 0,00 |
| **Primrose Residential DAC** | | | | | |
| 0,488 % fällig am 24.10.2061 | € | 34.507 | | 35.665 | 0,06 |
| **Proteus RMBS DAC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 29.10.2054 (b)(e) | | 14.190 | | 13.718 | 0,03 |
| 0,005 % fällig am 29.10.2054 | | 66.733 | | 69.453 | 0,12 |
| 0,455 % fällig am 29.10.2054 | | 8.681 | | 9.033 | 0,02 |
| 0,655 % fällig am 29.10.2054 | | 6.313 | | 6.565 | 0,01 |
| 1,305 % fällig am 29.10.2054 | | 4.735 | | 4.917 | 0,01 |
| 2,555 % fällig am 29.10.2054 | | 3.946 | | 4.088 | 0,01 |
| **RBSGC Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,074 % fällig am 25.01.2037 ^ | $ | 572 | | 223 | 0,00 |
| **RBSGC Structured Trust** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 72 | | 63 | 0,00 |
| **RBSSP Resecuritization Trust** | | | | | |
| 1,486 % fällig am 27.06.2036 | | 2.100 | | 1.610 | 0,00 |
| 2,495 % fällig am 26.01.2036 | | 7.065 | | 6.377 | 0,01 |
| 3,196 % fällig am 26.12.2036 | | 3.412 | | 3.315 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 26.05.2036 | | 1.632 | | 885 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 26.08.2037 | | 615 | | 541 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 26.10.2037 | | 2.309 | | 2.052 | 0,00 |
| **Ready Capital Mortgage Financing LLC** | | | | | |
| 3,774 % fällig am 25.02.2035 | | 14.097 | | 14.009 | 0,03 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | | |
| 1,259 % fällig am 25.10.2037 | | 5.452 | | 5.029 | 0,01 |
| 1,406 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 3.273 | | 2.545 | 0,01 |
| 1,572 % fällig am 25.11.2037 | | 480 | | 435 | 0,00 |
| 1,824 % fällig am 25.05.2037 | | 111 | | 106 | 0,00 |
| 1,836 % fällig am 25.09.2045 | | 480 | | 437 | 0,00 |
| 1,874 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 2.315 | | 1.749 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.08.2035 | $ | 163 | $ | 129 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.12.2036 | | 3.945 | | 2.756 | 0,01 |
| 1,924 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 1.070 | | 1.019 | 0,00 |
| 1,944 % fällig am 25.01.2037 | | 5.122 | | 4.600 | 0,01 |
| 1,964 % fällig am 25.12.2036 | | 2.625 | | 2.574 | 0,01 |
| 1,964 % fällig am 25.01.2037 | | 2.269 | | 1.954 | 0,00 |
| 1,974 % fällig am 25.12.2036 | | 2.204 | | 1.726 | 0,00 |
| 1,976 % fällig am 25.08.2035 | | 1.796 | | 1.537 | 0,00 |
| 1,984 % fällig am 25.07.2036 | | 1.079 | | 1.039 | 0,00 |
| 1,984 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 5.994 | | 2.850 | 0,01 |
| 1,984 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 2.131 | | 1.585 | 0,00 |
| 2,004 % fällig am 25.07.2036 | | 1.405 | | 1.354 | 0,00 |
| 2,004 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 2.094 | | 1.992 | 0,00 |
| 2,004 % fällig am 25.12.2036 | | 1.513 | | 1.348 | 0,00 |
| 2,004 % fällig am 25.07.2037 | | 4.596 | | 4.331 | 0,01 |
| 2,004 % fällig am 25.05.2047 | | 1.050 | | 966 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 167 | | 137 | 0,00 |
| 2,054 % fällig am 25.05.2046 | | 3.154 | | 2.745 | 0,01 |
| 2,164 % fällig am 25.02.2046 ^ | | 82 | | 53 | 0,00 |
| 2,164 % fällig am 25.05.2046 ^ | | 2.926 | | 2.453 | 0,01 |
| 2,224 % fällig am 25.04.2036 | | 2.143 | | 1.883 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 4.991 | | 3.844 | 0,01 |
| 3,131 % fällig am 25.02.2035 ^ | | 445 | | 237 | 0,00 |
| 3,252 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 134 | | 122 | 0,00 |
| 3,364 % fällig am 25.02.2035 ^ | | 494 | | 421 | 0,00 |
| 3,564 % fällig am 25.07.2035 ^ | | 1.036 | | 980 | 0,00 |
| 4,926 % fällig am 25.12.2036 (a) | | 2.117 | | 233 | 0,00 |
| 5,016 % fällig am 25.01.2037 (a) | | 2.131 | | 225 | 0,00 |
| 5,026 % fällig am 25.12.2036 (a) | | 826 | | 92 | 0,00 |
| 5,404 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 2.095 | | 1.726 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.06.2035 ^ | | 1.085 | | 980 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 1.525 | | 1.322 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.02.2036 | | 666 | | 574 | 0,00 |
| 5,576 % fällig am 25.12.2036 (a) | | 1.284 | | 159 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.01.2037 | | 364 | | 306 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 2.410 | | 2.222 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2035 | | 1.125 | | 1.012 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 527 | | 467 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 2.975 | | 2.573 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 316 | | 266 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 5.655 | | 4.794 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 1.001 | | 838 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 201 | | 172 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 | | 487 | | 413 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 454 | | 390 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 386 | | 340 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 336 | | 296 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 484 | | 420 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 133 | | 115 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 3.121 | | 2.622 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 504 | | 275 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 268 | | 230 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.02.2037 | | 5.331 | | 4.538 | 0,01 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | | | |
| 2,174 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 119 | | 58 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.08.2034 | | 907 | | 873 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 | | 2.675 | | 1.544 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 | | 1.509 | | 1.464 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2035 ^ | | 1.446 | | 1.033 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2036 | | 9.623 | | 4.679 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 2.996 | | 1.678 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 | | 900 | | 439 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 7.180 | | 2.706 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 9.898 | | 3.682 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 1.093 | | 734 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 1.075 | | 489 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 | | 2.349 | | 1.579 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2046 | | 1.499 | | 765 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2046 ^ | | 868 | | 445 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.08.2036 | | 1.253 | | 939 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 2.011 | | 862 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.07.2036 | | 1.069 | | 386 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 9.896 | | 3.339 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.06.2037 | | 6.824 | | 1.960 | 0,00 |
| 6,609 % fällig am 25.02.2037 | | 11.721 | | 3.645 | 0,01 |
| **Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust** | | | | | |
| 2,964 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 44 | | 23 | 0,00 |
| 3,430 % fällig am 25.04.2037 | | 104 | | 92 | 0,00 |
| 3,430 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 409 | | 360 | 0,00 |
| 3,437 % fällig am 25.04.2037 | | 149 | | 90 | 0,00 |
| 3,643 % fällig am 25.06.2035 | | 293 | | 198 | 0,00 |
| 4,123 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 90 | | 49 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 25.10.2018 | | 13 | | 6 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 4,588 % fällig am 27.07.2037 ^ | $ | 399 $ | 329 | 0,00 |
| 4,627 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 1.295 | 928 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 305 | 267 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 223 | 195 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.09.2036 | | 836 | 707 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.08.2036 | | 1.360 | 1.216 | 0,00 |
| **Residential Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 2,040 % fällig am 20.06.2070 | £ | 13.483 | 16.326 | 0,03 |
| **RESIMAC Bastille Trust** | | | | |
| 1,682 % fällig am 05.12.2059 | $ | 1.732 | 1.730 | 0,00 |
| 1,910 % fällig am 05.09.2057 | AUD | 14.987 | 10.258 | 0,02 |
| **RESIMAC Premier** | | | | |
| 1,920 % fällig am 07.02.2052 | | 14.231 | 9.764 | 0,02 |
| 2,170 % fällig am 07.02.2052 | $ | 3.532 | 3.528 | 0,01 |
| **Resloc UK PLC** | | | | |
| 1,989 % fällig am 15.12.2043 | | 4.088 | 3.899 | 0,01 |
| **Ripon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,351 % fällig am 28.08.2056 | £ | 587.409 | 706.351 | 1,24 |
| **River Green Finance DAC** | | | | |
| 0,700 % fällig am 22.01.2032 | € | 13.392 | 13.832 | 0,03 |
| **RiverView HECM Trust** | | | | |
| 1,894 % fällig am 25.05.2047 | $ | 5.913 | 5.455 | 0,01 |
| **RMAC PLC** | | | | |
| 1,571 % fällig am 12.06.2046 | £ | 20.085 | 24.250 | 0,04 |
| **RMAC Securities PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 12.06.2044 | € | 5.859 | 5.738 | 0,01 |
| 1,021 % fällig am 12.06.2044 | £ | 1.880 | 2.208 | 0,00 |
| 1,041 % fällig am 12.06.2044 | | 11.681 | 13.388 | 0,02 |
| 1,871 % fällig am 12.06.2044 | $ | 335 | 316 | 0,00 |
| **Roundstone Securities DAC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 28.09.2055 | € | 19.776 | 14.101 | 0,03 |
| 0,382 % fällig am 28.09.2055 | | 144.236 | 149.599 | 0,26 |
| 0,532 % fällig am 28.09.2055 | | 15.538 | 15.993 | 0,03 |
| 0,782 % fällig am 28.09.2055 | | 10.594 | 10.867 | 0,02 |
| 1,000 % fällig am 28.09.2055 | | 3.941 | 3.317 | 0,01 |
| 1,282 % fällig am 28.09.2055 | | 6.356 | 6.492 | 0,01 |
| 2,032 % fällig am 28.09.2055 | | 10.594 | 10.705 | 0,02 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | | |
| 1,030 % fällig am 20.02.2034 | $ | 301 | 269 | 0,00 |
| 2,235 % fällig am 20.11.2034 | | 818 | 752 | 0,00 |
| 2,978 % fällig am 20.07.2037 | | 1.631 | 1.366 | 0,00 |
| 3,260 % fällig am 20.06.2037 ^ | | 3.811 | 3.203 | 0,01 |
| **Sestante Finance SRL** | | | | |
| 0,000 % fällig am 23.07.2046 | € | 17.932 | 17.529 | 0,03 |
| **Shamrock Residential DAC** | | | | |
| 0,338 % fällig am 24.12.2059 | | 29.671 | 30.815 | 0,06 |
| 0,338 % fällig am 24.01.2061 | | 24.287 | 25.046 | 0,05 |
| **Stratton Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2060 | £ | 119.925 | 144.507 | 0,26 |
| 1,652 % fällig am 12.03.2052 | | 15.225 | 18.269 | 0,03 |
| 1,674 % fällig am 25.09.2051 | | 33.369 | 40.308 | 0,07 |
| 1,853 % fällig am 25.05.2051 | | 11.087 | 13.474 | 0,02 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.09.2034 | $ | 364 | 328 | 0,00 |
| 2,044 % fällig am 25.10.2035 | | 2.268 | 2.043 | 0,00 |
| 2,064 % fällig am 25.05.2037 | | 877 | 806 | 0,00 |
| 2,104 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 527 | 484 | 0,00 |
| 2,174 % fällig am 25.09.2034 | | 4.638 | 4.103 | 0,01 |
| 2,599 % fällig am 25.08.2035 | | 1.957 | 1.814 | 0,00 |
| 2,709 % fällig am 25.04.2036 | | 339 | 294 | 0,00 |
| 2,716 % fällig am 25.09.2034 | | 3 | 3 | 0,00 |
| 2,719 % fällig am 25.01.2035 | | 65 | 63 | 0,00 |
| 2,788 % fällig am 25.08.2036 | | 3.549 | 2.648 | 0,01 |
| 2,808 % fällig am 25.02.2035 | | 3.173 | 3.050 | 0,01 |
| 2,914 % fällig am 25.12.2034 | | 10 | 9 | 0,00 |
| 2,945 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 3.500 | 2.958 | 0,01 |
| 2,946 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 133 | 122 | 0,00 |
| 2,965 % fällig am 25.11.2037 ^ | | 225 | 177 | 0,00 |
| 3,064 % fällig am 25.01.2035 | | 264 | 254 | 0,00 |
| 3,074 % fällig am 25.07.2035 ^ | | 773 | 682 | 0,00 |
| 3,097 % fällig am 25.10.2036 | | 2.372 | 2.210 | 0,00 |
| 3,127 % fällig am 25.11.2035 | | 55 | 45 | 0,00 |
| 3,219 % fällig am 25.07.2035 ^ | | 191 | 126 | 0,00 |
| 3,586 % fällig am 25.11.2037 ^ | | 341 | 322 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 1,744 % fällig am 25.08.2036 | | 14.098 | 13.049 | 0,02 |
| 1,744 % fällig am 25.10.2036 | | 6.672 | 6.123 | 0,01 |
| 1,794 % fällig am 25.02.2036 | | 3.453 | 3.116 | 0,01 |
| 1,804 % fällig am 25.01.2037 | | 792 | 716 | 0,00 |
| 1,804 % fällig am 25.09.2047 | | 219 | 207 | 0,00 |
| 1,844 % fällig am 25.09.2047 | $ | 10.765 $ | 9.212 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 1,876 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 1.372 | 1.139 | 0,00 |
| 1,944 % fällig am 25.01.2037 | | 3.747 | 3.374 | 0,01 |
| 1,984 % fällig am 25.07.2046 | | 4.712 | 4.057 | 0,01 |
| 2,024 % fällig am 25.02.2036 | | 341 | 275 | 0,00 |
| 2,044 % fällig am 25.05.2036 | | 2.732 | 2.212 | 0,00 |
| 2,044 % fällig am 25.09.2047 ^ | | 15.143 | 16.853 | 0,03 |
| 2,064 % fällig am 25.05.2036 | | 11.020 | 9.432 | 0,02 |
| 2,075 % fällig am 19.04.2035 | | 4 | 3 | 0,00 |
| 2,084 % fällig am 25.05.2045 | | 63 | 57 | 0,00 |
| 2,095 % fällig am 19.07.2035 | | 40 | 37 | 0,00 |
| 2,174 % fällig am 25.09.2047 ^ | | 6.032 | 5.051 | 0,01 |
| 2,184 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 134 | 124 | 0,00 |
| 2,195 % fällig am 19.07.2034 | | 133 | 124 | 0,00 |
| 2,285 % fällig am 19.10.2034 | | 386 | 345 | 0,00 |
| 2,613 % fällig am 27.12.2035 ^ | | 152 | 155 | 0,00 |
| 2,720 % fällig am 19.12.2033 | | 479 | 450 | 0,00 |
| 3,079 % fällig am 25.05.2047 ^ | | 3.256 | 2.709 | 0,01 |
| **Structured Asset Securities Corp.** | | | | |
| 1,874 % fällig am 25.07.2035 | | 2.040 | 1.885 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,874 % fällig am 25.05.2036 | | 2.205 | 1.826 | 0,00 |
| **SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,741 % fällig am 25.10.2037 ^ | | 713 | 639 | 0,00 |
| 3,141 % fällig am 25.06.2037 | | 1.567 | 1.471 | 0,00 |
| **Sutherland Commercial Mortgage Loans** | | | | |
| 3,192 % fällig am 25.05.2037 | | 511 | 510 | 0,00 |
| **Taurus UK DAC** | | | | |
| 1,339 % fällig am 22.06.2029 | £ | 19.750 | 23.636 | 0,04 |
| **TBW Mortgage-Backed Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.07.2036 ^ | $ | 10 | 1 | 0,00 |
| 5,965 % fällig am 25.07.2037 | | 3.902 | 1.479 | 0,00 |
| **TDA Mixto Fondo de Titulizacion de Activos** | | | | |
| 0,002 % fällig am 22.06.2040 | € | 7.148 | 6.790 | 0,01 |
| **Terwin Mortgage Trust** | | | | |
| 2,184 % fällig am 25.10.2037 | $ | 5.589 | 2.278 | 0,00 |
| **Tharaldson Hotel Portfolio Trust** | | | | |
| 2,520 % fällig am 11.11.2034 | | 27.138 | 25.634 | 0,05 |
| 2,770 % fällig am 11.11.2034 | | 13.609 | 12.790 | 0,02 |
| 3,420 % fällig am 11.11.2034 | | 25.064 | 23.384 | 0,04 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 1,488 % fällig am 25.03.2044 | | 886 | 869 | 0,00 |
| 2,140 % fällig am 25.09.2037 | | 715 | 692 | 0,00 |
| 2,327 % fällig am 25.04.2036 | | 1.125 | 1.067 | 0,00 |
| 2,397 % fällig am 25.09.2037 | | 1.296 | 1.262 | 0,00 |
| 2,489 % fällig am 25.10.2046 | | 57 | 55 | 0,00 |
| 2,892 % fällig am 25.07.2036 | | 1.541 | 1.303 | 0,00 |
| 4,783 % fällig am 25.06.2037 | | 116 | 109 | 0,00 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2045 | £ | 46.223 | 56.059 | 0,10 |
| 1,511 % fällig am 20.10.2051 | | 13.000 | 15.386 | 0,03 |
| 1,527 % fällig am 20.05.2045 | | 61.141 | 73.968 | 0,13 |
| 1,547 % fällig am 20.02.2045 | | 21.677 | 26.262 | 0,05 |
| 1,605 % fällig am 20.10.2051 | | 7.697 | 9.317 | 0,02 |
| 1,661 % fällig am 20.10.2051 | | 4.400 | 5.143 | 0,01 |
| 1,827 % fällig am 20.02.2054 | | 42.766 | 51.949 | 0,09 |
| 1,861 % fällig am 20.10.2051 | | 4.000 | 4.639 | 0,01 |
| 2,511 % fällig am 20.10.2051 | | 13.500 | 15.750 | 0,03 |
| 2,961 % fällig am 20.10.2051 | | 4.500 | 5.229 | 0,01 |
| **Towd Point Mortgage Trust** | | | | |
| 2,750 % fällig am 25.06.2057 | $ | 8.016 | 7.833 | 0,01 |
| 2,750 % fällig am 25.10.2057 | | 13.513 | 13.212 | 0,02 |
| **Tower Bridge Funding PLC** | | | | |
| 2,160 % fällig am 20.09.2063 | £ | 20.076 | 24.423 | 0,04 |
| **Trinidad Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 1,404 % fällig am 24.01.2059 | | 4.793 | 5.787 | 0,01 |
| **Trinity Square PLC** | | | | |
| 1,850 % fällig am 15.07.2059 | | 34.300 | 41.218 | 0,07 |
| 2,150 % fällig am 15.07.2059 | | 11.400 | 13.499 | 0,02 |
| 2,450 % fällig am 15.07.2059 | | 8.600 | 10.152 | 0,02 |
| 3,200 % fällig am 15.07.2059 | | 5.700 | 6.695 | 0,01 |
| **Tudor Rose Mortgages** | | | | |
| 1,390 % fällig am 20.06.2048 | | 10.631 | 12.758 | 0,02 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | |
| 1,632 % fällig am 12.09.2050 | | 20.687 | 24.999 | 0,05 |
| 1,902 % fällig am 12.06.2053 | | 20.505 | 24.911 | 0,04 |
| 2,002 % fällig am 12.12.2054 | | 25.603 | 30.849 | 0,06 |
| **UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 1,014 % fällig am 10.03.2046 (a) | $ | 81.503 | 114 | 0,00 |
| 1,224 % fällig am 10.04.2046 (a) | | 8.959 | 27 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Uropa Securities PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 10.10.2040 | € | 7.258 $ | 7.235 | 0,01 |
| 1,437 % fällig am 10.10.2040 | £ | 8.160 | 9.156 | 0,02 |
| **Verus Securitization Trust** | | | | |
| 1,977 % fällig am 25.03.2060 | $ | 1.025 | 1.007 | 0,00 |
| 3,035 % fällig am 25.03.2060 | | 700 | 684 | 0,00 |
| 3,889 % fällig am 25.03.2060 | | 1.000 | 990 | 0,00 |
| **Wachovia Mortgage Loan Trust LLC** | | | | |
| 2,289 % fällig am 20.10.2035 ^ | | 241 | 233 | 0,00 |
| 2,795 % fällig am 20.08.2035 ^ | | 283 | 273 | 0,00 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 1,134 % fällig am 25.12.2046 | | 2.161 | 1.961 | 0,00 |
| 1,144 % fällig am 25.12.2046 ^ | | 5.961 | 5.213 | 0,01 |
| 1,176 % fällig am 25.02.2047 ^ | | 2.634 | 2.332 | 0,01 |
| 1,176 % fällig am 25.03.2047 ^ | | 556 | 496 | 0,00 |
| 1,226 % fällig am 25.06.2047 | | 12.673 | 11.192 | 0,02 |
| 1,236 % fällig am 25.04.2047 | | 254 | 228 | 0,00 |
| 1,246 % fällig am 25.04.2047 ^ | | 2.023 | 1.748 | 0,00 |
| 1,246 % fällig am 25.05.2047 | | 125 | 113 | 0,00 |
| 1,286 % fällig am 25.07.2047 | | 13.050 | 11.003 | 0,02 |
| 1,356 % fällig am 25.10.2046 ^ | | 6.694 | 5.902 | 0,01 |
| 1,372 % fällig am 25.05.2046 | | 46 | 42 | 0,00 |
| 1,396 % fällig am 25.09.2046 ^ | | 3.467 | 3.168 | 0,01 |
| 1,466 % fällig am 25.06.2046 | | 163 | 151 | 0,00 |
| 1,473 % fällig am 25.01.2047 | | 5.298 | 4.732 | 0,01 |
| 1,473 % fällig am 25.07.2047 ^ | | 1.609 | 1.433 | 0,00 |
| 1,476 % fällig am 25.02.2046 | | 2.778 | 2.537 | 0,01 |
| 1,723 % fällig am 25.08.2046 | | 2.355 | 2.149 | 0,00 |
| 1,723 % fällig am 25.09.2046 | | 2.477 | 2.353 | 0,01 |
| 1,723 % fällig am 25.10.2046 | | 2.211 | 2.033 | 0,00 |
| 1,723 % fällig am 25.11.2046 | | 1.862 | 1.713 | 0,00 |
| 2,244 % fällig am 25.01.2045 | | 785 | 761 | 0,00 |
| 2,324 % fällig am 25.12.2045 | | 1.714 | 1.566 | 0,00 |
| 2,364 % fällig am 25.01.2045 | | 2.202 | 2.139 | 0,00 |
| 2,387 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 737 | 690 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.10.2045 | | 14.702 | 11.987 | 0,02 |
| 2,577 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 3.368 | 3.146 | 0,01 |
| 2,577 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 915 | 797 | 0,00 |
| 2,604 % fällig am 25.10.2045 | | 801 | 763 | 0,00 |
| 2,624 % fällig am 25.12.2045 | | 6.900 | 6.573 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.08.2045 | | 4.833 | 4.648 | 0,01 |
| 2,713 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 6.695 | 6.187 | 0,01 |
| 2,784 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 1.576 | 1.421 | 0,00 |
| 2,798 % fällig am 25.03.2035 | | 2.299 | 2.282 | 0,00 |
| 2,808 % fällig am 25.01.2035 | | 2.111 | 2.015 | 0,00 |
| 2,831 % fällig am 25.09.2036 | | 4.516 | 3.922 | 0,01 |
| 2,842 % fällig am 25.12.2035 | | 6.466 | 6.254 | 0,01 |
| 2,853 % fällig am 25.08.2046 ^ | | 970 | 908 | 0,00 |
| 2,913 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 1.058 | 873 | 0,00 |
| 2,920 % fällig am 25.08.2046 ^ | | 193 | 179 | 0,00 |
| 2,943 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 2.990 | 2.701 | 0,01 |
| 2,978 % fällig am 25.04.2035 | | 1.690 | 1.617 | 0,00 |
| 2,989 % fällig am 25.05.2037 | | 1.618 | 1.405 | 0,00 |
| 3,011 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 2.929 | 2.812 | 0,01 |
| 3,011 % fällig am 25.10.2036 | | 1.559 | 1.497 | 0,00 |
| 3,036 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 4.439 | 4.194 | 0,01 |
| 3,052 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 242 | 222 | 0,00 |
| 3,052 % fällig am 25.12.2036 | | 587 | 539 | 0,00 |
| 3,098 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 980 | 853 | 0,00 |
| 3,108 % fällig am 25.03.2037 | | 129 | 121 | 0,00 |
| 3,120 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 1.388 | 1.229 | 0,00 |
| 3,138 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 143 | 128 | 0,00 |
| 3,145 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 1.845 | 1.716 | 0,00 |
| 3,176 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 4.902 | 4.671 | 0,01 |
| 3,188 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 1.634 | 1.483 | 0,00 |
| 3,213 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 1.024 | 952 | 0,00 |
| 3,222 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 1.391 | 1.274 | 0,00 |
| 3,258 % fällig am 25.07.2034 | | 207 | 143 | 0,00 |
| 3,325 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 9.204 | 8.756 | 0,02 |
| 3,368 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 3.908 | 3.746 | 0,01 |
| **Warwick Finance Residential Mortgages PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.12.2049 (e) | £ | 2 | 2.806 | 0,01 |
| 1,742 % fällig am 21.12.2049 | | 76.266 | 92.550 | 0,16 |
| 1,811 % fällig am 21.03.2042 | | 3.206 | 3.872 | 0,01 |
| 2,442 % fällig am 21.12.2049 | | 12.810 | 15.525 | 0,03 |
| 2,942 % fällig am 21.12.2049 | | 6.405 | 7.735 | 0,01 |
| 3,442 % fällig am 21.12.2049 | | 3.660 | 4.418 | 0,01 |
| 3,942 % fällig am 21.12.2049 | | 3.660 | 4.412 | 0,01 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 1,236 % fällig am 25.04.2047 ^ | $ | 4.840 | 4.249 | 0,01 |
| 1,306 % fällig am 25.11.2046 | | 111 | 95 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 1,396 % fällig am 25.09.2046 ^ | $ | 4.156 $ | 3.416 | 0,01 |
| 1,416 % fällig am 25.04.2046 | | 4.531 | 4.013 | 0,01 |
| 1,416 % fällig am 25.07.2046 ^ | | 6.259 | 4.071 | 0,01 |
| 1,436 % fällig am 25.08.2046 | | 3.916 | 2.541 | 0,01 |
| 1,473 % fällig am 25.04.2047 | | 19.488 | 17.671 | 0,03 |
| 1,944 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 789 | 681 | 0,00 |
| 1,974 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 1.630 | 1.420 | 0,00 |
| 2,074 % fällig am 25.05.2035 ^ | | 3.525 | 3.016 | 0,01 |
| 2,144 % fällig am 25.12.2035 | | 2.958 | 2.688 | 0,01 |
| 4,057 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 618 | 224 | 0,00 |
| 4,168 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 10.078 | 4.283 | 0,01 |
| 4,305 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 4.045 | 1.274 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.07.2035 ^ | | 1.139 | 1.062 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 92 | 87 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 2.187 | 1.877 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 161 | 149 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 2.740 | 2.612 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | | 4.883 | 4.002 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 | | 2.658 | 2.426 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 3.640 | 2.133 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 3.398 | 2.531 | 0,01 |
| 6,812 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 11.276 | 3.298 | 0,01 |
| 6,949 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 2.050 | 599 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 25.02.2036 | | 2.853 | 2.352 | 0,01 |
| 7,000 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 3.316 | 3.013 | 0,01 |
| **Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,923 % fällig am 25.01.2035 | | 233 | 220 | 0,00 |
| **Wells Fargo Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,974 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 1.331 | 1.182 | 0,00 |
| 2,054 % fällig am 25.06.2037 | | 949 | 766 | 0,00 |
| 4,446 % fällig am 25.06.2037 (a) | | 949 | 63 | 0,00 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,468 % fällig am 25.04.2037 | | 610 | 544 | 0,00 |
| 2,751 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 969 | 941 | 0,00 |
| 2,808 % fällig am 25.08.2035 | | 887 | 862 | 0,00 |
| 2,820 % fällig am 25.03.2036 | | 1.323 | 1.218 | 0,00 |
| 2,866 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 1.421 | 1.375 | 0,00 |
| 2,870 % fällig am 25.04.2036 | | 2.085 | 1.991 | 0,00 |
| 2,879 % fällig am 25.11.2037 ^ | | 305 | 289 | 0,00 |
| 2,904 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 127 | 116 | 0,00 |
| 2,980 % fällig am 25.10.2036 | | 2.858 | 2.692 | 0,01 |
| 3,027 % fällig am 25.10.2037 ^ | | 98 | 93 | 0,00 |
| 3,260 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 1.193 | 1.132 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2021 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 936 | 838 | 0,00 |
| **Wells Fargo-RBS Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 0,583 % fällig am 15.03.2047 (a) | | 83.200 | 618 | 0,00 |
| 0,740 % fällig am 15.03.2047 (a) | | 65.193 | 575 | 0,00 |
| 1,250 % fällig am 15.03.2045 (a) | | 68.872 | 176 | 0,00 |
| **Worldwide Plaza Trust** | | | | |
| 3,715 % fällig am 10.11.2036 | | 56.400 | 48.387 | 0,09 |
| | | | 7.587.248 | 13,34 |

## FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Aames Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 2,404 % fällig am 25.10.2035 | | 12.354 | 12.154 | 0,02 |
| **AccessLex Institute** | | | | |
| 1,176 % fällig am 26.09.2033 | | 5.763 | 5.519 | 0,01 |
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,014 % fällig am 25.04.2036 | | 1.943 | 1.930 | 0,00 |
| 1,844 % fällig am 25.02.2037 | | 1.000 | 958 | 0,00 |
| 1,884 % fällig am 25.09.2036 | | 7.359 | 7.216 | 0,01 |
| 1,894 % fällig am 25.09.2036 | | 12.235 | 11.410 | 0,02 |
| 1,894 % fällig am 25.02.2037 | | 9.754 | 8.819 | 0,02 |
| 2,084 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 13.735 | 10.988 | 0,02 |
| 2,494 % fällig am 25.09.2035 | | 5.921 | 5.604 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.07.2035 | | 2.496 | 2.379 | 0,00 |
| 2,659 % fällig am 25.04.2035 | | 369 | 369 | 0,00 |
| 2,704 % fällig am 25.10.2034 | | 1.729 | 1.618 | 0,00 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,744 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 8.738 | 2.460 | 0,01 |
| 1,744 % fällig am 25.12.2036 | | 11.419 | 6.829 | 0,01 |
| 1,754 % fällig am 25.12.2036 | | 27.173 | 16.130 | 0,03 |
| 1,779 % fällig am 25.08.2036 | | 6.275 | 6.008 | 0,01 |
| 1,794 % fällig am 25.11.2036 | | 12.563 | 5.849 | 0,01 |
| 1,904 % fällig am 25.07.2036 | | 4.663 | 4.469 | 0,01 |
| 1,924 % fällig am 25.07.2036 | | 31.957 | 12.711 | 0,02 |
| 1,964 % fällig am 25.01.2037 | | 2.820 | 1.850 | 0,00 |
| 2,064 % fällig am 25.12.2036 | | 206 | 80 | 0,00 |
| 2,064 % fällig am 25.01.2037 | $ | 10.898 $ | 3.196 | 0,01 |
| 2,104 % fällig am 25.04.2036 | | 7.429 | 6.669 | 0,01 |
| 2,104 % fällig am 25.07.2036 | | 7.412 | 2.530 | 0,01 |
| 2,184 % fällig am 25.06.2037 | | 2.055 | 1.953 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.02.2036 | | 1.065 | 1.053 | 0,00 |
| 2,239 % fällig am 25.12.2035 | | 4.200 | 4.022 | 0,01 |
| 2,284 % fällig am 25.11.2035 | | 2.540 | 2.546 | 0,01 |
| 2,314 % fällig am 25.05.2035 | | 555 | 555 | 0,00 |
| 2,389 % fällig am 25.08.2035 | | 17 | 18 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.12.2034 | | 3.505 | 3.239 | 0,01 |
| 2,524 % fällig am 25.08.2035 | | 1.800 | 1.759 | 0,00 |
| 2,599 % fällig am 25.11.2033 | | 825 | 801 | 0,00 |
| 2,644 % fällig am 25.04.2035 | | 1.786 | 1.739 | 0,00 |
| 3,424 % fällig am 25.06.2034 | | 122 | 123 | 0,00 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,794 % fällig am 25.01.2037 | | 1.318 | 1.062 | 0,00 |
| 2,269 % fällig am 25.12.2035 | | 2.170 | 2.089 | 0,00 |
| 2,344 % fällig am 25.08.2035 | | 937 | 912 | 0,00 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 3,349 % fällig am 25.10.2034 | | 1.719 | 1.660 | 0,00 |
| **ALESCO Preferred Funding Ltd.** | | | | |
| 2,434 % fällig am 23.12.2037 | | 30.575 | 28.129 | 0,05 |
| 2,474 % fällig am 23.09.2037 | | 7.012 | 6.451 | 0,01 |
| 2,514 % fällig am 23.06.2036 | | 17.016 | 16.441 | 0,03 |
| 2,534 % fällig am 23.12.2035 | | 12.513 | 11.715 | 0,02 |
| 2,554 % fällig am 23.09.2037 | | 2.000 | 1.705 | 0,00 |
| 2,604 % fällig am 23.12.2036 | | 5.000 | 4.406 | 0,01 |
| 2,904 % fällig am 23.09.2038 | | 6.781 | 6.416 | 0,01 |
| **Ameriquest Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 1,724 % fällig am 25.10.2036 | | 22.398 | 8.153 | 0,02 |
| 1,799 % fällig am 25.10.2036 | | 12.900 | 7.759 | 0,01 |
| 2,134 % fällig am 25.04.2036 | | 1.282 | 1.277 | 0,00 |
| 2,179 % fällig am 25.04.2036 | | 6.319 | 6.002 | 0,01 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,299 % fällig am 25.01.2036 | | 11.882 | 11.716 | 0,02 |
| 2,329 % fällig am 25.01.2036 | | 3.188 | 3.172 | 0,01 |
| 2,364 % fällig am 25.12.2033 | | 320 | 306 | 0,00 |
| 2,374 % fällig am 25.01.2036 | | 4.850 | 4.749 | 0,01 |
| 2,389 % fällig am 25.10.2035 | | 988 | 984 | 0,00 |
| 2,419 % fällig am 25.03.2035 | | 1.299 | 1.296 | 0,00 |
| 2,494 % fällig am 25.11.2035 | | 8.322 | 7.921 | 0,01 |
| 2,584 % fällig am 25.10.2035 | | 6.196 | 5.900 | 0,01 |
| 2,599 % fällig am 25.07.2035 | | 12.628 | 12.057 | 0,02 |
| 2,599 % fällig am 25.09.2035 | | 5.750 | 4.980 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.01.2035 ^ | | 2.410 | 2.307 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.05.2035 | | 1.961 | 1.855 | 0,00 |
| 2,719 % fällig am 25.09.2034 | | 4.759 | 4.535 | 0,01 |
| 2,775 % fällig am 25.06.2033 ^ | | 1.171 | 1.085 | 0,00 |
| 3,184 % fällig am 25.01.2035 | | 1.907 | 1.788 | 0,00 |
| 3,274 % fällig am 25.11.2034 | | 1.399 | 1.346 | 0,00 |
| 3,349 % fällig am 25.08.2035 | | 2.000 | 1.834 | 0,00 |
| 3,499 % fällig am 25.07.2034 | | 1.546 | 1.478 | 0,00 |
| 3,574 % fällig am 25.06.2034 | | 1.979 | 1.811 | 0,00 |
| 4,474 % fällig am 25.07.2034 | | 820 | 816 | 0,00 |
| **Ares European CLO DAC** | | | | |
| 1,120 % fällig am 21.10.2033 | € | 25.000 | 25.671 | 0,05 |
| **Argent Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,104 % fällig am 25.05.2035 | $ | 9.055 | 8.138 | 0,02 |
| **Argent Securities Trust** | | | | |
| 1,734 % fällig am 25.09.2036 | | 14.155 | 5.177 | 0,01 |
| 1,844 % fällig am 25.05.2036 | | 4.110 | 1.119 | 0,00 |
| 1,864 % fällig am 25.09.2036 | | 11.093 | 4.062 | 0,01 |
| 1,924 % fällig am 25.06.2036 | | 16.627 | 11.583 | 0,02 |
| 1,924 % fällig am 25.07.2036 | | 31.539 | 27.938 | 0,05 |
| 1,944 % fällig am 25.05.2036 | | 11.783 | 3.213 | 0,01 |
| 1,974 % fällig am 25.04.2036 | | 1.650 | 1.004 | 0,00 |
| 2,004 % fällig am 25.03.2036 | | 14.633 | 11.630 | 0,02 |
| 2,164 % fällig am 25.05.2036 | | 697 | 190 | 0,00 |
| **Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,094 % fällig am 25.01.2036 | | 10.200 | 9.977 | 0,02 |
| 2,284 % fällig am 25.11.2035 | | 11.640 | 11.407 | 0,02 |
| 2,384 % fällig am 25.02.2036 | | 9.986 | 8.131 | 0,02 |
| 2,389 % fällig am 25.10.2035 | | 5.750 | 5.247 | 0,01 |
| 2,524 % fällig am 25.05.2034 | | 313 | 285 | 0,00 |
| 2,749 % fällig am 25.11.2034 | | 3.267 | 3.237 | 0,01 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | |
| 1,754 % fällig am 25.01.2037 | | 540 | 394 | 0,00 |
| 1,764 % fällig am 25.10.2036 | | 254 | 237 | 0,00 |
| 1,784 % fällig am 25.01.2037 | | 11.868 | 7.314 | 0,01 |
| 1,844 % fällig am 25.10.2036 | $ | 11.252 $ | 9.342 | 0,02 |
| 1,904 % fällig am 25.11.2036 | | 10.379 | 6.637 | 0,01 |
| 2,044 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 7.670 | 7.087 | 0,01 |
| 2,284 % fällig am 25.03.2035 | | 4.521 | 4.373 | 0,01 |
| 2,324 % fällig am 25.06.2034 | | 3.130 | 3.010 | 0,01 |
| 2,404 % fällig am 25.11.2033 | | 1.120 | 1.063 | 0,00 |
| **Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.12.2036 | | 621 | 578 | 0,00 |
| 1,844 % fällig am 25.12.2036 | | 3.084 | 2.793 | 0,01 |
| 2,124 % fällig am 25.03.2036 | | 1.062 | 929 | 0,00 |
| 2,204 % fällig am 25.03.2036 | | 2.345 | 1.960 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.11.2035 | | 3.597 | 3.434 | 0,01 |
| 2,599 % fällig am 25.05.2035 | | 963 | 962 | 0,00 |
| 2,599 % fällig am 25.06.2035 ^ | | 2.510 | 2.285 | 0,00 |
| 2,644 % fällig am 25.07.2035 | | 3.500 | 3.373 | 0,01 |
| 3,469 % fällig am 25.05.2035 | | 307 | 297 | 0,00 |
| **Atlas Senior Loan Fund Ltd.** | | | | |
| 1,933 % fällig am 20.04.2028 | | 5.810 | 5.777 | 0,01 |
| **Aurium CLO DAC** | | | | |
| 0,670 % fällig am 16.04.2030 | € | 29.921 | 30.786 | 0,06 |
| **Bastille Euro CLO DAC** | | | | |
| 1,150 % fällig am 15.01.2034 | | 20.000 | 20.366 | 0,04 |
| **Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 1,930 % fällig am 28.04.2036 | $ | 1.453 | 1.410 | 0,00 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.11.2036 | | 651 | 632 | 0,00 |
| 1,874 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 2.112 | 2.767 | 0,01 |
| 1,924 % fällig am 25.06.2047 | | 192 | 183 | 0,00 |
| 1,964 % fällig am 25.05.2035 | | 18 | 17 | 0,00 |
| 1,964 % fällig am 25.12.2036 | | 11.406 | 10.911 | 0,02 |
| 1,974 % fällig am 25.06.2047 | | 9.140 | 7.688 | 0,01 |
| 2,074 % fällig am 25.01.2047 | | 2.521 | 2.422 | 0,01 |
| 2,124 % fällig am 25.08.2036 | | 6.246 | 5.683 | 0,01 |
| 2,124 % fällig am 25.05.2037 | | 2.620 | 2.561 | 0,01 |
| 2,144 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 2.510 | 2.109 | 0,00 |
| 2,164 % fällig am 25.04.2036 | | 2.449 | 2.435 | 0,01 |
| 2,164 % fällig am 25.06.2036 | | 627 | 625 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.02.2036 | | 1.608 | 1.602 | 0,00 |
| 2,254 % fällig am 25.12.2035 | | 932 | 930 | 0,00 |
| 2,359 % fällig am 25.09.2035 | | 166 | 166 | 0,00 |
| 2,624 % fällig am 25.10.2037 | | 428 | 427 | 0,00 |
| 2,629 % fällig am 25.06.2035 | | 3.323 | 3.278 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 2.045 | 1.900 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.08.2037 | | 11.314 | 10.426 | 0,02 |
| 2,704 % fällig am 25.12.2035 | | 2.333 | 1.926 | 0,00 |
| 2,749 % fällig am 25.02.2035 | | 863 | 857 | 0,00 |
| 2,824 % fällig am 25.06.2036 | | 1.414 | 1.359 | 0,00 |
| 3,019 % fällig am 25.01.2035 | | 531 | 510 | 0,00 |
| 3,065 % fällig am 25.10.2036 | | 145 | 142 | 0,00 |
| 3,379 % fällig am 25.09.2034 | | 1.620 | 1.587 | 0,00 |
| 3,574 % fällig am 25.11.2039 | | 1.243 | 1.226 | 0,00 |
| 3,624 % fällig am 25.02.2034 | | 249 | 239 | 0,00 |
| 3,724 % fällig am 25.09.2034 | | 185 | 178 | 0,00 |
| 3,799 % fällig am 25.01.2035 | | 2.047 | 1.944 | 0,00 |
| 3,874 % fällig am 25.08.2034 | | 611 | 581 | 0,00 |
| 4,774 % fällig am 25.12.2042 | | 1.707 | 1.771 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 2.272 | 1.328 | 0,00 |
| **Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust** | | | | |
| 3,624 % fällig am 25.03.2037 | | 2.151 | 2.043 | 0,00 |
| **Black Diamond CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 03.10.2029 | € | 2.312 | 2.414 | 0,01 |
| 2,012 % fällig am 03.10.2029 | $ | 2.400 | 2.396 | 0,00 |
| **BNC Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.03.2037 | | 8.362 | 7.922 | 0,01 |
| 1,874 % fällig am 25.07.2037 | | 11.631 | 9.571 | 0,02 |
| 1,934 % fällig am 25.05.2037 | | 6.547 | 6.026 | 0,01 |
| 1,944 % fällig am 25.11.2036 | | 1.461 | 1.421 | 0,00 |
| 1,984 % fällig am 25.10.2036 | | 5.953 | 4.566 | 0,01 |
| **BNPP AM Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 15.10.2031 | € | 11.700 | 12.030 | 0,02 |
| **Bombardier Capital Mortgage Securitization Corp. Trust** | | | | |
| 7,180 % fällig am 15.12.2029 | $ | 980 | 166 | 0,00 |
| 7,440 % fällig am 15.12.2029 | | 10.140 | 1.779 | 0,00 |
| 7,575 % fällig am 15.06.2030 | | 936 | 153 | 0,00 |
| **Brookside Mill CLO Ltd.** | | | | |
| 1,864 % fällig am 17.01.2028 | | 1.547 | 1.550 | 0,00 |
| **Cairn CLO DAC** | | | | |
| 0,670 % fällig am 31.01.2030 | € | 27.046 | 27.803 | 0,05 |
| **Camber PLC** | | | | |
| 1,571 % fällig am 09.11.2053 | $ | 30.714 | 483 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Capitalsource Real Estate Loan Trust** | | | |
| 1,639 % fällig am 20.01.2037 | $ 12.960 | $ 12.210 | 0,02 |
| 1,739 % fällig am 20.01.2037 | 5.400 | 4.953 | 0,01 |
| 1,839 % fällig am 20.01.2037 | 3.000 | 1.710 | 0,00 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,774 % fällig am 25.04.2036 ^ | 2.789 | 2.693 | 0,01 |
| 1,784 % fällig am 25.10.2036 | 14.304 | 13.786 | 0,03 |
| 1,884 % fällig am 25.02.2037 | 15.792 | 14.775 | 0,03 |
| 2,374 % fällig am 25.10.2035 | 8.186 | 7.888 | 0,01 |
| 2,419 % fällig am 25.09.2035 | 3.038 | 2.989 | 0,01 |
| 2,599 % fällig am 25.05.2035 | 510 | 509 | 0,00 |
| 2,614 % fällig am 25.06.2035 | 7.008 | 6.833 | 0,01 |
| **Centex Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,074 % fällig am 25.06.2036 | 1.688 | 1.678 | 0,00 |
| 2,344 % fällig am 25.01.2035 | 2.044 | 2.022 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.03.2035 | 3.157 | 2.958 | 0,01 |
| 6,060 % fällig am 25.09.2034 | 666 | 647 | 0,00 |
| **Chase Funding Trust** | | | |
| 2,374 % fällig am 25.09.2033 | 32 | 32 | 0,00 |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,974 % fällig am 25.10.2037 | 8.191 | 8.157 | 0,02 |
| 3,124 % fällig am 25.10.2037 | 71.896 | 67.319 | 0,12 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,694 % fällig am 25.05.2037 | 2.084 | 1.527 | 0,00 |
| 1,764 % fällig am 25.01.2037 | 11.259 | 10.224 | 0,02 |
| 1,774 % fällig am 25.12.2036 | 993 | 416 | 0,00 |
| 1,784 % fällig am 25.12.2036 | 19.162 | 11.037 | 0,02 |
| 1,799 % fällig am 25.05.2037 | 430 | 420 | 0,00 |
| 1,804 % fällig am 25.01.2037 | 15.036 | 11.633 | 0,02 |
| 1,824 % fällig am 25.05.2037 | 4.534 | 3.357 | 0,01 |
| 1,884 % fällig am 25.07.2045 | 4.548 | 3.482 | 0,01 |
| 1,894 % fällig am 25.05.2037 | 27.022 | 25.134 | 0,04 |
| 1,904 % fällig am 25.12.2036 | 4.682 | 4.584 | 0,01 |
| 1,914 % fällig am 25.09.2036 | 7.382 | 7.209 | 0,01 |
| 1,944 % fällig am 25.09.2036 | 1.550 | 1.187 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.11.2046 | 5.538 | 5.399 | 0,01 |
| 2,044 % fällig am 25.12.2036 | 4.382 | 4.308 | 0,01 |
| 2,044 % fällig am 25.01.2037 | 2.697 | 2.623 | 0,01 |
| 2,074 % fällig am 25.01.2037 | 434 | 399 | 0,00 |
| 2,124 % fällig am 25.08.2036 | 546 | 529 | 0,00 |
| 2,144 % fällig am 25.03.2036 | 4.339 | 4.065 | 0,01 |
| 2,224 % fällig am 25.12.2035 ^ | 2.064 | 1.964 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.03.2037 | 298 | 298 | 0,00 |
| 2,299 % fällig am 25.11.2045 | 226 | 225 | 0,00 |
| 5,775 % fällig am 25.10.2036 | 1.049 | 784 | 0,00 |
| 6,352 % fällig am 25.05.2036 ^ | 392 | 162 | 0,00 |
| 7,250 % fällig am 25.05.2036 | 13.116 | 7.712 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,629 % fällig am 25.10.2034 | 4.499 | 4.156 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | |
| 1,884 % fällig am 25.03.2037 | 6.157 | 5.600 | 0,01 |
| 2,029 % fällig am 25.08.2036 | 472 | 472 | 0,00 |
| 2,059 % fällig am 25.11.2036 | 5.175 | 5.095 | 0,01 |
| 2,074 % fällig am 25.10.2036 | 5.612 | 5.573 | 0,01 |
| 2,119 % fällig am 25.10.2036 | 400 | 386 | 0,00 |
| 2,254 % fällig am 25.02.2035 | 2.149 | 2.029 | 0,00 |
| 2,299 % fällig am 25.10.2035 ^ | 2.713 | 2.678 | 0,01 |
| 2,359 % fällig am 25.09.2035 ^ | 3.189 | 3.162 | 0,01 |
| 3,304 % fällig am 25.07.2035 | 4.266 | 4.003 | 0,01 |
| **Commonbond Student Loan Trust** | | | |
| 2,474 % fällig am 25.05.2041 | 160 | 159 | 0,00 |
| 2,550 % fällig am 25.05.2041 | 2.481 | 2.449 | 0,01 |
| **Conseco Finance Corp.** | | | |
| 6,280 % fällig am 01.09.2030 | 1.757 | 1.771 | 0,00 |
| 6,560 % fällig am 01.11.2028 | 1.880 | 1.870 | 0,00 |
| 6,920 % fällig am 01.12.2030 | 3.566 | 3.650 | 0,01 |
| 7,060 % fällig am 01.02.2031 | 1.771 | 1.624 | 0,00 |
| 7,500 % fällig am 01.03.2030 | 13.459 | 6.213 | 0,01 |
| 7,850 % fällig am 15.11.2026 | 159 | 159 | 0,00 |
| 7,860 % fällig am 01.03.2030 | 4.971 | 2.382 | 0,00 |
| **Conseco Finance Securitizations Corp.** | | | |
| 2,812 % fällig am 01.09.2033 | 2.190 | 2.169 | 0,00 |
| 7,100 % fällig am 01.02.2033 | 93 | 91 | 0,00 |
| 7,770 % fällig am 01.09.2031 | 1.024 | 1.043 | 0,00 |
| 7,970 % fällig am 01.05.2032 | 1.887 | 446 | 0,00 |
| 8,060 % fällig am 01.09.2029 | 14.402 | 3.737 | 0,01 |
| 8,260 % fällig am 01.12.2030 | 13.440 | 4.243 | 0,01 |
| 8,310 % fällig am 01.05.2032 | 20.172 | 4.963 | 0,01 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | |
| 1,954 % fällig am 25.03.2037 ^ | 8.325 | 7.579 | 0,01 |
| 2,104 % fällig am 25.04.2037 | $ 844 | $ 733 | 0,00 |
| 2,124 % fällig am 25.01.2046 ^ | 13.400 | 12.642 | 0,02 |
| 2,374 % fällig am 25.05.2034 | 526 | 518 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.03.2047 ^ | 1.624 | 1.396 | 0,00 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | |
| 1,764 % fällig am 25.06.2035 | 14.209 | 13.235 | 0,02 |
| 1,764 % fällig am 25.05.2037 | 6.636 | 6.282 | 0,01 |
| 1,764 % fällig am 25.06.2037 | 13.468 | 12.401 | 0,02 |
| 1,764 % fällig am 25.07.2037 | 3.420 | 3.165 | 0,01 |
| 1,764 % fällig am 25.07.2037 ^ | 1.106 | 1.084 | 0,00 |
| 1,764 % fällig am 25.08.2037 | 253 | 250 | 0,00 |
| 1,764 % fällig am 25.08.2037 ^ | 1.769 | 1.594 | 0,00 |
| 1,764 % fällig am 25.06.2047 ^ | 1.404 | 1.283 | 0,00 |
| 1,764 % fällig am 25.06.2047 | 1.293 | 1.199 | 0,00 |
| 1,774 % fällig am 25.04.2047 ^ | 2.103 | 2.095 | 0,00 |
| 1,774 % fällig am 25.06.2047 ^ | 736 | 734 | 0,00 |
| 1,794 % fällig am 25.06.2047 | 19.663 | 18.677 | 0,03 |
| 1,804 % fällig am 25.06.2047 | 603 | 568 | 0,00 |
| 1,804 % fällig am 25.11.2047 ^ | 2.877 | 3.149 | 0,01 |
| 1,814 % fällig am 25.11.2037 | 617 | 616 | 0,00 |
| 1,824 % fällig am 25.06.2047 ^ | 10.668 | 9.594 | 0,02 |
| 1,834 % fällig am 25.05.2047 ^ | 6.979 | 6.616 | 0,01 |
| 1,844 % fällig am 25.05.2037 | 7.674 | 7.399 | 0,01 |
| 1,844 % fällig am 25.08.2037 | 17.550 | 16.008 | 0,03 |
| 1,844 % fällig am 25.09.2037 ^ | 7.486 | 7.694 | 0,01 |
| 1,844 % fällig am 25.06.2047 | 13.687 | 13.142 | 0,02 |
| 1,844 % fällig am 25.06.2047 ^ | 11.245 | 10.513 | 0,02 |
| 1,854 % fällig am 25.05.2037 | 14.138 | 13.339 | 0,02 |
| 1,854 % fällig am 25.07.2037 ^ | 18.023 | 15.390 | 0,03 |
| 1,854 % fällig am 25.10.2047 | 7.180 | 7.090 | 0,01 |
| 1,864 % fällig am 25.02.2037 | 11.010 | 10.635 | 0,02 |
| 1,864 % fällig am 25.03.2037 | 16.203 | 15.197 | 0,03 |
| 1,874 % fällig am 25.01.2037 | 8.204 | 8.009 | 0,01 |
| 1,874 % fällig am 25.06.2047 | 15.883 | 15.221 | 0,03 |
| 1,884 % fällig am 25.12.2036 ^ | 8.407 | 7.642 | 0,01 |
| 1,884 % fällig am 25.09.2046 | 18.907 | 18.142 | 0,03 |
| 1,884 % fällig am 25.06.2047 ^ | 6.207 | 4.837 | 0,01 |
| 1,914 % fällig am 25.01.2037 | 13.000 | 11.753 | 0,02 |
| 2,059 % fällig am 25.01.2045 ^ | 2.700 | 2.431 | 0,01 |
| 2,094 % fällig am 25.04.2036 | 3.429 | 3.240 | 0,01 |
| 2,104 % fällig am 25.03.2047 ^ | 8.899 | 7.840 | 0,01 |
| 2,124 % fällig am 25.04.2046 ^ | 6.187 | 5.876 | 0,01 |
| 2,144 % fällig am 25.09.2046 ^ | 2.925 | 2.835 | 0,01 |
| 2,149 % fällig am 25.08.2036 | 4.759 | 4.588 | 0,01 |
| 2,179 % fällig am 25.07.2036 | 2.908 | 2.581 | 0,01 |
| 2,209 % fällig am 25.06.2036 ^ | 3.260 | 3.093 | 0,01 |
| 2,224 % fällig am 25.06.2036 | 1.799 | 1.785 | 0,00 |
| 2,284 % fällig am 25.04.2036 | 2.337 | 2.333 | 0,00 |
| 2,314 % fällig am 25.04.2036 | 17.721 | 17.102 | 0,03 |
| 2,324 % fällig am 25.03.2036 ^ | 6.596 | 5.922 | 0,01 |
| 2,329 % fällig am 25.09.2035 | 1.012 | 976 | 0,00 |
| 2,344 % fällig am 25.08.2035 | 1.794 | 1.658 | 0,00 |
| 2,344 % fällig am 25.05.2036 | 11.733 | 11.570 | 0,02 |
| 2,419 % fällig am 25.05.2036 | 14.800 | 14.035 | 0,03 |
| 2,464 % fällig am 25.10.2047 | 1.310 | 1.264 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.02.2036 | 494 | 494 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.02.2036 ^ | 4.955 | 4.676 | 0,01 |
| 2,524 % fällig am 25.05.2036 | 320 | 313 | 0,00 |
| 2,599 % fällig am 25.12.2035 | 1.246 | 1.236 | 0,00 |
| 2,599 % fällig am 25.01.2036 | 6.991 | 6.765 | 0,01 |
| 2,614 % fällig am 25.02.2036 ^ | 4.000 | 3.708 | 0,01 |
| 2,629 % fällig am 25.10.2035 | 6.582 | 6.483 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.11.2035 | 1.012 | 1.008 | 0,00 |
| 2,689 % fällig am 25.07.2035 | 5.179 | 5.106 | 0,01 |
| 2,689 % fällig am 25.08.2035 | 2.528 | 2.508 | 0,01 |
| 2,689 % fällig am 25.10.2035 | 7.500 | 7.119 | 0,01 |
| 2,704 % fällig am 25.05.2036 | 12.977 | 9.943 | 0,02 |
| 2,719 % fällig am 25.04.2036 ^ | 2.700 | 2.561 | 0,01 |
| 2,764 % fällig am 25.01.2036 | 3.000 | 2.886 | 0,01 |
| 2,824 % fällig am 25.11.2035 ^ | 7.978 | 7.428 | 0,01 |
| 2,974 % fällig am 25.04.2035 | 1.828 | 1.813 | 0,00 |
| 3,124 % fällig am 25.10.2034 | 783 | 776 | 0,00 |
| 3,124 % fällig am 25.02.2035 | 9.186 | 9.123 | 0,02 |
| 3,199 % fällig am 25.03.2035 | 3.700 | 3.553 | 0,01 |
| 3,274 % fällig am 25.12.2034 | 1.307 | 1.294 | 0,00 |
| 3,274 % fällig am 25.06.2035 | 2.077 | 2.037 | 0,00 |
| 3,574 % fällig am 25.08.2035 | 5.617 | 5.426 | 0,01 |
| 3,724 % fällig am 25.08.2035 | 728 | 632 | 0,00 |
| 4,024 % fällig am 25.10.2034 | 534 | 525 | 0,00 |
| 4,384 % fällig am 25.10.2046 ^ | 11.219 | 10.915 | 0,02 |
| 4,444 % fällig am 25.07.2036 | 5.294 | 4.827 | 0,01 |
| 5,115 % fällig am 25.10.2035 | 1.250 | 1.111 | 0,00 |
| 5,171 % fällig am 25.03.2035 | $ 6.376 | $ 6.207 | 0,01 |
| 5,348 % fällig am 25.02.2036 | 7.000 | 6.111 | 0,01 |
| 5,633 % fällig am 25.06.2035 | 6.091 | 5.321 | 0,01 |
| 5,805 % fällig am 25.04.2036 ^ | 556 | 490 | 0,00 |
| 5,971 % fällig am 25.09.2046 ^ | 1.569 | 1.566 | 0,00 |
| 5,989 % fällig am 25.10.2046 ^ | 87 | 82 | 0,00 |
| 6,770 % fällig am 25.10.2046 ^ | 8.649 | 6.276 | 0,01 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.** | | | |
| 2,124 % fällig am 25.10.2034 | 3.628 | 3.466 | 0,01 |
| 2,164 % fällig am 25.12.2034 | 5.844 | 5.552 | 0,01 |
| 2,344 % fällig am 25.07.2034 | 817 | 800 | 0,00 |
| 2,479 % fällig am 25.08.2034 | 629 | 619 | 0,00 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc.** | | | |
| 2,364 % fällig am 25.08.2047 | 15.245 | 14.659 | 0,03 |
| **Countrywide Asset-Backed Securities Notes Trust** | | | |
| 3,624 % fällig am 25.08.2047 | 427 | 425 | 0,00 |
| **Countrywide Revolving Home Equity Loan Trust** | | | |
| 1,504 % fällig am 15.05.2036 | 1.412 | 1.366 | 0,00 |
| 1,524 % fällig am 15.05.2036 | 853 | 809 | 0,00 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization CBO Ltd.** | | | |
| 0,729 % fällig am 16.02.2041 | 54.641 | 1.633 | 0,00 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC** | | | |
| 1,924 % fällig am 25.05.2036 | 3.895 | 2.743 | 0,01 |
| 1,924 % fällig am 25.10.2036 | 3.239 | 2.811 | 0,01 |
| 2,404 % fällig am 25.03.2034 | 424 | 412 | 0,00 |
| 3,009 % fällig am 25.12.2036 ^ | 4.460 | 3.761 | 0,01 |
| 3,191 % fällig am 25.12.2035 | 777 | 759 | 0,00 |
| 3,558 % fällig am 25.04.2037 | 4.765 | 3.428 | 0,01 |
| 4,702 % fällig am 25.12.2037 | 989 | 1.040 | 0,00 |
| 4,999 % fällig am 25.01.2033 ^ | 319 | 303 | 0,00 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,291 % fällig am 25.03.2037 ^ | 115 | 48 | 0,00 |
| 3,569 % fällig am 25.02.2037 ^ | 747 | 509 | 0,00 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | |
| 1,734 % fällig am 25.11.2036 | 11.080 | 5.557 | 0,01 |
| 1,774 % fällig am 25.11.2036 | 2.601 | 1.306 | 0,00 |
| 1,854 % fällig am 25.11.2036 | 902 | 454 | 0,00 |
| 2,104 % fällig am 25.10.2036 | 5.331 | 3.760 | 0,01 |
| 2,124 % fällig am 25.07.2036 | 2.462 | 2.338 | 0,00 |
| 3,136 % fällig am 25.01.2037 ^ | 4.313 | 1.612 | 0,00 |
| **CSAB Mortgage-Backed Trust** | | | |
| 2,084 % fällig am 25.11.2036 | 8.090 | 1.436 | 0,00 |
| 5,858 % fällig am 25.05.2037 | 5.621 | 1.637 | 0,00 |
| 5,898 % fällig am 25.05.2037 ^ | 845 | 246 | 0,00 |
| 6,580 % fällig am 25.09.2036 | 2.228 | 851 | 0,00 |
| **CVC Cordatus Loan Fund DAC** | | | |
| 0,650 % fällig am 21.07.2030 | € 38.230 | 39.451 | 0,07 |
| **ECMC Group Student Loan Trust** | | | |
| 2,674 % fällig am 25.05.2067 | $ 17.041 | 16.686 | 0,03 |
| **EFS Volunteer LLC** | | | |
| 2,034 % fällig am 25.10.2035 | 1.690 | 1.676 | 0,00 |
| **Ellington Loan Acquisition Trust** | | | |
| 2,674 % fällig am 25.05.2037 | 11.129 | 10.867 | 0,02 |
| 2,724 % fällig am 25.05.2037 | 12.235 | 11.878 | 0,02 |
| **Encore Credit Receivables Trust** | | | |
| 2,359 % fällig am 25.07.2035 | 1.899 | 1.804 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.11.2035 | 5.003 | 4.805 | 0,01 |
| 2,599 % fällig am 25.01.2036 | 5.000 | 4.490 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.07.2035 | 2.138 | 2.030 | 0,00 |
| **EquiFirst Loan Securitization Trust** | | | |
| 1,794 % fällig am 25.04.2037 | 1.581 | 1.464 | 0,00 |
| **EquiFirst Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,424 % fällig am 25.04.2035 | 2.091 | 1.952 | 0,00 |
| 4,249 % fällig am 25.12.2034 | 657 | 597 | 0,00 |
| 4,999 % fällig am 25.10.2034 | 1.104 | 1.098 | 0,00 |
| **FAB CBO BV** | | | |
| 0,522 % fällig am 20.08.2080 | € 451 | 458 | 0,00 |
| **FBR Securitization Trust** | | | |
| 2,359 % fällig am 25.11.2035 | $ 11.731 | 10.776 | 0,02 |
| **Fieldstone Mortgage Investment Trust** | | | |
| 1,246 % fällig am 25.11.2036 | 3.454 | 2.256 | 0,00 |
| 1,286 % fällig am 25.11.2036 | 9.252 | 8.675 | 0,02 |
| 1,486 % fällig am 25.11.2036 | 2.761 | 1.803 | 0,00 |
| 2,004 % fällig am 25.05.2036 | 7.675 | 5.556 | 0,01 |
| 2,269 % fällig am 25.02.2036 | 13.066 | 11.877 | 0,02 |
| 3,649 % fällig am 25.02.2035 | 1.453 | 1.428 | 0,00 |
| **Finance America Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,569 % fällig am 25.11.2034 | 629 | 593 | 0,00 |
| 2,644 % fällig am 25.11.2034 | 459 | 426 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,724 % fällig am 25.03.2037 | $ 5.321 | $ 2.804 | 0,01 |
| 1,734 % fällig am 25.12.2037 | 658 | 629 | 0,00 |
| 1,744 % fällig am 25.12.2036 | 8.811 | 8.159 | 0,02 |
| 1,774 % fällig am 25.03.2037 | 670 | 355 | 0,00 |
| 1,784 % fällig am 25.11.2036 | 8.100 | 7.979 | 0,01 |
| 1,784 % fällig am 25.12.2037 | 8.803 | 8.052 | 0,01 |
| 1,834 % fällig am 25.12.2037 | 13.001 | 11.925 | 0,02 |
| 1,904 % fällig am 25.12.2036 | 13.872 | 6.768 | 0,01 |
| 1,924 % fällig am 25.08.2036 | 192 | 180 | 0,00 |
| 1,934 % fällig am 25.07.2036 | 4.230 | 4.042 | 0,01 |
| 1,944 % fällig am 25.04.2036 | 6.691 | 6.461 | 0,01 |
| 1,944 % fällig am 25.06.2036 | 6.405 | 6.212 | 0,01 |
| 2,104 % fällig am 25.08.2036 | 8.082 | 7.599 | 0,01 |
| 2,104 % fällig am 25.10.2036 | 14.427 | 10.539 | 0,02 |
| 2,184 % fällig am 25.03.2036 | 3.320 | 3.280 | 0,01 |
| 2,224 % fällig am 25.02.2036 | 4.253 | 3.915 | 0,01 |
| 2,299 % fällig am 25.11.2035 | 337 | 332 | 0,00 |
| 2,299 % fällig am 25.11.2036 | 23 | 23 | 0,00 |
| 2,314 % fällig am 25.01.2036 | 3.874 | 3.482 | 0,01 |
| 2,329 % fällig am 25.05.2036 | 805 | 801 | 0,00 |
| 2,344 % fällig am 25.10.2035 | 290 | 289 | 0,00 |
| 2,344 % fällig am 25.11.2035 | 2.723 | 2.583 | 0,01 |
| 2,374 % fällig am 25.12.2035 | 4.336 | 4.147 | 0,01 |
| 2,449 % fällig am 25.06.2034 | 1.040 | 1.027 | 0,00 |
| 2,569 % fällig am 25.03.2035 | 997 | 978 | 0,00 |
| 2,569 % fällig am 25.09.2035 | 4.706 | 4.340 | 0,01 |
| 3,049 % fällig am 25.10.2034 | 479 | 469 | 0,00 |
| 3,424 % fällig am 25.09.2034 | 1.708 | 1.664 | 0,00 |
| **First NLC Trust** | | | |
| 1,694 % fällig am 25.08.2037 | 6.351 | 3.589 | 0,01 |
| 1,764 % fällig am 25.08.2037 | 195 | 111 | 0,00 |
| 1,804 % fällig am 25.08.2037 | 3.515 | 1.997 | 0,00 |
| 1,904 % fällig am 25.08.2037 | 49 | 28 | 0,00 |
| 2,359 % fällig am 25.02.2036 | 5.420 | 4.658 | 0,01 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | |
| 1,724 % fällig am 25.08.2036 | 7.019 | 2.606 | 0,01 |
| 1,759 % fällig am 25.10.2036 | 12.260 | 11.143 | 0,02 |
| 1,764 % fällig am 25.01.2037 | 23.034 | 13.412 | 0,02 |
| 1,774 % fällig am 25.10.2036 | 13.019 | 6.180 | 0,01 |
| 1,844 % fällig am 25.11.2036 | 6.896 | 2.767 | 0,01 |
| 1,904 % fällig am 25.02.2037 | 14.438 | 11.399 | 0,02 |
| 1,944 % fällig am 25.05.2036 | 9.096 | 5.697 | 0,01 |
| 1,964 % fällig am 25.02.2036 | 4.466 | 4.312 | 0,01 |
| 2,164 % fällig am 25.02.2036 | 300 | 266 | 0,00 |
| 2,239 % fällig am 25.11.2035 | 5.829 | 5.199 | 0,01 |
| 2,284 % fällig am 25.01.2036 | 1.621 | 1.574 | 0,00 |
| 2,299 % fällig am 25.01.2036 | 6.546 | 5.081 | 0,01 |
| 2,304 % fällig am 25.11.2035 | 505 | 498 | 0,00 |
| 2,374 % fällig am 25.06.2035 | 1.457 | 1.426 | 0,00 |
| 2,404 % fällig am 25.07.2035 | 2.259 | 2.162 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.07.2035 | 2.361 | 2.002 | 0,00 |
| 2,644 % fällig am 25.01.2035 | 3.763 | 3.287 | 0,01 |
| 2,689 % fällig am 25.06.2035 | 4.454 | 4.324 | 0,01 |
| 3,379 % fällig am 25.05.2034 ^ | 52 | 57 | 0,00 |
| **GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,284 % fällig am 25.12.2035 | 1.676 | 1.446 | 0,00 |
| **GE-WMC Mortgage Securities Trust** | | | |
| 1,884 % fällig am 25.08.2036 | 7.814 | 7.151 | 0,01 |
| **Goodgreen Trust** | | | |
| 3,930 % fällig am 15.10.2053 | 13.001 | 12.276 | 0,02 |
| **Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.** | | | |
| 2,504 % fällig am 15.09.2037 | 49.950 | 49.266 | 0,09 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | |
| 1,724 % fällig am 25.09.2036 | 4.211 | 1.160 | 0,00 |
| 1,724 % fällig am 25.12.2046 | 2.621 | 1.464 | 0,00 |
| 1,744 % fällig am 25.11.2036 | 5.233 | 1.659 | 0,00 |
| 1,764 % fällig am 25.12.2046 | 7.283 | 2.470 | 0,01 |
| 1,784 % fällig am 25.02.2037 | 6.252 | 2.205 | 0,00 |
| 1,804 % fällig am 25.07.2036 | 1.335 | 367 | 0,00 |
| 1,824 % fällig am 25.03.2037 | 8.232 | 2.794 | 0,01 |
| 1,944 % fällig am 25.06.2036 | 4.539 | 1.142 | 0,00 |
| 1,964 % fällig am 25.09.2036 | 5.730 | 1.612 | 0,00 |
| 1,964 % fällig am 25.03.2047 | 20.261 | 6.919 | 0,01 |
| 1,984 % fällig am 25.03.2036 | 12.198 | 4.994 | 0,01 |
| 1,984 % fällig am 25.12.2036 | 13.596 | 4.511 | 0,01 |
| 2,004 % fällig am 25.03.2036 | 6.235 | 2.715 | 0,01 |
| 2,104 % fällig am 25.11.2036 | 4.670 | 1.944 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.03.2036 | 3.582 | 2.138 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.05.2047 | 121 | 87 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| 2,344 % fällig am 25.10.2035 | 3.697 | 3.264 | 0,01 |
| 2,359 % fällig am 25.06.2035 | $ 2.485 | $ 2.413 | 0,00 |
| 2,384 % fällig am 25.01.2036 | 465 | 44 | 0,00 |
| 2,569 % fällig am 25.08.2035 | 1.604 | 1.501 | 0,00 |
| 5,558 % fällig am 25.05.2035 | 357 | 352 | 0,00 |
| 5,676 % fällig am 25.09.2035 | 3.599 | 2.666 | 0,01 |
| 5,788 % fällig am 25.05.2037 ^ | 6.138 | 3.075 | 0,01 |
| 5,917 % fällig am 25.03.2037 ^ | 2.382 | 562 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2047 ^ | 174 | 157 | 0,00 |
| 6,300 % fällig am 25.03.2037 ^ | 5.832 | 1.645 | 0,00 |
| 6,376 % fällig am 25.09.2036 | 734 | 237 | 0,00 |
| 6,459 % fällig am 25.09.2036 ^ | 4.912 | 1.583 | 0,00 |
| 6,483 % fällig am 25.03.2037 ^ | 5.499 | 1.869 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2047 | 1.165 | 730 | 0,00 |
| 6,599 % fällig am 25.03.2037 | 2.158 | 606 | 0,00 |
| **GSAMP Trust** | | | |
| 1,674 % fällig am 25.12.2046 | 321 | 171 | 0,00 |
| 1,724 % fällig am 25.12.2046 | 1.444 | 768 | 0,00 |
| 1,744 % fällig am 25.12.2036 | 5.164 | 2.740 | 0,01 |
| 1,764 % fällig am 25.11.2036 | 5.122 | 2.737 | 0,01 |
| 1,764 % fällig am 25.03.2047 | 6.463 | 5.994 | 0,01 |
| 1,774 % fällig am 25.08.2036 | 2.306 | 2.266 | 0,00 |
| 1,774 % fällig am 25.12.2046 | 487 | 259 | 0,00 |
| 1,784 % fällig am 25.08.2036 | 2.369 | 1.987 | 0,00 |
| 1,784 % fällig am 25.01.2037 | 16.373 | 10.544 | 0,02 |
| 1,794 % fällig am 25.12.2036 | 7.559 | 4.011 | 0,01 |
| 1,794 % fällig am 25.01.2037 | 5.929 | 5.756 | 0,01 |
| 1,854 % fällig am 25.12.2046 | 718 | 382 | 0,00 |
| 1,864 % fällig am 25.09.2036 | 18.662 | 7.519 | 0,01 |
| 1,894 % fällig am 25.03.2047 | 6.300 | 6.067 | 0,01 |
| 1,904 % fällig am 25.06.2036 | 2.186 | 2.100 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.12.2036 | 1.525 | 1.430 | 0,00 |
| 1,944 % fällig am 25.04.2036 | 5.149 | 3.636 | 0,01 |
| 1,944 % fällig am 25.05.2046 | 322 | 322 | 0,00 |
| 1,994 % fällig am 25.03.2047 | 3.302 | 2.786 | 0,01 |
| 1,999 % fällig am 25.10.2046 | 6.000 | 5.139 | 0,01 |
| 2,104 % fällig am 25.06.2036 | 2.213 | 1.355 | 0,00 |
| 2,144 % fällig am 25.02.2046 | 652 | 610 | 0,00 |
| 2,164 % fällig am 25.02.2036 | 106 | 103 | 0,00 |
| 2,209 % fällig am 25.01.2036 | 1.341 | 1.336 | 0,00 |
| 2,239 % fällig am 25.01.2036 | 2.504 | 2.341 | 0,00 |
| 2,269 % fällig am 25.11.2035 ^ | 4.904 | 4.297 | 0,01 |
| 2,494 % fällig am 25.11.2034 | 1.242 | 1.211 | 0,00 |
| 2,509 % fällig am 25.07.2045 ^ | 7.074 | 6.761 | 0,01 |
| 2,524 % fällig am 25.11.2035 ^ | 4.239 | 4.068 | 0,01 |
| 2,599 % fällig am 25.04.2035 ^ | 2.310 | 2.211 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.06.2034 | 455 | 438 | 0,00 |
| 4,999 % fällig am 25.02.2047 | 1.500 | 1.405 | 0,00 |
| **Harvest CLO DAC** | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | € 4.237 | 4.416 | 0,01 |
| 1,100 % fällig am 18.11.2029 | 480 | 497 | 0,00 |
| **Hildene TruPS Financials Note Securitization Ltd.** | | | |
| 2,349 % fällig am 10.10.2038 | $ 24.619 | 24.214 | 0,04 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | |
| 1,924 % fällig am 25.11.2036 | 1.726 | 1.700 | 0,00 |
| 2,104 % fällig am 25.10.2036 | 4.431 | 2.744 | 0,01 |
| 2,284 % fällig am 25.04.2036 | 2.526 | 2.191 | 0,00 |
| 2,299 % fällig am 25.02.2036 | 4.260 | 4.144 | 0,01 |
| 2,329 % fällig am 25.01.2036 | 3.141 | 3.012 | 0,01 |
| 2,419 % fällig am 25.11.2035 | 1.255 | 1.236 | 0,00 |
| 2,464 % fällig am 25.01.2035 | 840 | 805 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.12.2034 | 201 | 200 | 0,00 |
| 2,569 % fällig am 25.11.2035 | 409 | 388 | 0,00 |
| 2,869 % fällig am 25.05.2035 | 1.048 | 949 | 0,00 |
| 3,124 % fällig am 25.03.2035 | 867 | 827 | 0,00 |
| 3,274 % fällig am 25.12.2034 | 575 | 563 | 0,00 |
| 3,324 % fällig am 25.11.2034 | 646 | 635 | 0,00 |
| 3,374 % fällig am 25.11.2034 | 501 | 482 | 0,00 |
| **Home Equity Loan Trust** | | | |
| 1,854 % fällig am 25.04.2037 | 538 | 521 | 0,00 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | |
| 1,744 % fällig am 25.04.2037 | 6.120 | 4.227 | 0,01 |
| 1,764 % fällig am 25.11.2036 | 5.988 | 5.431 | 0,01 |
| 1,784 % fällig am 25.11.2036 | 4.224 | 3.698 | 0,01 |
| 1,794 % fällig am 25.04.2037 | 3.266 | 2.262 | 0,00 |
| 1,814 % fällig am 25.04.2037 | 10.299 | 7.140 | 0,01 |
| 1,814 % fällig am 25.07.2037 | 8.331 | 3.903 | 0,01 |
| 1,824 % fällig am 25.07.2037 | 9.693 | 5.870 | 0,01 |
| 1,864 % fällig am 25.11.2036 | 602 | 492 | 0,00 |
| 1,864 % fällig am 25.04.2037 | 11.205 | 7.786 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| 1,984 % fällig am 25.06.2036 | $ 3.479 | $ 3.319 | 0,01 |
| 2,004 % fällig am 25.06.2036 | 63 | 62 | 0,00 |
| 2,104 % fällig am 25.08.2036 | 5.732 | 5.228 | 0,01 |
| 2,284 % fällig am 25.03.2036 | 5.566 | 5.203 | 0,01 |
| 2,689 % fällig am 25.08.2035 | 1.000 | 950 | 0,00 |
| 2,869 % fällig am 25.03.2035 | 3.290 | 3.241 | 0,01 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | |
| 1,774 % fällig am 25.12.2036 | 2.884 | 2.631 | 0,01 |
| 1,814 % fällig am 25.01.2037 | 14.287 | 10.697 | 0,02 |
| 1,844 % fällig am 25.12.2036 | 16.637 | 8.019 | 0,01 |
| 1,874 % fällig am 25.05.2037 | 4.990 | 4.795 | 0,01 |
| 1,884 % fällig am 25.04.2037 | 12.707 | 7.055 | 0,01 |
| 2,064 % fällig am 25.12.2036 | 16.186 | 5.224 | 0,01 |
| 2,149 % fällig am 25.02.2036 | 2.065 | 1.855 | 0,00 |
| 2,164 % fällig am 25.12.2035 | 1.122 | 1.112 | 0,00 |
| 2,239 % fällig am 25.01.2036 | 9.198 | 8.775 | 0,02 |
| **Humboldt Americas LLC** | | | |
| 0,000 % fällig am 31.07.2022 | COP20.000.000 | 4.297 | 0,01 |
| **IndyMac Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | |
| 3,799 % fällig am 25.11.2034 | $ 123 | 123 | 0,00 |
| **IndyMac Manufactured Housing Contract Pass-Through Certificates** | | | |
| 6,750 % fällig am 25.02.2028 | 12 | 12 | 0,00 |
| **IXIS Real Estate Capital Trust** | | | |
| 1,684 % fällig am 25.05.2037 | 21.986 | 5.995 | 0,01 |
| 1,924 % fällig am 25.01.2037 | 14.106 | 5.715 | 0,01 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.** | | | |
| 2,134 % fällig am 25.02.2036 ^ | 2.893 | 2.841 | 0,01 |
| 2,164 % fällig am 25.02.2036 ^ | 2.711 | 2.465 | 0,01 |
| 2,164 % fällig am 25.03.2036 | 6.587 | 6.276 | 0,01 |
| 2,204 % fällig am 25.01.2036 | 124 | 124 | 0,00 |
| 2,239 % fällig am 25.10.2035 ^ | 678 | 670 | 0,00 |
| 2,254 % fällig am 25.05.2035 ^ | 7.352 | 6.958 | 0,01 |
| 2,269 % fällig am 25.10.2035 | 4.786 | 4.421 | 0,01 |
| 2,374 % fällig am 25.06.2035 | 5.981 | 5.897 | 0,01 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | |
| 1,704 % fällig am 25.12.2036 | 3.220 | 1.869 | 0,00 |
| 1,774 % fällig am 25.12.2036 | 5.882 | 3.440 | 0,01 |
| 1,804 % fällig am 25.07.2036 | 530 | 267 | 0,00 |
| 1,814 % fällig am 25.03.2047 | 2.923 | 2.898 | 0,01 |
| 1,834 % fällig am 25.10.2036 | 5.625 | 5.540 | 0,01 |
| 1,864 % fällig am 25.05.2037 | 11.722 | 11.588 | 0,02 |
| 1,884 % fällig am 25.03.2037 | 3.489 | 3.440 | 0,01 |
| 1,884 % fällig am 25.06.2037 | 5.168 | 5.150 | 0,01 |
| 1,894 % fällig am 25.08.2036 | 6.700 | 6.193 | 0,01 |
| 1,904 % fällig am 25.07.2036 | 24 | 24 | 0,00 |
| 1,914 % fällig am 25.07.2036 | 1.272 | 1.266 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.01.2037 | 336 | 325 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.03.2037 | 7.847 | 7.395 | 0,01 |
| 2,029 % fällig am 25.05.2036 | 2.910 | 2.843 | 0,01 |
| 2,029 % fällig am 25.07.2036 | 3.621 | 3.509 | 0,01 |
| 2,059 % fällig am 25.05.2036 | 5.191 | 4.896 | 0,01 |
| 2,074 % fällig am 25.07.2036 | 3.786 | 3.096 | 0,01 |
| 2,104 % fällig am 25.11.2036 | 4.601 | 3.956 | 0,01 |
| 2,134 % fällig am 25.04.2036 | 6.583 | 5.260 | 0,01 |
| 2,144 % fällig am 25.07.2036 | 2.726 | 2.670 | 0,01 |
| 2,624 % fällig am 25.11.2036 | 5.085 | 4.888 | 0,01 |
| 4,436 % fällig am 25.01.2037 ^ | 2.723 | 1.681 | 0,00 |
| 6,630 % fällig am 25.07.2036 ^ | 10.301 | 3.577 | 0,01 |
| **Kodiak CDO Ltd.** | | | |
| 0,795 % fällig am 07.08.2037 | 5.250 | 5.092 | 0,01 |
| **KVK CLO Ltd.** | | | |
| 1,938 % fällig am 14.01.2028 | 1.690 | 1.694 | 0,00 |
| **Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust** | | | |
| 6,630 % fällig am 15.04.2040 | 3.934 | 3.994 | 0,01 |
| **Lehman XS Trust** | | | |
| 1,426 % fällig am 25.06.2046 | 4.903 | 4.558 | 0,01 |
| 1,824 % fällig am 25.02.2037 | 11.325 | 10.605 | 0,02 |
| 1,934 % fällig am 25.03.2037 | 2.707 | 2.432 | 0,01 |
| 1,944 % fällig am 25.05.2036 | 3.642 | 4.042 | 0,01 |
| 1,964 % fällig am 25.10.2036 | 1.949 | 1.838 | 0,00 |
| 1,964 % fällig am 25.12.2036 | 4.528 | 4.047 | 0,01 |
| 1,984 % fällig am 25.06.2036 | 10 | 10 | 0,00 |
| 2,084 % fällig am 25.02.2037 | 6.413 | 5.301 | 0,01 |
| 2,144 % fällig am 25.05.2046 ^ | 1.751 | 1.596 | 0,00 |
| 2,144 % fällig am 25.02.2047 | 2.269 | 2.096 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| 2,204 % fällig am 25.09.2036 | $ 4.588 | $ 4.149 | 0,01 |
| 2,774 % fällig am 25.12.2037 | 1.111 | 1.141 | 0,00 |
| 5,111 % fällig am 25.01.2036 ^ | 2.263 | 2.119 | 0,00 |
| 6,390 % fällig am 25.04.2036 ^ | 40 | 49 | 0,00 |
| 6,790 % fällig am 24.06.2046 | 1.296 | 1.370 | 0,00 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,734 % fällig am 25.11.2036 | 341 | 120 | 0,00 |
| 1,774 % fällig am 25.11.2036 | 16.461 | 12.059 | 0,02 |
| 1,784 % fällig am 25.10.2036 | 29.672 | 10.842 | 0,02 |
| 1,784 % fällig am 25.12.2036 | 25.062 | 18.122 | 0,03 |
| 1,804 % fällig am 25.09.2036 | 13.849 | 4.501 | 0,01 |
| 1,824 % fällig am 25.07.2036 | 6.476 | 2.783 | 0,01 |
| 1,854 % fällig am 25.12.2036 | 1.480 | 615 | 0,00 |
| 1,864 % fällig am 25.08.2036 | 20.272 | 9.409 | 0,02 |
| 1,914 % fällig am 25.07.2036 | 5.391 | 3.984 | 0,01 |
| 1,924 % fällig am 25.05.2036 | 10.143 | 6.193 | 0,01 |
| 1,924 % fällig am 25.07.2036 | 2.518 | 1.087 | 0,00 |
| 1,944 % fällig am 25.05.2036 | 11.505 | 3.952 | 0,01 |
| 1,944 % fällig am 25.08.2036 | 2.575 | 1.198 | 0,00 |
| 1,944 % fällig am 25.09.2036 | 10.770 | 3.517 | 0,01 |
| 1,944 % fällig am 25.05.2046 | 15.059 | 13.649 | 0,02 |
| 1,984 % fällig am 25.03.2046 | 21.839 | 18.574 | 0,03 |
| 2,004 % fällig am 25.03.2046 | 2.782 | 1.207 | 0,00 |
| 2,104 % fällig am 25.08.2036 | 3.174 | 1.484 | 0,00 |
| 2,144 % fällig am 25.08.2045 | 630 | 610 | 0,00 |
| 2,184 % fällig am 25.10.2034 | 5.002 | 4.700 | 0,01 |
| 2,224 % fällig am 25.01.2036 | 13.474 | 12.447 | 0,02 |
| 2,224 % fällig am 25.02.2036 | 12.319 | 10.570 | 0,02 |
| 2,404 % fällig am 25.08.2035 | 8.292 | 8.092 | 0,01 |
| 2,419 % fällig am 25.06.2034 | 2.755 | 2.635 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.06.2035 | 6.270 | 6.135 | 0,01 |
| 2,749 % fällig am 25.04.2035 | 2.500 | 2.390 | 0,00 |
| 2,774 % fällig am 25.09.2034 | 1.647 | 1.592 | 0,00 |
| 3,049 % fällig am 25.02.2035 | 6.916 | 6.322 | 0,01 |
| **Man GLG Euro CLO DAC** | | | |
| 0,740 % fällig am 15.10.2030 | € 13.050 | 13.472 | 0,02 |
| 0,870 % fällig am 15.01.2030 | 16.052 | 16.624 | 0,03 |
| **MAPS Ltd.** | | | |
| 4,212 % fällig am 15.05.2043 | $ 25.263 | 23.442 | 0,04 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 1,674 % fällig am 25.10.2036 | 4.144 | 1.467 | 0,00 |
| 1,724 % fällig am 25.08.2036 | 8.648 | 3.425 | 0,01 |
| 1,759 % fällig am 25.08.2036 | 7.706 | 3.309 | 0,01 |
| 1,769 % fällig am 25.01.2037 | 23.056 | 7.687 | 0,01 |
| 1,774 % fällig am 25.10.2036 | 975 | 350 | 0,00 |
| 1,794 % fällig am 25.10.2036 | 926 | 922 | 0,00 |
| 1,824 % fällig am 25.10.2036 | 5.718 | 3.176 | 0,01 |
| 1,834 % fällig am 25.05.2037 | 8.064 | 7.658 | 0,01 |
| 1,844 % fällig am 25.11.2036 | 10.107 | 6.406 | 0,01 |
| 1,864 % fällig am 25.08.2036 | 4.193 | 1.686 | 0,00 |
| 1,884 % fällig am 25.10.2036 | 546 | 283 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.04.2036 | 2.213 | 669 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.06.2036 | 2.218 | 973 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.08.2036 | 14.739 | 5.851 | 0,01 |
| 1,944 % fällig am 25.10.2036 | 7.486 | 4.166 | 0,01 |
| 2,104 % fällig am 25.03.2036 | 3.298 | 2.437 | 0,01 |
| 2,124 % fällig am 25.11.2035 | 1.857 | 1.199 | 0,00 |
| 2,194 % fällig am 25.01.2036 | 2.943 | 2.884 | 0,01 |
| 2,314 % fällig am 25.03.2035 | 884 | 884 | 0,00 |
| 2,324 % fällig am 25.09.2034 | 2.367 | 2.276 | 0,00 |
| 2,374 % fällig am 25.10.2035 ^ | 5.198 | 4.946 | 0,01 |
| 2,629 % fällig am 25.03.2035 | 2.260 | 2.186 | 0,00 |
| 2,774 % fällig am 25.08.2037 | 7.099 | 6.538 | 0,01 |
| 3,349 % fällig am 25.06.2035 | 130 | 125 | 0,00 |
| 4,159 % fällig am 25.06.2035 | 2.159 | 2.047 | 0,00 |
| **MASTR Specialized Loan Trust** | | | |
| 1,884 % fällig am 25.06.2046 | 1.837 | 1.745 | 0,00 |
| 1,994 % fällig am 25.01.2037 | 4.111 | 2.009 | 0,00 |
| 4,624 % fällig am 25.07.2035 | 451 | 445 | 0,00 |
| **Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,804 % fällig am 25.06.2037 | 733 | 616 | 0,00 |
| 2,624 % fällig am 25.10.2037 | 7.688 | 6.932 | 0,01 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | |
| 1,734 % fällig am 25.07.2037 | 6.531 | 3.095 | 0,01 |
| 1,774 % fällig am 25.08.2037 | 1.721 | 1.614 | 0,00 |
| 1,864 % fällig am 25.02.2037 | 4.159 | 1.425 | 0,00 |
| 1,884 % fällig am 25.07.2037 | 2.316 | 1.120 | 0,00 |
| 1,904 % fällig am 25.05.2037 | 5.559 | 3.291 | 0,01 |
| 1,924 % fällig am 25.08.2037 | 13.360 | 9.089 | 0,02 |
| 1,944 % fällig am 25.03.2037 | 6.884 | 6.131 | 0,01 |
| 2,004 % fällig am 25.04.2047 | 480 | 225 | 0,00 |
| 2,074 % fällig am 25.02.2047 | 231 | 150 | 0,00 |
| 2,124 % fällig am 25.07.2037 | $ 393 | $ 111 | 0,00 |
| 2,144 % fällig am 25.03.2037 | 2.748 | 968 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.12.2036 | 2.861 | 2.691 | 0,01 |
| 2,224 % fällig am 25.01.2037 | 5.929 | 5.518 | 0,01 |
| 2,704 % fällig am 25.10.2035 | 224 | 220 | 0,00 |
| 2,749 % fällig am 25.08.2036 | 4.838 | 4.802 | 0,01 |
| **METAL Cayman Ltd.** | | | |
| 4,581 % fällig am 15.10.2042 | 28.985 | 22.852 | 0,04 |
| **MMcapS Funding Ltd.** | | | |
| 1,930 % fällig am 01.12.2035 | 3.009 | 2.949 | 0,01 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | |
| 1,694 % fällig am 25.10.2036 | 2.987 | 1.673 | 0,00 |
| 1,714 % fällig am 25.01.2037 | 16.889 | 8.958 | 0,02 |
| 1,724 % fällig am 25.07.2036 | 6.791 | 2.880 | 0,01 |
| 1,724 % fällig am 25.10.2036 | 1.427 | 725 | 0,00 |
| 1,734 % fällig am 25.10.2036 | 5.354 | 3.007 | 0,01 |
| 1,734 % fällig am 25.12.2036 | 3.910 | 2.157 | 0,00 |
| 1,734 % fällig am 25.02.2037 | 3.396 | 1.173 | 0,00 |
| 1,734 % fällig am 25.03.2037 | 446 | 213 | 0,00 |
| 1,754 % fällig am 25.02.2037 | 80 | 72 | 0,00 |
| 1,764 % fällig am 25.10.2036 | 14.692 | 7.480 | 0,01 |
| 1,764 % fällig am 25.05.2037 | 26.497 | 21.961 | 0,04 |
| 1,774 % fällig am 25.12.2036 | 11.562 | 6.385 | 0,01 |
| 1,774 % fällig am 25.02.2037 | 5.146 | 2.912 | 0,01 |
| 1,824 % fällig am 25.05.2037 | 7.703 | 4.614 | 0,01 |
| 1,834 % fällig am 25.01.2037 | 5.383 | 2.873 | 0,01 |
| 1,874 % fällig am 25.07.2036 | 8.877 | 7.540 | 0,01 |
| 1,874 % fällig am 25.12.2036 | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,884 % fällig am 25.02.2037 | 889 | 505 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.06.2036 | 3.359 | 1.928 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.07.2036 | 3.595 | 1.545 | 0,00 |
| 1,954 % fällig am 25.02.2037 | 13.454 | 7.645 | 0,01 |
| 2,104 % fällig am 25.06.2036 | 24.843 | 18.237 | 0,03 |
| 2,104 % fällig am 25.09.2036 | 25.417 | 10.419 | 0,02 |
| 2,119 % fällig am 25.03.2036 | 7.980 | 7.638 | 0,01 |
| 2,124 % fällig am 25.04.2036 | 10.121 | 9.486 | 0,02 |
| 2,124 % fällig am 25.07.2036 | 1.706 | 742 | 0,00 |
| 2,194 % fällig am 25.12.2035 | 6.235 | 5.181 | 0,01 |
| 2,284 % fällig am 25.01.2035 | 3.130 | 3.014 | 0,01 |
| 2,284 % fällig am 25.11.2035 | 7.076 | 6.878 | 0,01 |
| 2,299 % fällig am 25.12.2034 | 825 | 804 | 0,00 |
| 2,299 % fällig am 25.09.2035 | 633 | 605 | 0,00 |
| 2,329 % fällig am 25.12.2034 | 466 | 443 | 0,00 |
| 2,364 % fällig am 25.01.2034 | 1.983 | 1.894 | 0,00 |
| 2,419 % fällig am 25.01.2035 | 2.088 | 1.988 | 0,00 |
| 2,539 % fällig am 25.07.2034 | 457 | 443 | 0,00 |
| 2,539 % fällig am 25.03.2035 | 636 | 631 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.11.2034 | 1.375 | 1.346 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.02.2035 | 2.766 | 2.657 | 0,01 |
| 2,569 % fällig am 25.01.2035 | 4.813 | 4.456 | 0,01 |
| 2,599 % fällig am 25.04.2035 | 413 | 413 | 0,00 |
| 2,624 % fällig am 25.07.2037 | 8.756 | 8.662 | 0,02 |
| 2,644 % fällig am 25.08.2034 | 214 | 201 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.04.2035 | 292 | 279 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.06.2035 ^ | 3.750 | 3.445 | 0,01 |
| 2,779 % fällig am 25.12.2034 | 154 | 152 | 0,00 |
| 2,874 % fällig am 25.07.2037 | 8.600 | 7.821 | 0,01 |
| 3,424 % fällig am 25.05.2034 | 708 | 682 | 0,00 |
| 4,249 % fällig am 25.03.2034 | 794 | 753 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Capital, Inc. Trust** | | | |
| 2,164 % fällig am 25.03.2036 | 10.307 | 8.659 | 0,02 |
| 2,179 % fällig am 25.01.2036 | 2.869 | 2.293 | 0,00 |
| 2,204 % fällig am 25.01.2036 | 1.788 | 1.735 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | |
| 1,794 % fällig am 25.04.2037 | 17.641 | 10.113 | 0,02 |
| 1,944 % fällig am 25.04.2036 | 7.246 | 5.428 | 0,01 |
| 2,134 % fällig am 25.02.2036 | 6.343 | 5.926 | 0,01 |
| **Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust** | | | |
| 1,694 % fällig am 25.11.2036 | 7.105 | 2.656 | 0,01 |
| 1,774 % fällig am 25.11.2036 | 5.843 | 2.192 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.07.2036 | 14.107 | 6.416 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,784 % fällig am 25.11.2036 | 1.437 | 494 | 0,00 |
| 1,794 % fällig am 25.01.2047 ^ | 3.883 | 1.343 | 0,00 |
| 1,864 % fällig am 25.04.2037 | 15.601 | 5.406 | 0,01 |
| 1,964 % fällig am 25.10.2036 | 8.311 | 3.024 | 0,01 |
| 1,964 % fällig am 25.11.2036 | 1.533 | 535 | 0,00 |
| 2,104 % fällig am 25.04.2037 | 3.741 | 1.326 | 0,00 |
| 2,164 % fällig am 25.04.2037 | 16.419 | 6.842 | 0,01 |
| 5,763 % fällig am 25.01.2047 | 1.287 | 457 | 0,00 |
| 6,077 % fällig am 25.10.2046 ^ | 4.475 | 1.287 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.02.2037 | 4.483 | 3.265 | 0,01 |
| 6,298 % fällig am 25.10.2036 ^ | $ 9.130 | $ 2.471 | 0,01 |
| 6,488 % fällig am 25.11.2036 ^ | 6.463 | 1.902 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Structured Trust** | | | |
| 1,854 % fällig am 25.06.2037 | 1.469 | 1.467 | 0,00 |
| **Mountain View CLO LLC** | | | |
| 2,134 % fällig am 16.10.2029 | 48.537 | 47.930 | 0,09 |
| **Nassau Ltd.** | | | |
| 2,194 % fällig am 15.10.2029 | 19.036 | 18.949 | 0,03 |
| **National Collegiate Student Loan Trust** | | | |
| 1,934 % fällig am 25.05.2032 | 8.934 | 8.453 | 0,02 |
| 1,944 % fällig am 27.10.2031 | 15.010 | 14.685 | 0,03 |
| 1,974 % fällig am 25.03.2033 | 10.787 | 10.163 | 0,02 |
| 1,994 % fällig am 25.06.2033 | 3.904 | 3.717 | 0,01 |
| **Nationstar Home Equity Loan Trust** | | | |
| 1,799 % fällig am 25.06.2037 | 1.601 | 1.561 | 0,00 |
| **Navient Private Education Loan Trust** | | | |
| 2,650 % fällig am 15.12.2028 | 3.957 | 3.922 | 0,01 |
| 2,740 % fällig am 15.02.2029 | 1.046 | 1.044 | 0,00 |
| 2,774 % fällig am 16.07.2040 | 16.540 | 16.491 | 0,03 |
| 3,474 % fällig am 15.12.2045 | 8.302 | 8.411 | 0,02 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | |
| 1,784 % fällig am 25.08.2036 | 7.570 | 7.338 | 0,01 |
| 2,299 % fällig am 25.03.2035 | 562 | 560 | 0,00 |
| 2,344 % fällig am 25.03.2035 | 4.567 | 4.471 | 0,01 |
| 2,359 % fällig am 25.10.2035 | 10.000 | 8.477 | 0,02 |
| 2,389 % fällig am 25.02.2035 | 4.424 | 4.237 | 0,01 |
| 2,569 % fällig am 25.06.2035 | 1.425 | 1.395 | 0,00 |
| 2,569 % fällig am 25.09.2035 | 9.200 | 8.994 | 0,02 |
| 2,599 % fällig am 25.11.2034 | 319 | 309 | 0,00 |
| 2,599 % fällig am 25.06.2035 | 8.002 | 7.611 | 0,01 |
| 2,629 % fällig am 25.07.2035 | 12.000 | 11.793 | 0,02 |
| 2,689 % fällig am 25.03.2035 | 342 | 329 | 0,00 |
| **Newcastle Mortgage Securities Trust** | | | |
| 1,854 % fällig am 25.04.2037 | 11.431 | 11.238 | 0,02 |
| 2,299 % fällig am 25.03.2036 | 7.750 | 7.511 | 0,01 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | |
| 1,904 % fällig am 25.07.2036 | 10.729 | 9.121 | 0,02 |
| 1,954 % fällig am 25.10.2036 ^ | 7.299 | 1.743 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.02.2037 ^ | 10.229 | 3.344 | 0,01 |
| 2,104 % fällig am 25.03.2036 | 2.393 | 2.245 | 0,00 |
| 2,119 % fällig am 25.03.2036 | 5.146 | 4.785 | 0,01 |
| 2,284 % fällig am 25.11.2035 | 4.443 | 4.163 | 0,01 |
| 2,359 % fällig am 25.05.2035 | 40 | 40 | 0,00 |
| 2,389 % fällig am 25.05.2035 | 1.900 | 1.857 | 0,00 |
| 5,992 % fällig am 25.02.2037 ^ | 5.472 | 1.787 | 0,00 |
| 6,032 % fällig am 25.10.2036 ^ | 2.724 | 756 | 0,00 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | |
| 1,774 % fällig am 25.03.2037 | 3.232 | 1.309 | 0,00 |
| 1,794 % fällig am 25.01.2037 | 23.776 | 8.887 | 0,02 |
| 1,804 % fällig am 25.03.2037 | 27.785 | 11.253 | 0,02 |
| 1,804 % fällig am 25.09.2037 | 3.655 | 3.278 | 0,01 |
| 1,824 % fällig am 25.09.2037 | 12.097 | 11.692 | 0,02 |
| 1,924 % fällig am 25.06.2036 | 3.118 | 2.486 | 0,01 |
| 1,924 % fällig am 25.09.2036 | 5.441 | 2.585 | 0,01 |
| 1,944 % fällig am 25.05.2036 | 3.889 | 3.805 | 0,01 |
| 2,314 % fällig am 25.01.2036 | 8.000 | 7.423 | 0,01 |
| 2,329 % fällig am 25.01.2036 | 1.566 | 1.557 | 0,00 |
| 2,344 % fällig am 25.10.2035 | 3.859 | 3.847 | 0,01 |
| 2,359 % fällig am 25.01.2036 | 5.000 | 4.723 | 0,01 |
| 2,449 % fällig am 25.06.2034 | 550 | 540 | 0,00 |
| 3,349 % fällig am 25.12.2034 | 804 | 738 | 0,00 |
| 3,499 % fällig am 25.03.2035 | 4.138 | 4.082 | 0,01 |
| **Oakwood Mortgage Investors, Inc.** | | | |
| 5,050 % fällig am 15.11.2019 | 161 | 157 | 0,00 |
| 6,990 % fällig am 15.12.2026 | 138 | 138 | 0,00 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,744 % fällig am 25.03.2037 | 7.100 | 6.774 | 0,01 |
| 1,754 % fällig am 25.07.2037 | 11.718 | 9.006 | 0,02 |
| 1,764 % fällig am 25.01.2037 | 18.205 | 12.524 | 0,02 |
| 1,764 % fällig am 25.02.2037 | 21.326 | 14.767 | 0,03 |
| 1,764 % fällig am 25.03.2037 | 14.739 | 8.594 | 0,02 |
| 1,794 % fällig am 25.05.2037 | 21.018 | 12.164 | 0,02 |
| 1,804 % fällig am 25.04.2037 | 692 | 356 | 0,00 |
| 1,804 % fällig am 25.07.2037 | 4.875 | 3.752 | 0,01 |
| 1,814 % fällig am 25.07.2037 | 1.966 | 1.762 | 0,00 |
| 1,844 % fällig am 25.01.2037 | 7.753 | 4.840 | 0,01 |
| 1,844 % fällig am 25.04.2037 | 36.921 | 27.529 | 0,05 |
| 1,844 % fällig am 25.05.2037 | 5.437 | 3.665 | 0,01 |
| 1,874 % fällig am 25.03.2037 | 2.623 | 1.493 | 0,00 |
| 2,164 % fällig am 25.01.2036 | 20.429 | 19.120 | 0,03 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 2,359 % fällig am 25.05.2035 | $ | 1.000 $ | 961 | 0,00 |
| 2,359 % fällig am 25.08.2035 | | 1.057 | 1.053 | 0,00 |
| 2,419 % fällig am 25.05.2034 | | 2.158 | 2.079 | 0,00 |
| **Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 2,209 % fällig am 25.12.2035 | | 16 | 16 | 0,00 |
| 2,314 % fällig am 25.11.2035 | | 3.021 | 2.939 | 0,01 |
| **Ownit Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,120 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 1.097 | 691 | 0,00 |
| **Park Place Securities, Inc.** | | | | |
| 2,359 % fällig am 25.09.2035 | | 6.614 | 6.487 | 0,01 |
| 2,569 % fällig am 25.09.2035 | | 2.506 | 2.341 | 0,00 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,359 % fällig am 25.08.2035 | | 7.790 | 7.644 | 0,01 |
| 2,359 % fällig am 25.09.2035 | | 8.604 | 8.390 | 0,02 |
| 2,419 % fällig am 25.07.2035 | | 4.878 | 4.835 | 0,01 |
| 2,569 % fällig am 25.06.2035 | | 1.690 | 1.688 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.09.2034 | | 5.003 | 4.941 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.06.2035 | | 1.992 | 1.829 | 0,00 |
| 2,944 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 6.502 | 6.272 | 0,01 |
| 3,199 % fällig am 25.02.2035 | | 10.388 | 10.224 | 0,02 |
| 3,394 % fällig am 25.10.2034 | | 5.729 | 5.617 | 0,01 |
| 3,424 % fällig am 25.12.2034 | | 10.425 | 10.196 | 0,02 |
| 3,499 % fällig am 25.12.2034 | | 8.258 | 7.824 | 0,01 |
| 3,724 % fällig am 25.09.2034 | | 121 | 115 | 0,00 |
| **People's Choice Home Loan Securities Trust** | | | | |
| 2,304 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 8.642 | 8.188 | 0,02 |
| 2,479 % fällig am 25.08.2035 | | 7.935 | 7.657 | 0,01 |
| 2,569 % fällig am 25.05.2035 ^ | | 868 | 782 | 0,00 |
| **People's Financial Realty Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 1,864 % fällig am 25.09.2036 | | 10.881 | 2.486 | 0,01 |
| **Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 1,874 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 236 | 236 | 0,00 |
| 1,884 % fällig am 25.11.2036 | | 1.716 | 1.687 | 0,00 |
| 1,934 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 565 | 519 | 0,00 |
| 1,954 % fällig am 25.07.2036 | | 2.722 | 2.614 | 0,01 |
| 2,209 % fällig am 25.02.2036 | | 1.091 | 1.080 | 0,00 |
| 3,527 % fällig am 25.11.2035 | | 555 | 544 | 0,00 |
| **Pretium Mortgage Credit Partners LLC** | | | | |
| 2,240 % fällig am 27.09.2060 | | 14.501 | 13.792 | 0,03 |
| **Project Silver** | | | | |
| 3,967 % fällig am 15.07.2044 | | 19.550 | 16.806 | 0,03 |
| **RAAC Trust** | | | | |
| 2,134 % fällig am 25.08.2036 | | 79 | 79 | 0,00 |
| 2,164 % fällig am 25.05.2036 | | 629 | 622 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.06.2044 | | 1.462 | 1.270 | 0,00 |
| 2,274 % fällig am 25.06.2047 | | 2.226 | 2.193 | 0,00 |
| 2,314 % fällig am 25.11.2036 | | 744 | 737 | 0,00 |
| 2,374 % fällig am 25.02.2037 | | 2.775 | 2.570 | 0,01 |
| 2,384 % fällig am 25.10.2046 | | 2.302 | 2.179 | 0,00 |
| 2,479 % fällig am 25.03.2037 | | 1.239 | 1.234 | 0,00 |
| 2,824 % fällig am 25.10.2045 | | 702 | 699 | 0,00 |
| **Raptor Aircraft Finance LLC** | | | | |
| 4,213 % fällig am 23.08.2044 | | 51.296 | 39.700 | 0,07 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,384 % fällig am 25.12.2032 | | 47 | 41 | 0,00 |
| 5,285 % fällig am 25.01.2037 | | 2.823 | 1.094 | 0,00 |
| 5,294 % fällig am 25.01.2037 | | 18.519 | 7.189 | 0,01 |
| 5,512 % fällig am 25.04.2037 | | 8.724 | 2.888 | 0,01 |
| 5,545 % fällig am 25.01.2037 | | 2.365 | 961 | 0,00 |
| 5,612 % fällig am 25.04.2037 | | 5.992 | 2.018 | 0,00 |
| 5,675 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 421 | 139 | 0,00 |
| 5,731 % fällig am 25.11.2036 | | 4.838 | 2.069 | 0,00 |
| 5,742 % fällig am 25.04.2037 | | 8.089 | 2.786 | 0,01 |
| 5,744 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 5.934 | 1.975 | 0,00 |
| 5,762 % fällig am 25.08.2036 | | 8.258 | 3.740 | 0,01 |
| 5,797 % fällig am 25.08.2036 | | 12.841 | 5.851 | 0,01 |
| 5,812 % fällig am 25.11.2036 | | 8.751 | 3.792 | 0,01 |
| 5,857 % fällig am 25.05.2035 | | 2.174 | 1.868 | 0,00 |
| 5,879 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 2.974 | 1.013 | 0,00 |
| 5,893 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 28.633 | 9.775 | 0,02 |
| 5,906 % fällig am 25.06.2037 | | 7.657 | 2.620 | 0,01 |
| 6,120 % fällig am 25.11.2036 | | 11.908 | 5.416 | 0,01 |
| 6,511 % fällig am 25.07.2034 | | 1.500 | 1.287 | 0,00 |
| 6,998 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 2.381 | 1.173 | 0,00 |
| 7,238 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 9.882 | 4.867 | 0,01 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | | |
| 1,974 % fällig am 25.10.2036 | | 4.853 | 4.671 | 0,01 |
| 2,084 % fällig am 25.12.2035 | | 453 | 396 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 2,164 % fällig am 25.02.2036 | $ | 4.446 $ | 4.216 | 0,01 |
| 2,184 % fällig am 25.07.2036 | | 2.161 | 2.133 | 0,00 |
| 2,304 % fällig am 25.12.2035 | | 5.470 | 4.956 | 0,01 |
| 2,404 % fällig am 25.07.2035 | | 240 | 238 | 0,00 |
| 2,404 % fällig am 25.09.2035 | | 1.533 | 1.433 | 0,00 |
| 2,569 % fällig am 25.10.2035 | | 3.437 | 3.032 | 0,01 |
| 2,599 % fällig am 25.07.2035 | | 2.213 | 2.113 | 0,00 |
| 2,644 % fällig am 25.05.2035 | | 1.048 | 1.029 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.08.2035 | | 2.113 | 2.074 | 0,00 |
| 2,689 % fällig am 25.05.2035 | | 3.000 | 2.843 | 0,01 |
| 2,749 % fällig am 25.06.2035 | | 2.600 | 2.469 | 0,01 |
| 2,824 % fällig am 25.01.2035 ^ | | 2.683 | 2.512 | 0,01 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 1,831 % fällig am 25.01.2037 | | 7.267 | 6.387 | 0,01 |
| 1,844 % fällig am 25.01.2037 | | 3.978 | 3.805 | 0,01 |
| 1,844 % fällig am 25.02.2037 | | 7.899 | 7.426 | 0,01 |
| 1,884 % fällig am 25.07.2036 | | 74 | 74 | 0,00 |
| 1,904 % fällig am 25.07.2036 | | 4.312 | 4.097 | 0,01 |
| 1,904 % fällig am 25.09.2036 | | 4.234 | 4.102 | 0,01 |
| 1,964 % fällig am 25.05.2037 | | 1.600 | 1.583 | 0,00 |
| 2,044 % fällig am 25.06.2036 | | 422 | 419 | 0,00 |
| 2,059 % fällig am 25.06.2036 | | 3.422 | 3.213 | 0,01 |
| 2,134 % fällig am 25.04.2036 | | 6.000 | 5.225 | 0,01 |
| 2,164 % fällig am 25.07.2036 | | 2.620 | 2.327 | 0,00 |
| 2,184 % fällig am 25.04.2036 | | 1.618 | 1.587 | 0,00 |
| 2,209 % fällig am 25.03.2036 | | 3.718 | 3.660 | 0,01 |
| 2,224 % fällig am 25.02.2036 | | 1.465 | 1.432 | 0,00 |
| 2,254 % fällig am 25.02.2036 | | 3.752 | 3.571 | 0,01 |
| 2,269 % fällig am 25.03.2035 | | 306 | 304 | 0,00 |
| 2,284 % fällig am 25.11.2035 | | 2.193 | 2.179 | 0,00 |
| 2,284 % fällig am 25.12.2035 | | 3.988 | 3.865 | 0,01 |
| 2,314 % fällig am 25.11.2035 | | 1.151 | 1.131 | 0,00 |
| 2,329 % fällig am 25.10.2035 | | 2.047 | 1.713 | 0,00 |
| 2,329 % fällig am 25.11.2035 | | 476 | 457 | 0,00 |
| 2,344 % fällig am 25.01.2036 | | 5.593 | 5.425 | 0,01 |
| 2,374 % fällig am 25.04.2034 | | 566 | 545 | 0,00 |
| 2,404 % fällig am 25.06.2034 | | 2.094 | 2.043 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.08.2035 | | 3.494 | 3.431 | 0,01 |
| 2,659 % fällig am 25.10.2035 | | 2.013 | 1.946 | 0,00 |
| 2,869 % fällig am 25.03.2035 | | 1.010 | 959 | 0,00 |
| 3,424 % fällig am 25.04.2035 | | 653 | 615 | 0,00 |
| **Residential Funding Mortgage Securities Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 5,400 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 1.548 | 375 | 0,00 |
| **S-Jets Ltd.** | | | | |
| 3,967 % fällig am 15.08.2042 | | 32.540 | 28.647 | 0,05 |
| **Sapphire Aviation Finance Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.03.2040 | | 36.643 | 30.636 | 0,05 |
| **Saranac CLO Ltd.** | | | | |
| 3,723 % fällig am 22.06.2030 | | 35.921 | 35.546 | 0,06 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | | |
| 1,489 % fällig am 25.11.2035 | | 5.051 | 4.901 | 0,01 |
| 1,804 % fällig am 25.05.2037 | | 2.719 | 2.016 | 0,00 |
| 1,824 % fällig am 25.05.2047 | | 9.746 | 8.653 | 0,02 |
| 1,864 % fällig am 25.10.2046 | | 1.480 | 1.164 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 9.041 | 7.642 | 0,01 |
| 1,934 % fällig am 25.09.2037 | | 11.647 | 11.192 | 0,02 |
| 2,024 % fällig am 25.09.2047 | | 3.956 | 3.745 | 0,01 |
| 2,114 % fällig am 25.09.2047 | | 5.418 | 4.651 | 0,01 |
| 2,284 % fällig am 25.10.2035 | | 4.555 | 4.395 | 0,01 |
| 2,344 % fällig am 25.05.2035 | | 3.758 | 3.624 | 0,01 |
| 2,344 % fällig am 25.11.2037 | | 2.500 | 2.276 | 0,00 |
| 2,494 % fällig am 25.08.2035 | | 3.800 | 3.637 | 0,01 |
| 3,374 % fällig am 25.12.2037 | | 7.848 | 7.262 | 0,01 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.08.2036 | | 2.890 | 1.070 | 0,00 |
| 1,824 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 5.220 | 3.467 | 0,01 |
| 1,844 % fällig am 25.01.2037 | | 1.035 | 766 | 0,00 |
| 1,904 % fällig am 25.05.2036 | | 7.816 | 4.590 | 0,01 |
| 1,904 % fällig am 25.06.2036 | | 680 | 469 | 0,00 |
| 1,904 % fällig am 25.09.2036 | | 4.747 | 4.321 | 0,01 |
| 1,924 % fällig am 25.03.2036 | | 2.741 | 1.797 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.09.2036 | | 6.018 | 2.359 | 0,00 |
| 1,944 % fällig am 25.09.2036 | | 1.774 | 1.298 | 0,00 |
| 1,964 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 12.783 | 4.736 | 0,01 |
| 2,104 % fällig am 25.07.2036 | | 8.642 | 3.447 | 0,01 |
| 2,164 % fällig am 25.03.2036 | | 540 | 491 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.11.2035 | | 3.933 | 3.304 | 0,01 |
| 2,269 % fällig am 25.10.2035 | | 1.534 | 1.389 | 0,00 |
| 2,299 % fällig am 25.01.2035 | | 596 | 557 | 0,00 |
| 2,344 % fällig am 25.10.2035 | | 1.750 | 1.566 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 2,509 % fällig am 25.10.2035 | $ | 2.927 $ | 2.644 | 0,01 |
| 2,584 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 775 | 726 | 0,00 |
| **SG Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.07.2036 | | 23.543 | 5.751 | 0,01 |
| 1,984 % fällig am 25.02.2036 | | 4.141 | 2.483 | 0,01 |
| 2,164 % fällig am 25.02.2036 | | 2.178 | 1.321 | 0,00 |
| 2,329 % fällig am 25.10.2035 | | 921 | 857 | 0,00 |
| 2,509 % fällig am 25.10.2035 | | 1.083 | 884 | 0,00 |
| **SLM Private Credit Student Loan Trust** | | | | |
| 2,159 % fällig am 15.06.2039 | | 17.632 | 16.807 | 0,03 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.10.2039 | € | 2.751 | 2.755 | 0,01 |
| 0,087 % fällig am 25.07.2039 | | 15.965 | 16.122 | 0,03 |
| 0,087 % fällig am 25.01.2040 | | 24.600 | 24.273 | 0,04 |
| 0,269 % fällig am 15.12.2033 | | 2.462 | 2.433 | 0,01 |
| 2,684 % fällig am 25.04.2023 | $ | 18.364 | 18.279 | 0,03 |
| 2,884 % fällig am 25.07.2023 | | 9.318 | 9.308 | 0,02 |
| **SoFi Alternative Trust** | | | | |
| 2,210 % fällig am 16.05.2050 | | 21.154 | 20.865 | 0,04 |
| 3,873 % fällig am 15.06.2050 | | 20.369 | 20.017 | 0,04 |
| **SoFi Professional Loan Program LLC** | | | | |
| 2,574 % fällig am 25.01.2039 | | 107 | 107 | 0,00 |
| **Soloso CDO Ltd.** | | | | |
| 1,227 % fällig am 07.10.2037 | | 4.108 | 3.805 | 0,01 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 1,684 % fällig am 25.11.2036 | | 2.332 | 794 | 0,00 |
| 1,704 % fällig am 25.06.2037 | | 3.491 | 2.521 | 0,01 |
| 1,774 % fällig am 25.07.2036 | | 209 | 206 | 0,00 |
| 1,774 % fällig am 25.03.2037 | | 6.302 | 5.948 | 0,01 |
| 1,774 % fällig am 25.06.2037 | | 15.322 | 11.070 | 0,02 |
| 1,784 % fällig am 25.01.2037 | | 9.689 | 7.570 | 0,01 |
| 1,794 % fällig am 25.07.2037 | | 844 | 750 | 0,00 |
| 1,794 % fällig am 25.08.2037 | | 8.875 | 7.858 | 0,01 |
| 1,804 % fällig am 25.07.2037 | | 7.048 | 6.651 | 0,01 |
| 1,824 % fällig am 25.02.2037 | | 34.539 | 11.955 | 0,02 |
| 1,824 % fällig am 25.06.2037 | | 23.998 | 17.752 | 0,03 |
| 1,864 % fällig am 25.07.2036 | | 25.778 | 23.055 | 0,04 |
| 1,924 % fällig am 25.01.2037 | | 3.400 | 3.177 | 0,01 |
| 2,029 % fällig am 25.12.2036 | | 6.628 | 6.395 | 0,01 |
| 2,044 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 6.379 | 5.648 | 0,01 |
| 2,089 % fällig am 25.02.2036 | | 4.202 | 3.978 | 0,01 |
| 2,089 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 7.719 | 6.399 | 0,01 |
| 2,124 % fällig am 25.06.2036 | | 7.782 | 7.651 | 0,01 |
| 2,124 % fällig am 25.10.2036 | | 14.252 | 13.694 | 0,02 |
| 2,124 % fällig am 25.11.2036 | | 3.319 | 3.129 | 0,01 |
| 2,141 % fällig am 25.03.2036 | | 7.974 | 6.867 | 0,01 |
| 2,184 % fällig am 25.10.2036 | | 4.301 | 4.163 | 0,01 |
| 2,314 % fällig am 25.12.2035 | | 10.183 | 9.503 | 0,02 |
| 2,374 % fällig am 25.01.2035 | | 509 | 478 | 0,00 |
| 2,464 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 4.700 | 4.395 | 0,01 |
| 2,524 % fällig am 25.10.2037 | | 18.330 | 14.427 | 0,03 |
| 2,554 % fällig am 25.11.2035 | | 99 | 98 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 25.09.2037 | | 1.835 | 1.556 | 0,00 |
| 2,599 % fällig am 25.03.2036 | | 3.961 | 3.487 | 0,01 |
| 2,624 % fällig am 25.09.2037 | | 4.454 | 3.430 | 0,01 |
| 2,659 % fällig am 25.05.2035 | | 887 | 869 | 0,00 |
| 2,704 % fällig am 25.07.2035 | | 790 | 779 | 0,00 |
| 2,724 % fällig am 25.09.2037 | | 1.657 | 1.406 | 0,00 |
| **Southern Pacific Secured Asset Corp.** | | | | |
| 2,024 % fällig am 25.03.2028 | | 75 | 69 | 0,00 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | | |
| 1,744 % fällig am 25.04.2037 | | 876 | 646 | 0,00 |
| 1,774 % fällig am 25.11.2037 | | 9.397 | 5.977 | 0,01 |
| 1,844 % fällig am 25.09.2037 | | 3.369 | 1.476 | 0,00 |
| 1,904 % fällig am 25.09.2037 | | 8.070 | 7.338 | 0,01 |
| 1,974 % fällig am 25.03.2037 | | 1.630 | 1.029 | 0,00 |
| 2,599 % fällig am 25.12.2035 | | 1.495 | 1.463 | 0,00 |
| **START Ireland PLC** | | | | |
| 4,089 % fällig am 15.03.2044 | | 13.860 | 12.713 | 0,02 |
| **Starwood Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 2,528 % fällig am 15.07.2038 | | 22.695 | 22.524 | 0,04 |
| 2,848 % fällig am 15.07.2038 | | 14.830 | 14.668 | 0,03 |
| 3,048 % fällig am 15.07.2038 | | 5.930 | 5.896 | 0,01 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.07.2036 | | 2.053 | 2.018 | 0,00 |
| 1,796 % fällig am 25.07.2036 | | 16.504 | 11.024 | 0,02 |
| 1,944 % fällig am 25.05.2036 | | 875 | 868 | 0,00 |
| 1,984 % fällig am 25.04.2036 | | 384 | 383 | 0,00 |
| 2,004 % fällig am 25.03.2036 | | 2.732 | 2.662 | 0,01 |
| 2,174 % fällig am 25.09.2034 | | 4.217 | 3.897 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 2,224 % fällig am 25.04.2036 | $ | 9.000 $ | 5.085 | 0,01 |
| 2,244 % fällig am 25.01.2036 | | 3.269 | 3.115 | 0,01 |
| 2,254 % fällig am 25.11.2035 | | 7.703 | 7.440 | 0,01 |
| 2,344 % fällig am 25.04.2033 | | 478 | 463 | 0,00 |
| 2,344 % fällig am 25.04.2035 | | 3.605 | 3.550 | 0,01 |
| 2,344 % fällig am 25.01.2036 | | 5.038 | 4.898 | 0,01 |
| 2,374 % fällig am 25.07.2035 | | 1.931 | 1.871 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.05.2035 | | 5.164 | 5.094 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.06.2035 | | 5.875 | 5.675 | 0,01 |
| 2,624 % fällig am 25.09.2034 | | 3.679 | 3.597 | 0,01 |
| 2,749 % fällig am 25.07.2033 | | 495 | 486 | 0,00 |
| 2,824 % fällig am 25.12.2034 | | 564 | 560 | 0,00 |
| 2,899 % fällig am 25.12.2034 | | 1.470 | 1.429 | 0,00 |
| 3,004 % fällig am 25.04.2033 | | 13 | 12 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp.** | | | | |
| 2,749 % fällig am 25.02.2035 | | 2.030 | 1.967 | 0,00 |
| 2,764 % fällig am 25.02.2035 | | 584 | 546 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,754 % fällig am 25.05.2036 | | 3.893 | 3.751 | 0,01 |
| 1,779 % fällig am 25.09.2036 | | 10.278 | 7.411 | 0,01 |
| 1,784 % fällig am 25.01.2037 | | 7.334 | 7.063 | 0,01 |
| 1,794 % fällig am 25.01.2037 | | 1.498 | 1.478 | 0,00 |
| 1,804 % fällig am 25.03.2036 | | 2.012 | 1.942 | 0,00 |
| 1,844 % fällig am 25.10.2037 | | 20.834 | 14.039 | 0,03 |
| 1,854 % fällig am 25.01.2037 | | 15.890 | 10.744 | 0,02 |
| 1,854 % fällig am 25.02.2037 | | 13.622 | 12.975 | 0,02 |
| 1,854 % fällig am 25.05.2047 | | 7.106 | 6.866 | 0,01 |
| 1,874 % fällig am 25.09.2036 | | 1.717 | 1.712 | 0,00 |
| 1,894 % fällig am 25.07.2036 | | 894 | 893 | 0,00 |
| 1,914 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 7.680 | 7.332 | 0,01 |
| 1,934 % fällig am 25.08.2046 | | 4.846 | 4.577 | 0,01 |
| 2,124 % fällig am 25.11.2037 | | 22.041 | 19.027 | 0,03 |
| 2,149 % fällig am 25.07.2036 | | 1.797 | 1.693 | 0,00 |
| 2,244 % fällig am 25.12.2036 | | 15.945 | 9.605 | 0,02 |
| 2,244 % fällig am 25.02.2037 | | 5.300 | 4.883 | 0,01 |
| 2,524 % fällig am 25.08.2037 | | 990 | 983 | 0,00 |
| 3,649 % fällig am 25.07.2035 | | 1.430 | 1.412 | 0,00 |
| 3,724 % fällig am 25.11.2035 | | 129 | 126 | 0,00 |
| 4,024 % fällig am 25.08.2034 | | 138 | 133 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 1,894 % fällig am 25.05.2031 | | 390 | 290 | 0,00 |
| 6,617 % fällig am 25.05.2031 | | 1.468 | 1.265 | 0,00 |
| **Symphony CLO Ltd.** | | | | |
| 1,924 % fällig am 15.04.2028 | | 7.960 | 7.891 | 0,01 |
| **Taberna Preferred Funding Ltd.** | | | | |
| 1,432 % fällig am 05.07.2035 | | 10.031 | 9.128 | 0,02 |
| 1,703 % fällig am 05.05.2038 | | 12.772 | 12.133 | 0,02 |
| 1,723 % fällig am 05.12.2036 | | 24.379 | 21.454 | 0,04 |
| 1,793 % fällig am 05.11.2035 | | 16.994 | 15.592 | 0,03 |
| **Terwin Mortgage Trust** | | | | |
| 1,964 % fällig am 25.07.2037 | | 5.518 | 5.298 | 0,01 |
| 2,424 % fällig am 25.09.2036 | | 3.293 | 1.494 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.08.2036 | | 1.084 | 188 | 0,00 |
| **TICP CLO Ltd.** | | | | |
| 1,903 % fällig am 20.04.2028 | | 13.085 | 12.935 | 0,02 |
| **Trapeza CDO Ltd.** | | | | |
| 1,259 % fällig am 06.04.2042 | | 7.772 | 7.238 | 0,01 |
| 1,309 % fällig am 06.07.2041 | | 9.067 | 8.489 | 0,02 |
| 1,329 % fällig am 10.10.2041 | | 4.091 | 3.871 | 0,01 |
| 1,369 % fällig am 06.07.2041 | | 9.000 | 7.842 | 0,01 |
| 1,651 % fällig am 09.11.2042 | | 657 | 617 | 0,00 |
| **Tropic CDO Ltd.** | | | | |
| 1,364 % fällig am 15.07.2036 | | 13.753 | 13.014 | 0,02 |
| 1,794 % fällig am 15.04.2034 | | 117 | 116 | 0,00 |
| **Truman Capital Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,104 % fällig am 25.03.2036 | | 1.294 | 1.150 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **TruPS Financials Note Securitization Ltd.** | | | | |
| 3,420 % fällig am 30.03.2039 | | 32.194 | 30.906 | 0,06 |
| 3,666 % fällig am 20.09.2039 | | 11.439 | 10.839 | 0,02 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | |
| 1,924 % fällig am 15.04.2027 | | 28.798 | 28.487 | 0,05 |
| 1,924 % fällig am 15.07.2027 | | 5.699 | 5.701 | 0,01 |
| **WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust** | | | | |
| 1,754 % fällig am 25.07.2047 | | 6.191 | 4.093 | 0,01 |
| 1,774 % fällig am 25.01.2037 | | 20.291 | 17.933 | 0,03 |
| 1,814 % fällig am 25.04.2037 | | 25.830 | 10.918 | 0,02 |
| 1,874 % fällig am 25.05.2037 | | 3.448 | 3.010 | 0,01 |
| 1,874 % fällig am 25.07.2047 | | 5.941 | 3.951 | 0,01 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,854 % fällig am 25.04.2037 | | 2.745 | 2.667 | 0,01 |
| 1,944 % fällig am 25.07.2036 | $ | 3.200$ | 2.980 | 0,01 |
| 1,969 % fällig am 25.01.2037 | | 4.001 | 3.837 | 0,01 |
| 2,044 % fällig am 25.03.2037 | | 1.965 | 1.911 | 0,00 |
| 2,134 % fällig am 25.05.2036 | | 3.877 | 3.708 | 0,01 |
| 3,349 % fällig am 25.11.2035 | | 3.475 | 3.467 | 0,01 |
| 3,724 % fällig am 25.11.2035 | | 2.472 | 2.426 | 0,01 |
| 4,024 % fällig am 25.12.2034 | | 817 | 817 | 0,00 |
| 4,174 % fällig am 25.04.2035 | | 884 | 856 | 0,00 |
| 5,374 % fällig am 25.04.2035 | | 1.873 | 1.855 | 0,00 |
| **Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,364 % fällig am 25.04.2034 | | 234 | 226 | 0,00 |
| | | | 5.055.090 | 8,89 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 09.07.2030 | | 337.885 | 72.868 | 0,13 |
| 1,000 % fällig am 09.07.2029 | | 18.219 | 4.295 | 0,01 |
| 1,125 % fällig am 09.07.2035 | | 278.448 | 58.180 | 0,10 |
| 1,125 % fällig am 09.07.2046 | | 8.050 | 1.855 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 09.01.2038 | | 115.791 | 33.869 | 0,06 |
| 2,500 % fällig am 09.07.2041 | | 170.054 | 44.214 | 0,08 |
| 15,500 % fällig am 17.10.2026 | ARS | 297.359 | 352 | 0,00 |
| 47,331 % fällig am 04.10.2022 | | 131.518 | 113 | 0,00 |
| **Argentina Treasury Bond BONCER** | | | | |
| 1,400 % fällig am 25.03.2023 | | 8.644.908 | 31.714 | 0,06 |
| 1,450 % fällig am 13.08.2023 | | 4.674.274 | 15.978 | 0,03 |
| **Australia Government International Bond** | | | | |
| 1,750 % fällig am 21.06.2051 | AUD | 204.800 | 89.599 | 0,16 |
| **Autonomous City of Buenos Aires Argentina** | | | | |
| 52,234 % fällig am 22.02.2028 (a) | ARS | 766.034 | 2.746 | 0,00 |
| 53,715 % fällig am 29.03.2024 (a) | | 1.161.075 | 4.296 | 0,01 |
| **Colombia Government International Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 26.02.2024 | $ | 8.002 | 7.793 | 0,01 |
| **Export-Credit Bank of Turkey** | | | | |
| 8,250 % fällig am 24.01.2024 | | 13.400 | 13.192 | 0,02 |
| **Israel Government International Bond** | | | | |
| 3,800 % fällig am 13.05.2060 | | 191.411 | 159.972 | 0,28 |
| 4,500 % fällig am 03.04.2120 | | 19.300 | 17.585 | 0,03 |
| **Korea Development Bank** | | | | |
| 4,800 % fällig am 10.06.2023 | IDR | 400.150.000 | 26.701 | 0,05 |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,350 % fällig am 12.08.2040 | PEN | 138.138 | 27.248 | 0,05 |
| 5,400 % fällig am 12.08.2034 | | 1.092 | 232 | 0,00 |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | | 273.926 | 65.891 | 0,12 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 640.493 | 149.127 | 0,26 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 | | 121.086 | 30.049 | 0,05 |
| 6,900 % fällig am 12.08.2037 | | 17.536 | 4.182 | 0,01 |
| 6,950 % fällig am 12.08.2031 | | 66.549 | 16.637 | 0,03 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 8,200 % fällig am 12.08.2026 | | 289.399 | 79.649 | 0,14 |
| **Provincia de Buenos Aires** | | | | |
| 49,102 % fällig am 12.04.2025 | ARS | 3.331.617 | 11.183 | 0,02 |
| **Republic of Greece Government International Bond** | | | | |
| 3,500 % fällig am 30.01.2023 | € | 4.304$ | 4.571 | 0,01 |
| 3,750 % fällig am 30.01.2028 (m) | | 4.618 | 5.011 | 0,01 |
| 3,900 % fällig am 30.01.2033 (m) | | 9.948 | 10.494 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 30.01.2037 | | 6.211 | 6.860 | 0,01 |
| 4,200 % fällig am 30.01.2042 | | 3.488 | 3.892 | 0,01 |
| **Romania Government International Bond** | | | | |
| 1,750 % fällig am 13.07.2030 | | 72.300 | 54.031 | 0,09 |
| 2,000 % fällig am 14.04.2033 | | 27.192 | 18.509 | 0,03 |
| 2,125 % fällig am 07.03.2028 | | 25.500 | 22.002 | 0,04 |
| 2,750 % fällig am 14.04.2041 | | 34.000 | 20.838 | 0,04 |
| 2,875 % fällig am 13.04.2042 | | 68.000 | 41.736 | 0,07 |
| 3,750 % fällig am 07.02.2034 | | 29.500 | 23.183 | 0,04 |
| **Russia Government International Bond** | | | | |
| 0,000 % fällig am 24.04.2024 ^ | RUB | 18.336.201 | 30.142 | 0,05 |
| 1,850 % fällig am 20.11.2032 | € | 2.800 | 790 | 0,00 |
| 4,250 % fällig am 23.06.2027 ^ | $ | 32.400 | 8.910 | 0,02 |
| 4,375 % fällig am 21.03.2029 ^ | | 6.000 | 1.650 | 0,00 |
| 4,750 % fällig am 27.05.2026 | | 4.800 | 1.298 | 0,00 |
| 4,875 % fällig am 16.09.2023 | | 7.400 | 1.961 | 0,00 |
| 5,100 % fällig am 28.03.2035 ^ | | 20.000 | 5.300 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 23.06.2047 ^ | | 166.600 | 44.149 | 0,08 |
| 5,625 % fällig am 04.04.2042 ^ | | 69.000 | 20.355 | 0,04 |
| 5,875 % fällig am 16.09.2043 ^ | | 16.600 | 4.897 | 0,01 |
| 7,150 % fällig am 12.11.2025 ^ | RUB | 20.520.713 | 33.733 | 0,06 |
| 7,500 % fällig am 31.03.2030 ^ | $ | 16.872 | 4.640 | 0,01 |
| 7,950 % fällig am 07.10.2026 ^ | RUB | 7.973.492 | 13.107 | 0,02 |
| 12,750 % fällig am 24.06.2028 ^ | $ | 41.736 | 11.477 | 0,02 |
| **Serbia Government International Bond** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.05.2027 | € | 9.758 | 8.950 | 0,02 |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 8,000 % fällig am 31.01.2030 | ZAR | 372.700 | 19.779 | 0,03 |
| 8,250 % fällig am 31.03.2032 | | 451.300 | 23.078 | 0,04 |
| 8,750 % fällig am 28.02.2048 | | 212.700 | 10.012 | 0,02 |
| 8,875 % fällig am 28.02.2035 | | 322.800 | 16.524 | 0,03 |
| 10,500 % fällig am 21.12.2026 | | 12.158.400 | 785.910 | 1,38 |
| **Turkey Government International Bond** | | | | |
| 4,250 % fällig am 13.03.2025 | $ | 277.200 | 238.616 | 0,42 |
| 4,625 % fällig am 31.03.2025 | € | 12.900 | 12.528 | 0,02 |
| 5,250 % fällig am 13.03.2030 | $ | 155.000 | 111.119 | 0,20 |
| 6,350 % fällig am 10.08.2024 | | 7.082 | 6.565 | 0,01 |
| 7,625 % fällig am 26.04.2029 | | 122.900 | 103.905 | 0,18 |
| **Venezuela Government International Bond** | | | | |
| 6,000 % fällig am 09.12.2020 ^ | | 9.289 | 720 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 31.03.2038 ^ | | 14.228 | 1.245 | 0,00 |
| 7,650 % fällig am 21.04.2025 ^ | | 28.167 | 2.465 | 0,00 |
| 7,750 % fällig am 13.10.2019 ^ | | 5.850 | 453 | 0,00 |
| 8,250 % fällig am 13.10.2024 ^ | | 35.331 | 3.003 | 0,01 |
| 9,000 % fällig am 07.05.2023 ^ | | 13.516 | 1.149 | 0,00 |
| 9,250 % fällig am 15.09.2027 ^ | | 34.519 | 3.020 | 0,01 |
| 9,250 % fällig am 07.05.2028 ^ | | 39.817 | 3.484 | 0,01 |
| 11,750 % fällig am 21.10.2026 ^ | | 3.990 | 349 | 0,00 |
| 12,750 % fällig am 23.08.2022 ^ | | 6.170 | 540 | 0,00 |
| | | | 2.716.470 | 4,78 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | | |
| Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (d) | 26.868.244 | $ | 28.749 | 0,05 |
| iHeartMedia, Inc. 'A' (d) | 6.332.872 | | 49.966 | 0,09 |
| iHeartMedia, Inc. 'B' (d) | 4.913.662 | | 34.892 | 0,06 |
| | | | 113.607 | 0,20 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | | |
| Neiman Marcus Group Ltd. LLC (d)(I) | 1.179.713 | | 203.912 | 0,36 |
| **ENERGIE** | | | | |
| Constellation Oil Services Holding S.A. (d)(I) | 3.258.324 | | 353 | 0,00 |
| Noble Corp. (d)(I) | 2.942.124 | | 74.583 | 0,13 |
| Valaris Ltd. (d) | 164.386 | | 6.944 | 0,02 |
| | | | 81.880 | 0,15 |
| **FINANZWERTE** | | | | |
| Cairo Mezz PLC (d) | 3.408.327 | | 500 | 0,00 |
| Credit Suisse Group AG | 2.843.931 | | 16.187 | 0,03 |
| Eurobank Ergasias Services and Holdings S.A. 'A' (d) | 40.899.918 | | 36.602 | 0,06 |
| Intelsat Emergence S.A. (d)(I) | 4.649.159 | | 130.176 | 0,23 |
| Stearns Holdings LLC 'B' (d) | 1.114.539 | | 0 | 0,00 |
| Voyager Aviation Holdings LLC (d) | 2.155 | | 0 | 0,00 |
| | | | 183.465 | 0,32 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| Sierra Hamilton Holder LLC (d)(I) | 2.210.032 | | 0 | 0,00 |
| Westmoreland Mining Holdings LLC (d)(I) | 82.938 | | 0 | 0,00 |
| | | | 0 | 0,00 |
| | | | 582.864 | 1,03 |
| **RECHTE** | | | | |
| Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp 05/12/2025 | 1.026.237 | | 4.995 | 0,01 |
| **OPTIONSSCHEINE** | | | | |
| Constellation Oil Services Holding S.A. - Exp. 10.06.2071 (I) | 4 | | 0 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31. Dezember 2060 | 5.339 | $ | 0 | 0,00 |
| Intelsat Emergence S.A. - Exp. 17. Februar 2027 | 160.093 | | 427 | 0,00 |
| Sequa Corp. - Exp. 28. April 2024 | 174.000 | | 104 | 0,00 |
| Windstream Holdings II, LLC - Exp. 21. September 2055 | 2.022.886 | | 43.136 | 0,08 |
| | | | 43.667 | 0,08 |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | | |
| Nationwide Building Society 10,250 % | 859.974 | | 152.989 | 0,27 |
| Sequa Corp. 15,000 % | 5.598 | | 6.351 | 0,01 |
| Voyager Aviation Holdings LLC 9,500 % | 12.927 | | 3.909 | 0,01 |
| | | | 163.249 | 0,29 |
| **REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS** | | | | |
| CBL & Associates Properties, Inc. | 95.496 | | 2.243 | 0,00 |
| Uniti Group, Inc. | 979.763 | | 9.229 | 0,02 |
| VICI Properties, Inc. | 5.793.243 | | 172.581 | 0,30 |
| | | | 184.053 | 0,32 |

| | | PARI (000S) | | |
|---|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | | |
| Future Diamond Ltd. 11,154 % fällig am 22.09.2022 | $ | 600 | 561 | 0,00 |
| Pacific Gas and Electric Co. 2,370 % fällig am 14.11.2022 | | 16.900 | 16.832 | 0,03 |
| | | | 17.393 | 0,03 |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | | |
| (34,940) % fällig am 16.12.2022 (e)(f) | ARS | 698.200 | 3.219 | 0,01 |
| (2,140) % fällig am 29.07.2022 (e)(f) | | 15.491.571 | 59.629 | 0,10 |
| 50,753 % fällig am 30.09.2022 (e)(f) | | 7.030.700 | 23.567 | 0,04 |
| 51,049 % fällig am 30.09.2022 (e)(f) | | 3.000.000 | 10.056 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 59,492 % fällig am 31.10.2022 (e)(f) | 1.485.110 | | 4.771 | 0,01 |
| | | | 101.242 | 0,18 |
| **ISRAEL TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,020) % fällig am 07.12.2022 (e)(f) | ILS | 207.500 | $ 59.092 | 0,10 |
| 0,000 % fällig am 07.12.2022 (e)(f) | | 92.800 | 26.428 | 0,05 |
| | | | 85.520 | 0,15 |
| **U.S. TREASURY BILLS** | | | | |
| 0,722 % fällig am 26.07.2022 (e)(f) | $ | 107.800 | 107.724 | 0,19 |
| 0,797 % fällig am 14.07.2022 (e)(f) | | 535.300 | 535.095 | 0,94 |
| 0,819 % fällig am 21.07.2022 (e)(f) | | 14.700 | 14.692 | 0,02 |
| 0,874 % fällig am 21.07.2022 (e)(f)) | | 583.900 | 583.572 | 1,03 |
| 0,904 % fällig am 19.07.2022 (e)(f) | | 55.000 | 54.972 | 0,10 |
| 0,904 % fällig am 28.07.2022 (e)(f) | | 14.900 | 14.888 | 0,02 |
| 1,089 % fällig am 23.08.2022 (e)(f)(n) | | 90.700 | 90.503 | 0,16 |
| 1,139 % fällig am 01.09.2022 (e)(f) | | 148.300 | 147.913 | 0,26 |
| 1,159 % fällig am 06.09.2022 (e)(f) | | 207.600 | 207.011 | 0,36 |
| 1,416 % fällig am 04.10.2022 (e)(f) | | 285.000 | 283.646 | 0,50 |
| 2,088 % fällig am 25.10.2022 (e)(f) | | 125.000 | 124.195 | 0,22 |
| 2,103 % fällig am 25.10.2022 (e)(f) | | 50.000 | 49.678 | 0,09 |
| | | | 2.213.889 | 3,89 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 2.418.044 | 4,25 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **$ 59.973.073** | **105,49** |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (i) | 198.194.045 | 1.971.634 | 3,47 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (i) | 2.903.000 | 287.243 | 0,50 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$ 2.258.877** | **3,97** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 1,470 % | 28.06.2022 | 05.07.2022 | $ 550.000 | U.S. Treasury Bonds 4,500 % fällig am 15.08.2039 | $ (565.981) | $ 550.000 | $ 550.067 | 0,97 |
| BRC | 1,180 | 01.07.2022 | 15.07.2022 | £ 500.000 | United Kingdom Gilt 0.125% - 1,250 % fällig am 10.08.2031 - 22.03.2034 | (630.976) | 607.225 | 607.451 | 1,07 |
| | 1,450 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 250.000 | Fannie Mae 3,000 % - 3,500 % fällig am 01.02.2050 - 01.04.2052 | (257.145) | 250.000 | 250.010 | 0,44 |
| CEW | 1,180 | 01.07.2022 | 15.07.2022 | £ 100.000 | United Kingdom Gilt 0,625 % fällig am 22.11.2042 | (127.444) | 121.445 | 121.490 | 0,21 |
| FICC | 0,400 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 11.751 | U.S. Treasury Notes 3,000% fällig am 30.06.2024 | (11.986) | 11.751 | 11.751 | 0,02 |
| JPM | 1,400 | 29.06.2022 | 08.07.2022 | CAD 750.000 | Canada Government Bond 1,000 % - 4,000 % fällig am 01.09.2022 - 01.12.2064 | (587.890) | 581.418 | 581.677 | 1,03 |
| | 1,420 | 27.06.2022 | 06.07.2022 | CAD 500.000 | Canada Government Bond 1,500 % fällig am 01.04.2025 | (387.522) | 387.612 | 387.787 | 0,68 |

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MBC | 1,530 % | 29.06.2022 | 06.07.2022 | $ 241.400 | U.S. Treasury Bonds 2,750 % fällig am 15.08.2047 | $ (78.737) | $ 241.400 | $ 241.472 | 0,42 |
| | | | | | U.S. Treasury Notes 0.375% - 2,500 % fällig am 15.05.2024 - 31.01.2028 | (173.651) | | | |
| RYL | 1,070 | 30.06.2022 | 07.07.2022 | £ 500.000 | United Kingdom Gilt 0.125% - 1,500 % fällig am 22.11.2027 - 22.03.2062 | (634.667) | 607.225 | 607.328 | 1,07 |
| SCX | 1,020 | 28.06.2022 | 05.07.2022 | 200.000 | United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2058 | (234.482) | 242.890 | 242.929 | 0,43 |
| | 1,120 | 30.06.2022 | 07.07.2022 | 100.000 | United Kingdom Gilt 0,750 % fällig am 22.03.2034 | (126.873) | 121.445 | 121.466 | 0,21 |
| STR | 1,430 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 53.000 | U.S. Treasury Notes 1,250 % fällig am 31.03.2028 | (54.060) | 53.000 | 53.002 | 0,09 |
| | 1,450 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 2.128.300 | U.S. Treasury Notes 1.000% - 5,250 % fällig am 30.06.2028 - 30.11.2028 | (2.170.866) | 2.128.300 | 2.128.386 | 3,74 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (6.042.280)** | **$ 5.903.711** | **$ 5.904.816** | **10,38** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

### FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 230 | $ (446) | 0,00 |
| Euro-Bobl September Futures | Long | 09.2022 | 3.009 | (160) | 0,00 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Long | 09.2022 | 9.421 | 58.594 | 0,10 |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 3.952 | 1.126 | 0,00 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 2 | 3 | 0,00 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 793 | 1.391 | 0,00 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 3.321 | (1.605) | 0,00 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 15.225 | (2.913) | (0,01) |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Long | 09.2022 | 881 | (2.087) | 0,00 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 6.395 | 12.218 | 0,02 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2022 | 6.106 | 16.975 | 0,03 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09.2022 | 310 | (625) | 0,00 |
| | | | | $ 82.471 | 0,14 |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CME Kaufoptionen mit Ausübungskurs von @ USD 98,000 auf 3-Month SOFR December Futures | $ 98,000 | 15.12.2023 | 1.218 | $ (360) | $ (982) | 0,00 |
| Call - CME Verkaufoptionen mit Ausübungskurs von @ USD 96,500 auf 3-Month SOFR December Futures | 96,500 | 15.12.2023 | 1.218 | (479) | (1.505) | 0,00 |
| | | | | $ (839) | $ (2.487) | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ 79.984** | **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 | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Airbus Group Finance BV | 1,000 % | 20.06.2028 | € 13.400 | $ (628) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.12.2023 | $ 11.100 | (130) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.12.2025 | 9.500 | (132) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.06.2026 | 24.100 | (446) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.12.2026 | 6.600 | (158) | 0,00 |
| Bank of America Corp. | 1,000 | 20.12.2022 | 25.700 | (118) | 0,00 |
| Barclays Bank PLC | 1,000 | 20.12.2022 | € 32.800 | (145) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.12.2022 | $ 21.100 | (12) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.06.2023 | 57.100 | (480) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.12.2023 | 6.700 | (120) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.12.2024 | 5.570 | 5 | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.06.2026 | 3.200 | (130) | 0,00 |

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Boeing Co. | 1,000 % | 20.12.2026 | $ 24.000 | $ (1.247) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.06.2027 | 10.100 | (123) | 0,00 |
| Bombardier, Inc. | 5,000 | 20.06.2024 | 4.600 | (103) | 0,00 |
| Bombardier, Inc. | 5,000 | 20.12.2024 | 4.900 | (87) | 0,00 |
| Bombardier, Inc. | 5,000 | 20.06.2025 | 200 | (1) | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.06.2028 | € 7.200 | (249) | 0,00 |
| Comcast Corp. | 1,000 | 20.12.2026 | $ 2.300 | (40) | 0,00 |
| Devon Energy Corp. | 1,000 | 20.12.2026 | 6.500 | (168) | 0,00 |
| Energy Transfer Operating LP | 1,000 | 20.06.2026 | 2.900 | 53 | 0,00 |
| Expedia Group, Inc. | 1,000 | 20.12.2026 | 3.700 | (188) | 0,00 |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20.12.2022 | 7.600 | (240) | 0,00 |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20.12.2024 | 12.100 | (723) | 0,00 |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20.06.2026 | 3.300 | (254) | 0,00 |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20.12.2026 | 4.400 | (419) | 0,00 |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20.06.2027 | 3.300 | (241) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.12.2022 | 600 | (94) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.06.2023 | 3.400 | (188) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.06.2024 | 3.900 | (134) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.12.2024 | 19.900 | (1.064) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.06.2025 | 18.400 | (953) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.12.2025 | 2.200 | 8 | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.06.2026 | 8.200 | (588) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.12.2026 | 6.600 | (524) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.06.2027 | 11.500 | (895) | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2023 | 109.900 | 6.239 | 0,01 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2024 | 15.800 | 285 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2026 | 73.100 | (1.820) | (0,01) |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2026 | 23.900 | (953) | 0,00 |
| General Motors Co. | 5,000 | 20.12.2026 | 21.700 | (2.167) | (0,01) |
| Hess Corp. | 1,000 | 20.06.2026 | 3.400 | 8 | 0,00 |
| Hess Corp. | 1,000 | 20.12.2026 | 4.700 | (108) | 0,00 |
| Lennar Corp. | 5,000 | 20.12.2026 | 6.400 | (630) | 0,00 |
| Morgan Stanley | 1,000 | 20.12.2022 | 6.100 | (28) | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.12.2025 | € 21.300 | 138 | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.06.2026 | 57.700 | (1.643) | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.12.2026 | 122.800 | (10.031) | (0,02) |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.06.2027 | 31.400 | (2.116) | (0,01) |
| Telefonica Emisiones S.A. | 1,000 | 20.06.2028 | 8.800 | (164) | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 | 20.06.2028 | 17.900 | (683) | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20.06.2026 | $ 6.700 | (176) | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20.12.2026 | 32.300 | (1.011) | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20.06.2027 | 12.900 | (142) | 0,00 |
| | | | | $ (25.958) | (0,04) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[2]

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-35 5-Year Index | (1,000) % | 20.12.2025 | $ 107.200 | $ 1.634 | 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-28 5-Year Index | 1,000 % | 20.12.2022 | $ 219.575 | $ (7.772) | (0,01) |
| CDX.EM-29 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2023 | 121.110 | (7.388) | (0,01) |
| CDX.EM-30 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2023 | 418.300 | (19.144) | (0,03) |
| CDX.EM-31 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 108.852 | (4.996) | (0,01) |
| CDX.EM-32 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2024 | 78.678 | (3.577) | (0,01) |
| CDX.EM-34 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2025 | 237.200 | (19.028) | (0,03) |
| CDX.EM-35 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2026 | 1.500 | (124) | 0,00 |
| CDX.EM-36 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 1.159.800 | (62.347) | (0,11) |
| CDX.HY-34 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2025 | 5.096 | (449) | 0,00 |
| CDX.HY-35 5-Year Index | 5,000 | 20.12.2025 | 8.415 | (762) | 0,00 |
| CDX.HY-36 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2026 | 505.197 | (49.662) | (0,09) |
| CDX.HY-37 5-Year Index | 5,000 | 20.12.2026 | 151.173 | (10.114) | (0,02) |
| CDX.HY-38 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2027 | 6.029.793 | (330.205) | (0,58) |
| CDX.IG-37 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 5.300 | (105) | 0,00 |
| CDX.IG-38 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 129.700 | (1.563) | 0,00 |
| iTraxx Asia Ex-Japan 37 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 163.900 | (2.175) | (0,01) |
| iTraxx Crossover 36 5-Year Index | 5,000 | 20.12.2026 | € 49.500 | (2.382) | (0,01) |
| iTraxx Crossover 37 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2027 | $ 131.300 | (6.147) | (0,01) |
| iTraxx Europe Main 34 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2025 | € 403.400 | (11.338) | (0,02) |
| iTraxx Europe Main 36 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 99.900 | (1.093) | 0,00 |
| iTraxx Europe Main 37 10-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 554.900 | (8.868) | (0,02) |
| | | | | $ (549.239) | (0,97) |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 % | 16.09.2030 | £ 254.700 | $ 35.172 | 0,06 |
| Erhalt | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 | 16.03.2042 | 63.900 | 19.624 | 0,04 |
| Erhalt[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2032 | 1.054.400 | 83.080 | 0,15 |
| Erhalt[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2052 | 788.700 | 298.064 | 0,52 |
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 1,060 | 21.02.2052 | 14.400 | (4.164) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 1,096 | 14.02.2052 | 31.300 | (8.761) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 1,101 | 21.02.2052 | 14.400 | (4.008) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 1,175 | 28.02.2052 | 28.800 | (7.436) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 20.09.2026 | ¥ 48.830.000 | (2.564) | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 15.03.2029 | 344.670.000 | 51.401 | 0,09 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,020 | 20.09.2028 | 395.820.000 | 58.394 | 0,10 |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,176 | 27.04.2027 | 22.270.000 | (267) | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,400 | 15.06.2032 | 52.440.000 | 3.069 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,500 | 15.03.2042 | 27.980.000 | 5.817 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,711 | 27.04.2042 | 5.840.000 | 1.276 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 | 15.06.2027 | $ 386.590 | 19.053 | 0,03 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 | 15.06.2029 | 495.770 | 31.012 | 0,06 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,250 | 15.06.2032 | 635.270 | (31.291) | (0,05) |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,250 | 15.06.2032 | 15.560 | 1.457 | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,573 | 28.02.2027 | 96.300 | (4.571) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,618 | 09.02.2029 | 27.100 | (1.692) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,620 | 18.04.2027 | 153.700 | (7.278) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,650 | 08.02.2032 | 91.900 | (8.003) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,730 | 24.02.2032 | 86.300 | (7.015) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2032 | 281.100 | (11.277) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,765 | 16.03.2032 | 30.400 | (2.395) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,770 | 14.02.2032 | 81.500 | (6.292) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,783 | 22.04.2027 | 114.300 | (4.537) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,788 | 03.05.2027 | 114.800 | (4.614) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,817 | 05.04.2032 | 318.600 | (24.014) | (0,04) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,872 | 06.04.2032 | 160.000 | (11.264) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,928 | 25.03.2027 | 159.500 | (5.171) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,185 | 21.04.2029 | 96.000 | (2.966) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,370 | 21.06.2027 | 159.400 | (2.374) | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,385 | 08.06.2032 | 26.800 | 642 | 0,00 |
| Erhalt[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,430 | 30.09.2027 | 230.020 | 4.176 | 0,01 |
| Erhalt[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,450 | 04.10.2027 | 221.690 | 3.818 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,451 | 08.06.2032 | 90.600 | 1.748 | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,605 | 28.06.2027 | 158.600 | (518) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,830 | 02.01.2023 | BRL 1.005.200 | (3.393) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,836 | 02.01.2023 | 782.600 | (2.601) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,855 | 02.01.2023 | 260.500 | (840) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,140 | 02.01.2025 | 26.500 | (145) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,160 | 02.01.2025 | 17.600 | (95) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,220 | 04.01.2027 | 32.000 | (214) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,245 | 04.01.2027 | 16.100 | (105) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,260 | 04.01.2027 | 16.200 | (105) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,350 | 02.01.2025 | 21.800 | (102) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,700 | 04.01.2027 | 8.300 | (35) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,715 | 04.01.2027 | 35.900 | (147) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,870 | 04.01.2027 | 85.800 | (282) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,000 | 02.01.2025 | 59.500 | (137) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,080 | 02.01.2025 | 98.900 | (199) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,140 | 02.01.2025 | 49.800 | (89) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,145 | 02.01.2025 | 48.800 | (87) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,160 | 02.01.2025 | 99.600 | (171) | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,670 | 02.01.2023 | 80.300 | 58 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,690 | 02.01.2023 | 53.400 | 37 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,740 | 02.01.2023 | 138.300 | 86 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,750 | 02.01.2023 | 66.300 | 41 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,760 | 02.01.2023 | 138.000 | 83 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,900 | 02.01.2023 | 282.400 | 112 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,930 | 02.01.2023 | 35.000 | 13 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,939 | 02.01.2023 | 141.200 | 49 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,946 | 02.01.2023 | 354.500 | 123 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,960 | 02.01.2023 | 282.400 | 91 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,970 | 02.01.2023 | 464.100 | 151 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,000 | 16.06.2047 | CAD 2.600 | 732 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,300 | 16.06.2047 | 2.500 | 670 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 3,400 | 20.06.2029 | 6.300 | (610) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,250 | 30.03.2023 | $ 492.700 | 10.468 | 0,02 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,500 | 16.06.2026 | 1.090.500 | (72.646) | (0,13) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,500 | 16.06.2028 | 2.503.737 | (209.196) | (0,37) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,550 | 15.01.2031 | 4.567.800 | 854.841 | 1,50 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,674 | 05.08.2030 | 62.900 | 11.207 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,678 | 29.07.2030 | 65.200 | 11.545 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,711 | 28.07.2030 | 69.000 | 12.053 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,715 | 27.07.2030 | 200.000 | 34.885 | 0,06 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,750 | 30.03.2031 | 963.600 | 164.585 | 0,29 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,750 | 16.06.2031 | 3.358.883 | (296.113) | (0,52) |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,800 % | 15.01.2051 | $ 1.479.300 | $ 628.657 | 1,11 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,928 | 06.05.2026 | 150.100 | 11.969 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,975 | 17.06.2052 | 52.200 | 15.030 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,990 | 24.06.2052 | 75.000 | 21.302 | 0,04 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,000 | 26.01.2024 | 154.700 | (4.910) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,000 | 16.12.2030 | 120.615 | 18.123 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,035 | 28.06.2052 | 25.900 | 7.108 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,144 | 04.11.2050 | 49.600 | (16.602) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,150 | 30.03.2051 | 191.500 | 22.987 | 0,04 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,215 | 13.10.2050 | 83.500 | (27.626) | (0,05) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,235 | 12.05.2028 | 75.400 | 7.505 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 15.12.2026 | 1.654.500 | (145.054) | (0,25) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 16.06.2051 | 1.456.600 | 210.545 | 0,37 |
| Zahlung[4] | 3-Month USD-LIBOR | 1,270 | 04.11.2023 | 1.668.600 | (7.383) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,280 | 24.03.2028 | 423.400 | (37.640) | (0,07) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,306 | 02.11.2051 | 48.000 | 12.158 | 0,02 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,317 | 16.12.2050 | 33.800 | (10.173) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,350 | 20.01.2027 | 109.100 | 7.506 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,360 | 15.02.2027 | 387.430 | 27.001 | 0,05 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,360 | 20.07.2031 | 91.400 | 12.245 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,370 | 19.07.2031 | 61.300 | 8.159 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,380 | 04.01.2027 | 212.800 | (13.711) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,405 | 07.09.2031 | 154.300 | 20.844 | 0,04 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,418 | 20.01.2027 | 71.900 | (4.603) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,420 | 24.02.2027 | 269.100 | 18.103 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,425 | 18.01.2027 | 146.000 | (9.149) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,443 | 18.01.2027 | 157.300 | (9.702) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,450 | 17.02.2027 | 361.600 | 23.718 | 0,04 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,450 | 16.07.2031 | 137.000 | 17.572 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,485 | 13.01.2051 | 78.100 | (21.633) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 15.12.2028 | 473.684 | (52.540) | (0,09) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 12.01.2029 | 85.443 | 7.469 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 05.10.2031 | 89.100 | (11.012) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,518 | 20.01.2029 | 43.100 | (3.637) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,535 | 15.10.2031 | 88.600 | (10.782) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,535 | 22.10.2031 | 59.100 | (7.183) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,545 | 26.10.2031 | 58.900 | (7.137) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,550 | 20.01.2027 | 485.100 | (27.150) | (0,05) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,570 | 11.01.2027 | 121.400 | (6.792) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,570 | 12.01.2027 | 76.200 | (4.275) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,580 | 16.02.2027 | 150.400 | (8.530) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,595 | 13.01.2051 | 82.600 | (20.972) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,600 | 15.02.2027 | 1.549.700 | (85.256) | (0,15) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,630 | 20.01.2029 | 60.000 | (4.631) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,630 | 26.01.2029 | 72.000 | (5.568) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,650 | 24.02.2027 | 897.000 | (47.459) | (0,08) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,655 | 24.01.2032 | 72.000 | (7.940) | (0,01) |
| Zahlung[4] | 3-Month USD-LIBOR | 1,700 | 06.03.2024 | 344.400 | (5.469) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,700 | 17.02.2027 | 1.446.200 | (72.507) | (0,13) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,700 | 12.01.2029 | 310.700 | (21.987) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,735 | 12.01.2032 | 57.800 | (5.933) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,785 | 12.08.2051 | 76.100 | 18.242 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,815 | 24.01.2052 | 14.400 | (3.046) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,867 | 26.01.2052 | 14.400 | (2.882) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,945 | 23.06.2051 | 127.800 | 26.460 | 0,05 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,988 | 09.02.2032 | 22.000 | 1.718 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 18.02.2032 | 133.700 | (10.348) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 15.12.2051 | 324.000 | 73.862 | 0,13 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,008 | 09.02.2032 | 36.700 | 2.898 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 4,848 | 11.01.2026 | ZAR 942.000 | (4.990) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 4,850 | 07.01.2026 | 310.300 | (1.714) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 4,915 | 01.02.2026 | 1.053.900 | (5.617) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 5,020 | 11.02.2026 | 39.300 | (211) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 5,065 | 09.02.2026 | 1.992.900 | (10.260) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 5,970 | 10.03.2026 | 42.600 | 156 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,750 | 19.09.2028 | 1.510.200 | (3.065) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 8,250 | 15.03.2024 | 10.200 | 21 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 8,300 | 15.03.2027 | 187.600 | (377) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 2,750 | 17.06.2026 | AUD 72.880 | (1.883) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 3,000 | 21.03.2027 | 1.179.040 | (41.712) | (0,07) |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 3,250 | 17.12.2024 | 197.200 | (7.702) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 3,500 | 17.06.2025 | 361.600 | (18.346) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 4,250 | 17.12.2024 | 97.200 | (7.466) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 4,750 | 18.06.2024 | 124.400 | (11.654) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,150 | 18.03.2030 | € 907.700 | 136.530 | 0,24 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,150 | 17.06.2030 | 244.000 | 38.464 | 0,07 |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | 973.700 | 95.351 | 0,17 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,294 | 30.06.2026 | 6.200 | 500 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,329 | 30.12.2025 | 13.200 | 947 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,363 | 30.06.2025 | 20.500 | 1.216 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,395 | 30.12.2024 | 10.800 | 546 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,425 | 28.06.2024 | 24.600 | 915 | 0,00 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,453 % | 29.12.2023 | € 25.200 | $ 699 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 17.06.2050 | 126.900 | 48.006 | 0,08 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 12.04.2027 | 331.900 | (15.268) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,700 | 11.04.2027 | 113.000 | (4.971) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 13.05.2027 | 243.100 | (7.863) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.05.2027 | 116.300 | (3.790) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 2,000 | 17.09.2024 | 149.000 | 13.686 | 0,02 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,165 | 06.09.2032 | MXN 266.600 | (1.549) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,360 | 21.08.2037 | 285.500 | (1.418) | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,380 | 14.08.2037 | 111.200 | 305 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,480 | 18.06.2037 | 337.300 | (2.100) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,495 | 14.01.2032 | 2.373.500 | (10.580) | (0,02) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,498 | 15.01.2032 | 5.192.600 | (23.110) | (0,04) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,498 | 19.06.2037 | 810.000 | (5.011) | (0,01) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,103 | 04.01.2038 | 3.750.800 | 10.681 | 0,02 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,280 | 28.11.2036 | 690.000 | (5.462) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,310 | 28.11.2036 | 1.066.400 | (8.592) | (0,01) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,410 | 31.03.2027 | 1.182.800 | 1.363 | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,660 | 04.04.2024 | 2.723.700 | 1.938 | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,675 | 03.04.2024 | 9.876.200 | 6.895 | 0,01 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,701 | 31.03.2032 | 905.900 | 502 | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,730 | 06.04.2027 | 787.600 | 380 | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,732 | 30.03.2032 | 394.000 | 177 | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,750 | 05.04.2024 | 1.956.500 | 1.136 | 0,00 |
| Zahlung | UKRPI | 4,000 | 15.09.2031 | £ 53.800 | (5.003) | (0,01) |
| Zahlung | UKRPI | 4,020 | 15.10.2031 | 69.900 | (5.965) | (0,01) |
| Zahlung | UKRPI | 4,055 | 15.09.2031 | 49.800 | (4.496) | (0,01) |
| Zahlung | UKRPI | 4,066 | 15.09.2031 | 96.800 | (7.002) | (0,01) |
| Zahlung | UKRPI | 4,140 | 15.10.2031 | 135.400 | (9.368) | (0,02) |
| Zahlung | UKRPI | 4,250 | 15.11.2031 | 135.600 | (5.776) | (0,01) |
| Zahlung | UKRPI | 4,400 | 15.10.2031 | 60.700 | (2.660) | 0,00 |
| | | | | | $ 1.565.241 | 2,75 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 991.678** | **1,74** |

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

(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 Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MSC | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2052 | $ 91,664 | 07.07.2022 | 37.000 | $ 379 | $ 658 | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2052 | 91,703 | 07.07.2022 | 37.000 | 381 | 672 | 0,00 |
| | | | | | $ 760 | $ 1.330 | 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-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 % | 20.07.2022 | 97.000 | $ (147) | $ (73) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Crossover 36 5-Year Index | Verkauf | 5,250 | 20.07.2022 | 42.700 | (444) | (848) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 99.600 | (460) | (216) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 189.100 | (537) | (618) | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 113.200 | (205) | (46) | 0,00 |
| BRC | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 31.300 | (286) | (350) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 46.000 | (69) | (35) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 89.900 | (172) | (102) | 0,00 |
| GST | Call - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Kauf | 0,700 | 17.08.2022 | 53.100 | (58) | (6) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,300 | 17.08.2022 | 154.000 | (347) | (246) | 0,00 |

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/-verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPM | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 95,000 % | 17.08.2022 | 22.300 | $ (270) | $ (340) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 71.900 | (638) | (804) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,100 | 20.07.2022 | 338.700 | (1.285) | (1.291) | (0,01) |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 55.700 | (170) | (207) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,250 | 20.07.2022 | 50.600 | (82) | (27) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,350 | 17.08.2022 | 97.400 | (222) | (131) | 0,00 |
| | | | | | | $ (5.392) | $ (5.340) | (0,01) |

## ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,150 % | 01.12.2023 | 158.300 | $ (491) | $ (623) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,650 | 01.12.2023 | 158.300 | (491) | (525) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,680 | 07.07.2022 | 27.300 | (377) | (331) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,690 | 07.07.2022 | 27.300 | (382) | (312) | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,350 | 16.08.2022 | 80.200 | (678) | (217) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 16.08.2022 | 80.200 | (678) | (623) | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,310 | 19.08.2022 | 80.300 | (688) | (206) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,010 | 19.08.2022 | 80.300 | (688) | (754) | 0,00 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 26.08.2022 | 137.400 | (687) | (281) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,850 | 26.08.2022 | 137.400 | (687) | (1.343) | (0,01) |
| BPS | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 11.04.2023 | 72.300 | (73) | (41) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 11.04.2023 | 72.300 | (221) | (270) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 28.04.2023 | 184.500 | (320) | (142) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 28.04.2023 | 184.500 | (320) | (631) | 0,00 |
| CBK | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,690 | 02.04.2024 | 41.500 | (326) | (298) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,690 | 02.04.2024 | 41.500 | (326) | (272) | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 01.09.2022 | 104.600 | (873) | (612) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 01.09.2022 | 104.600 | (873) | (1.046) | (0,01) |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,755 | 30.09.2022 | 141.800 | (893) | (126) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,955 | 30.09.2022 | 141.800 | (993) | (1.436) | (0,01) |
| DUB | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 02.09.2022 | 69.900 | (359) | (310) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 02.09.2022 | 69.900 | (359) | (489) | 0,00 |
| GLM | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,870 | 02.11.2022 | 6.288.900 | (12.519) | (65) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,270 | 02.11.2022 | 6.288.900 | (12.519) | (144.145) | (0,26) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,920 | 13.10.2023 | 96.700 | (595) | (666) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,920 | 13.10.2023 | 96.700 | (595) | (544) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,018 | 20.10.2023 | 77.900 | (504) | (586) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,018 | 20.10.2023 | 77.900 | (504) | (408) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,140 | 23.10.2023 | 77.500 | (544) | (639) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,140 | 23.10.2023 | 77.500 | (544) | (371) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,190 | 23.10.2023 | 77.500 | (539) | (662) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,190 | 23.10.2023 | 77.500 | (539) | (357) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,225 | 23.10.2023 | 77.500 | (538) | (679) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,225 | 23.10.2023 | 77.500 | (538) | (348) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,973 | 25.10.2023 | 77.700 | (534) | (570) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,973 | 25.10.2023 | 77.700 | (534) | (422) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,841 | 27.10.2023 | 77.400 | (530) | (514) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,841 | 27.10.2023 | 77.400 | (530) | (460) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,088 | 03.11.2023 | 77.800 | (564) | (630) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,088 | 03.11.2023 | 77.800 | (564) | (387) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,910 | 10.11.2023 | 78.600 | (522) | (564) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,910 | 10.11.2023 | 78.600 | (522) | (445) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 17.11.2023 | 155.600 | (564) | (652) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 17.11.2023 | 155.600 | (564) | (476) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,150 | 20.11.2023 | 155.600 | (543) | (596) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,650 | 20.11.2023 | 155.600 | (543) | (514) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 07.12.2023 | 159.200 | (497) | (695) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 07.12.2023 | 159.200 | (497) | (492) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,697 | 02.04.2024 | 249.100 | (1.954) | (1.796) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,697 | 02.04.2024 | 249.100 | (1.954) | (1.624) | (0,01) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,721 | 08.04.2024 | 80.600 | (608) | (594) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,721 | 08.04.2024 | 80.600 | (608) | (518) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 05.04.2023 | 197.900 | (368) | (112) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 05.04.2023 | 197.900 | (368) | (731) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 11.04.2023 | 335.500 | (646) | (192) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 11.04.2023 | 335.500 | (646) | (1.254) | (0,01) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 24.04.2023 | 200.100 | (216) | (154) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 24.04.2023 | 200.100 | (565) | (674) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 26.04.2023 | 184.600 | (325) | (143) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 26.04.2023 | 184.600 | (325) | (627) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 15.05.2023 | 183.200 | (322) | (106) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 15.05.2023 | 183.200 | (322) | (733) | 0,00 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,400 | 17.08.2022 | 160.700 | (828) | (435) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,100 | 17.08.2022 | 160.700 | (828) | (803) | 0,00 |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,370 | 18.08.2022 | 80.300 | (546) | (259) | 0,00 |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,070 | 18.08.2022 | 80.300 | (546) | (508) | 0,00 |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 06.09.2022 | 69.900 | (440) | (402) | 0,00 |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 06.09.2022 | 69.900 | (440) | (578) | 0,00 |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 | 07.09.2022 | 70.000 | (439) | (475) | 0,00 |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,100 | 07.09.2022 | 70.000 | (439) | (524) | 0,00 |
| MYC | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,993 | 11.10.2023 | 82.900 | (560) | (604) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,993 | 11.10.2023 | 82.900 | (560) | (445) | 0,00 |
| | | | | | | | $ (64.622) | $ (182.066) | (0,32) |

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | $ 93,563 | 07.09.2022 | 57.500 | $ (431) | $ (540) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | 94,438 | 07.09.2022 | 58.000 | (335) | (345) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | 94,703 | 07.09.2022 | 49.100 | (320) | (251) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 98,297 | 07.07.2022 | 25.500 | (159) | (40) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 99,141 | 07.07.2022 | 51.600 | (355) | (321) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2052 | 96,906 | 04.08.2022 | 17.000 | (85) | (215) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,141 | 07.09.2022 | 25.000 | (94) | (165) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,156 | 07.09.2022 | 45.000 | (158) | (299) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,656 | 07.09.2022 | 88.000 | (330) | (734) | (0,01) |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 101,141 | 07.09.2022 | 25.000 | (63) | (104) | 0,00 |
| MSC | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.09.2052 | 91,359 | 07.09.2022 | 19.000 | (128) | (94) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 99,156 | 07.07.2022 | 41.900 | (288) | (266) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 100,344 | 07.07.2022 | 39.500 | (188) | (96) | 0,00 |
| SAL | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | 94,688 | 07.09.2022 | 35.300 | (210) | (182) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 99,563 | 07.07.2022 | 23.000 | (119) | (11) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 98,234 | 07.09.2022 | 58.000 | (326) | (252) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,406 | 07.09.2022 | 23.000 | (81) | (171) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,656 | 07.09.2022 | 27.000 | (103) | (225) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 100,234 | 07.09.2022 | 58.000 | (263) | (466) | 0,00 |
| | | | | | $ (4.036) | $ (4.777) | (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 | HSBC Holdings PLC | (1,000) % | 20.06.2024 | € 1.300 | $ 22 | $ (21) | $ 1 | 0,00 |
| | UBS AG | (1,000) | 20.06.2024 | $ 19.300 | 1.254 | (1.275) | (21) | 0,00 |
| BPS | UBS AG | (1,000) | 20.06.2024 | 7.000 | 458 | (466) | (8) | 0,00 |
| | | | | | $ 1.734 | $ (1.762) | $ (28) | 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) | $ 808 | $ 76 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.09.2024 | 2.700 | (274) | (1.741) | (2.015) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 5.500 | (241) | (194) | (435) | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 60.500 | (4.393) | (2.188) | (6.581) | (0,01) |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 10.800 | (998) | (532) | (1.530) | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 21.000 | (2.360) | (1.157) | (3.517) | (0,01) |
| BPS | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 17.800 | (853) | (624) | (1.477) | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 17.900 | (1.564) | (383) | (1.947) | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2025 | 1.300 | (223) | (26) | (249) | 0,00 |
| BRC | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 57.900 | (2.291) | 2.489 | 198 | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 8.750 | (538) | 551 | 13 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 675 | 2 | 1 | 3 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.09.2024 | 4.100 | (414) | (2.645) | (3.059) | (0,01) |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 60.000 | (8.695) | (1.353) | (10.048) | (0,02) |
| BYL | Banca Monte dei Paschi di Siena SpA | 5,000 | 20.12.2022 | € 2.200 | (70) | 35 | (35) | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | $ 22.450 | (1.502) | (940) | (2.442) | (0,01) |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 15.260 | (1.322) | (1.234) | (2.556) | (0,01) |
| CBK | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 50.505 | (1.969) | 2.142 | 173 | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 168.400 | (2.908) | (65) | (2.973) | (0,01) |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 10.000 | (102) | (1) | (103) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 29.600 | 116 | (695) | (579) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 42.900 | (1.989) | (953) | (2.942) | (0,01) |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 10.600 | (381) | (499) | (880) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 52.400 | (847) | 950 | 103 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2026 | 31.000 | (203) | (283) | (486) | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.09.2024 | 6.400 | (555) | (4.220) | (4.775) | (0,01) |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 12.600 | (1.154) | (631) | (1.785) | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 4.700 | (490) | (297) | (787) | 0,00 |
| FBF | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 7.000 | (270) | 294 | 24 | 0,00 |
| GST | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 86.300 | (1.084) | 1.379 | 295 | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 13.700 | (441) | 321 | (120) | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 176.800 | (2.751) | (370) | (3.121) | (0,01) |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 600 | 6 | (4) | 2 | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 32.600 | (488) | 325 | (163) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 26.300 | (1.162) | (1.021) | (2.183) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 17.650 | (156) | 240 | 84 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 60.300 | (502) | 411 | (91) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 11.800 | (50) | (344) | (394) | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.12.2022 | 7.800 | (443) | 455 | 12 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 229.960 | (5.030) | (166.543) | (171.573) | (0,30) |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 8.700 | (449) | 340 | (109) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2025 | 10.200 | (565) | 41 | (524) | 0,00 |

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2026 | $ 4.800 | $ (216) | $ (164) | $ (380) | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 37.500 | (3.786) | (1.528) | (5.314) | (0,01) |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 58.600 | (6.583) | (3.230) | (9.813) | (0,02) |
| HUS | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 30.100 | (953) | 841 | (112) | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 255.100 | (7.463) | 5.230 | (2.233) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 32.400 | (94) | (241) | (335) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 261.150 | (4.180) | 5.052 | 872 | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.12.2022 | 10.000 | (568) | 583 | 15 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.09.2024 | 2.459 | (336) | (1.499) | (1.835) | 0,00 |
| JPM | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 2.200 | (101) | (50) | (151) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 3.500 | (135) | (156) | (291) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2026 | 33.200 | (259) | (261) | (520) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 37.600 | (2.111) | 1.639 | (472) | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 2.200 | (152) | (87) | (239) | 0,00 |
| MBC | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 6.200 | (676) | (362) | (1.038) | 0,00 |
| MYC | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 19.000 | (704) | 769 | 65 | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 47.900 | (2.208) | (1.767) | (3.975) | (0,01) |
| | Indonesia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 27.200 | 65 | (582) | (517) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 47.400 | (418) | 346 | (72) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2025 | 5.300 | (73) | 18 | (55) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2026 | 56.100 | (326) | (553) | (879) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 44.400 | 68 | (1.220) | (1.152) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 159.400 | (753) | (4.568) | (5.321) | (0,01) |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 124.200 | (5.441) | (4.377) | (9.818) | (0,02) |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 12.500 | (1.123) | (237) | (1.360) | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 17.500 | (1.945) | (535) | (2.480) | (0,01) |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 4.600 | (518) | (252) | (770) | 0,00 |
| | | | | | $ (91.324 ) | $ (185.352) | $ (276.676) | (0,49) |

## 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 Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | ABX.HE.AA.6-1 Index | 0,320 % | 25.07.2045 | $ 842 | $ (290) | $ 233 | $ (57) | 0,00 |
| | ABX.HE.AAA.6-2 Index | 0,110 | 25.05.2046 | 35.965 | (8.940) | 9.064 | 124 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AS.6 Index | 1,000 | 11.05.2063 | 1.147 | (3) | 2 | (1) | 0,00 |
| BRC | ABX.HE.AAA.6-2 Index | 0,110 | 25.05.2046 | 2.829 | (701) | 711 | 10 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.13 Index | 0,500 | 16.12.2072 | 100.000 | (1.840) | 62 | (1.778) | 0,00 |
| | CMBX.NA.AS.6 Index | 1,000 | 11.05.2063 | 7.914 | (269) | 262 | (7) | 0,00 |
| | PRIMEX.ARM.2-AAA Index | 4,580 | 25.12.2037 | 228 | 10 | (7) | 3 | 0,00 |
| CBK | CDX.HY-33 5-Year Index 35-100% | 5,000 | 20.12.2024 | 57.942 | 9.647 | (3.753) | 5.894 | 0,01 |
| DUB | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 233.645 | (4.705) | 3.865 | (840) | 0,00 |
| FBF | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18.11.2054 | 688.600 | (4.427) | (152) | (4.579) | (0,01) |
| | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 162.200 | (1.133) | (633) | (1.766) | 0,00 |
| GST | ABX.HE.AAA.6-2 Index | 0,110 | 25.05.2046 | 928 | (217) | 220 | 3 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 1.176.350 | (15.149) | 10.917 | (4.232) | (0,01) |
| | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18.11.2054 | 735.600 | 4.507 | (9.398) | (4.891) | (0,01) |
| | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 436.500 | (12.201) | 7.448 | (4.753) | (0,01) |
| | CMBX.NA.AAA.13 Index | 0,500 | 16.12.2072 | 86.300 | (1.494) | (41) | (1.535) | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.15 Index | 0,500 | 18.11.2064 | 37.200 | (316) | (864) | (1.180) | 0,00 |
| JPS | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 171.400 | (2.957) | 2.340 | (617) | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18.11.2054 | 171.700 | (1.351) | 209 | (1.142) | 0,00 |
| MEI | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 45.500 | (336) | (159) | (495) | 0,00 |
| MYC | CDX.HY-33 5-Year Index 35-100% | 5,000 | 20.12.2024 | 117.250 | 19.537 | (7.611) | 11.926 | 0,02 |
| | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 66.700 | (1.419) | 1.179 | (240) | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18.11.2054 | 364.800 | (3.092) | 666 | (2.426) | (0,01) |
| | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 923.900 | (14.119) | 4.059 | (10.060) | (0,02) |
| | CMBX.NA.AAA.13 Index | 0,500 | 16.12.2072 | 379.100 | 507 | (7.249) | (6.742) | (0,01) |
| | CMBX.NA.AAA.15 Index | 0,500 | 18.11.2064 | 74.400 | (631) | (1.728) | (2.359) | 0,00 |
| | CMBX.NA.AS.6 Index | 1,000 | 11.05.2063 | 688 | (21) | 20 | (1) | 0,00 |
| SAL | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 810.495 | (7.907) | 4.991 | (2.916) | (0,01) |
| | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18.11.2054 | 152.400 | (785) | (228) | (1.013) | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 1.386.500 | (13.793) | (1.303) | (15.096) | (0,03) |
| | CMBX.NA.AAA.13 Index | 0,500 | 16.12.2072 | 88.800 | 0 | (1.579) | (1.579) | 0,00 |
| UAG | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 15.500 | (445) | 389 | (56) | 0,00 |
| | | | | | $ (64.333) | $ 11.932 | $ (52.401) | (0,09) |

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

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

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

# Aufstellung der Finanzanlagen des Income Fund (Forts.)

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYC | Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,880 % | 30.09.2027 | $ 657.200 | $ (164) | $ (5.851) | $ (6.015) | (0,01) |
| | Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,900 | 04.10.2027 | 633.400 | 47 | (5.698) | (5.651) | (0,01) |
| | | | | | | $ (117) | $ (11.549) | $ (11.666) | (0,02) |

## 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 1,044 % | $ 2.100 | 20.03.2023 | $ (3) | $ (12) | $ (15) | 0,00 |
| BPS | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 1,044 | 28.100 | 20.09.2022 | (31) | (1.166) | (1.197) | 0,00 |
| JPM | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 1,044 | 500 | 20.09.2022 | (1) | (3) | (4) | 0,00 |
| MYC | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 1,044 | 24.500 | 20.09.2022 | (26) | (1.106) | (1.132) | 0,00 |
| | | | | | | | $ (61) | $ (2.287) | $ (2.348) | 0,00 |

## TOTAL RETURN SWAPS AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nennbetrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlusspräm ien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYC | Erhalt | United States Treasury Inflation Indexed Bonds | k. A. | 1,500 % | $ 1.590.620 | 13.07.2022 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | AUD | 5.776 | $ | 4.015 | $ 44 | $ 0 | $ 44 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 4.016 | AUD | 5.776 | 0 | (44) | (44) | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | AUD | 29.784 | $ | 21.212 | 731 | 0 | 731 | 0,00 |
| | 07.2022 | CHF | 25.275 | | 26.449 | 49 | 0 | 49 | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK | 92.517 | | 13.159 | 153 | 0 | 153 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 1.326.754 | | 1.677.403 | 66.126 | 0 | 66.126 | 0,12 |
| | 07.2022 | PEN | 115.168 | | 28.496 | 0 | (1.735) | (1.735) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2.392 | AUD | 3.328 | 0 | (104) | (104) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.168 | DKK | 14.480 | 0 | (133) | (133) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 20.349 | € | 19.265 | 0 | (209) | (209) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 62.401 | £ | 49.958 | 0 | (1.729) | (1.729) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 191.332 | MXN | 4.081.069 | 10.592 | 0 | 10.592 | 0,02 |
| | 07.2022 | | 29.651 | PEN | 112.931 | 194 | (166) | 28 | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 195.580 | $ | 12.747 | 818 | 0 | 818 | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 12.395.099 | | 843 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 08.2022 | MXN | 285.532 | | 14.066 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN | 6.327 | | 1.606 | 0 | (53) | (53) | 0,00 |
| | 08.2022 | SEK | 15.910 | | 1.608 | 53 | 0 | 53 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 5.689 | AUD | 8.194 | 0 | (53) | (53) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 13.159 | DKK | 92.330 | 0 | (156) | (156) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 112.901 | NOK | 1.074.970 | 0 | (4.003) | (4.003) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 8.705 | RUB | 1.360.598 | 15.232 | 0 | 15.232 | 0,03 |
| | 10.2022 | PEN | 100.000 | $ | 23.482 | 0 | (2.589) | (2.589) | (0,01) |
| | 10.2022 | ZAR | 200.000 | | 12.851 | 767 | 0 | 767 | 0,00 |
| | 11.2022 | PEN | 73.354 | | 17.805 | 0 | (1.244) | (1.244) | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 143.210 | | 9.019 | 388 | 0 | 388 | 0,00 |
| | 12.2022 | $ | 14.305 | ILS | 45.330 | 0 | (1.216) | (1.216) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | AUD | 27.045 | $ | 18.778 | 181 | 0 | 181 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 72.755 | | 76.873 | 811 | 0 | 811 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 653.890 | | 820.492 | 26.678 | (303) | 26.375 | 0,05 |
| | 07.2022 | MXN | 1.390.824 | | 66.491 | 0 | (2.444) | (2.444) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 3.655 | AUD | 5.229 | 0 | (59) | (59) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 6.725 | CAD | 8.697 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 13.611 | CLP | 11.985.616 | 0 | (844) | (844) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 170.517 | € | 160.843 | 0 | (2.364) | (2.364) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 157.593 | £ | 127.634 | 0 | (2.588) | (2.588) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 156.172 | ¥ | 21.040.800 | 0 | (1.295) | (1.295) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 210.138 | MXN | 4.223.150 | 0 | (819) | (819) | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 12.140 | $ | 776 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| | 08.2022 | IDR | 2.384.851 | | 162 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | INR | 32.343 | | 415 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 115.851 | IDR | 1.708.224.912 | 0 | (1.788) | (1.788) | 0,00 |
| | 08.2022 | ZAR | 623.416 | $ | 39.044 | 1.155 | 0 | 1.155 | 0,00 |
| | 09.2022 | MXN | 4.223.150 | | 207.043 | 475 | 0 | 475 | 0,00 |
| | 10.2022 | ZAR | 575.381 | | 37.414 | 2.650 | 0 | 2.650 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 11.2022 | ZAR | 287.576 | $ | 17.950 | $ 618 | $ 0 | $ 618 | 0,00 |
| | 12.2022 | $ | 14.029 | ILS | 44.421 | 0 | (1.202) | (1.202) | 0,00 |
| | 01.2023 | | 17.796 | | 57.408 | 0 | (1.183) | (1.183) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | £ | 3.178.967 | $ | 3.979.348 | 120.755 | (2.201) | 118.554 | 0,21 |
| | 07.2022 | ¥ | 75.861.034 | | 559.241 | 844 | 0 | 844 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 84.647 | £ | 69.224 | 82 | (659) | (577) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 126.973 | IDR | 1.879.432.899 | 0 | (1.479) | (1.479) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 559.241 | ¥ | 75.737.833 | 0 | (822) | (822) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 77.855 | NOK | 761.843 | 0 | (677) | (677) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 516 | SGD | 713 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 91.100 | $ | 5.676 | 186 | 0 | 186 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | BRL | 3.349.249 | | 644.429 | 4.472 | (502) | 3.970 | 0,01 |
| | 07.2022 | € | 82.692 | | 88.294 | 1.843 | 0 | 1.843 | 0,00 |
| | 07.2022 | ILS | 20 | | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 531.136 | | 25.687 | 0 | (639) | (639) | 0,00 |
| | 07.2022 | PEN | 16.634 | | 4.327 | 1 | (44) | (43) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 5.752 | AUD | 8.350 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 475.186 | BRL | 2.341.056 | 0 | (27.517) | (27.517) | (0,05) |
| | 07.2022 | | 26.358 | CLP | 21.338.000 | 0 | (3.591) | (3.591) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 27.333 | € | 25.457 | 0 | (719) | (719) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 3.199 | £ | 2.601 | 0 | (40) | (40) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 187.097 | MXN | 4.021.073 | 11.852 | 0 | 11.852 | 0,02 |
| | 07.2022 | | 41.207 | PEN | 159.821 | 1.057 | (272) | 785 | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN | 333.597 | $ | 84.141 | 0 | (3.359) | (3.359) | (0,01) |
| | 08.2022 | $ | 639.353 | BRL | 3.349.249 | 375 | (4.792) | (4.417) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 7.246 | PEN | 27.248 | 0 | (101) | (101) | 0,00 |
| | 10.2022 | | 5.570 | | 22.017 | 162 | 0 | 162 | 0,00 |
| | 11.2022 | PEN | 211.274 | $ | 53.220 | 0 | (1.704) | (1.704) | 0,00 |
| | 12.2022 | ILS | 342.050 | | 109.854 | 11.082 | 0 | 11.082 | 0,02 |
| | 12.2022 | PEN | 88.069 | | 22.700 | 0 | (103) | (103) | 0,00 |
| | 12.2022 | $ | 341 | ILS | 1.098 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| | 12.2022 | | 32.841 | PEN | 137.737 | 2.883 | 0 | 2.883 | 0,01 |
| | 01.2023 | ILS | 87.391 | $ | 27.696 | 2.407 | 0 | 2.407 | 0,00 |
| | 02.2023 | PEN | 4.743 | | 1.193 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| | 04.2023 | $ | 3.578 | PEN | 14.129 | 46 | 0 | 46 | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | | 26.449 | CHF | 25.123 | 0 | (207) | (207) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.030 | MXN | 20.951 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.005 | PEN | 3.686 | 0 | (37) | (37) | 0,00 |
| | 08.2022 | CHF | 25.081 | $ | 26.449 | 205 | 0 | 205 | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 287.416 | | 9.677 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 12.2022 | ZAR | 270.049 | | 17.188 | 967 | 0 | 967 | 0,00 |
| | 02.2023 | | 64.861 | | 3.884 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | CAD | 250.000 | | 193.469 | 0 | (338) | (338) | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 2.496.296 | | 120.876 | 42 | (2.884) | (2.842) | (0,01) |
| | 07.2022 | $ | 79.040 | BRL | 384.456 | 0 | (5.523) | (5.523) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 1.297 | MXN | 26.452 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 4.852 | PEN | 18.208 | 5 | (72) | (67) | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 90.387 | $ | 5.612 | 100 | 0 | 100 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 2.312 | CLP | 2.000.000 | 0 | (197) | (197) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 248.397 | MXN | 5.000.000 | 0 | (2.142) | (2.142) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 27.482 | PEN | 103.304 | 0 | (402) | (402) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 13.278 | HKD | 103.981 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 10.2022 | | 42.676 | MXN | 874.345 | 0 | (91) | (91) | 0,00 |
| | 10.2022 | | 64.825 | RUB | 6.192.434 | 34.305 | 0 | 34.305 | 0,06 |
| | 11.2022 | ZAR | 155.782 | $ | 9.705 | 316 | 0 | 316 | 0,00 |
| | 01.2023 | $ | 9.241 | ILS | 29.712 | 0 | (643) | (643) | 0,00 |
| | 05.2023 | ZAR | 113.996 | $ | 6.821 | 79 | 0 | 79 | 0,00 |
| IND | 07.2022 | CLP | 8.379.041 | | 10.041 | 1.101 | 0 | 1.101 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 9.975 | CLP | 8.379.041 | 0 | (1.100) | (1.100) | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | CAD | 1.000.259 | $ | 776.492 | 1.450 | (393) | 1.057 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 100.000 | | 122.119 | 671 | 0 | 671 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 30.145 | £ | 23.930 | 0 | (1.084) | (1.084) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 3.383 | MXN | 68.795 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 773 | ZAR | 12.393 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 2.566 | $ | 382 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 3.349.297 | | 113.674 | 827 | 0 | 827 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 169.350 | IDR | 2.491.105.135 | 0 | (2.975) | (2.975) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 4.250 | SGD | 5.842 | 0 | (52) | (52) | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 112.190 | MXN | 2.279.089 | $ 0 | $ (561) | $ (561) | 0,00 |
| | 12.2022 | ILS | 49.510 | $ | 16.054 | 1.757 | 0 | 1.757 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | AUD | 251.130 | | 172.953 | 264 | 0 | 264 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 19.903 | | 20.992 | 184 | 0 | 184 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 243.930 | | 299.624 | 3.383 | 0 | 3.383 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 5.841 | AUD | 8.436 | 0 | (40) | (40) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 27.063 | € | 25.831 | 77 | (135) | (58) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 12.761 | £ | 10.128 | 0 | (462) | (462) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.192 | MXN | 24.274 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.205 | NZD | 1.847 | 0 | (57) | (57) | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 5.899 | $ | 878 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | MXN | 3.148.095 | | 153.477 | 0 | (1.398) | (1.398) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 172.976 | AUD | 251.130 | 0 | (250) | (250) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 67.109 | CLP | 56.233.624 | 0 | (7.504) | (7.504) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 74.742 | IDR | 1.095.868.494 | 0 | (1.552) | (1.552) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 51.544 | MXN | 1.109.815 | 3.115 | 0 | 3.115 | 0,01 |
| | 05.2023 | CNH | 5.907 | $ | 880 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYI | 07.2022 | AUD | 243 | | 169 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | BRL | 715.456 | | 137.906 | 1.093 | 0 | 1.093 | 0,00 |
| | 07.2022 | DKK | 19.417 | | 2.760 | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 454 | | 477 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 321 | | 391 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 15.236.022 | | 111.906 | 0 | (243) | (243) | 0,00 |
| | 07.2022 | SGD | 1.013 | | 731 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 581.983 | BRL | 2.839.193 | 0 | (39.058) | (39.058) | (0,07) |
| | 07.2022 | | 42 | CHF | 40 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 14.454 | DKK | 97.466 | 0 | (752) | (752) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 230 | € | 219 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 33.122 | £ | 27.411 | 168 | 0 | 168 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 142 | HKD | 1.113 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 3 | NOK | 32 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 84 | SGD | 117 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.331 | ZAR | 21.369 | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 62.262 | $ | 4.097 | 303 | 0 | 303 | 0,00 |
| | 08.2022 | INR | 54.322 | | 695 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 996.032 | | 33.812 | 253 | 0 | 253 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 136.819 | BRL | 715.456 | 0 | (1.186) | (1.186) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 2.760 | DKK | 19.378 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 143.458 | IDR | 2.116.354.829 | 0 | (2.181) | (2.181) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 111.906 | ¥ | 15.211.346 | 248 | 0 | 248 | 0,00 |
| RBC | 07.2022 | CAD | 5.356 | $ | 4.166 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 3.049 | | 3.745 | 42 | 0 | 42 | 0,00 |
| | 08.2022 | MXN | 1.265.632 | | 61.506 | 0 | (576) | (576) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 4.166 | CAD | 5.356 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 411 | MXN | 8.484 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | | 8.657 | £ | 7.117 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | AUD | 16.519 | $ | 11.883 | 523 | 0 | 523 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 48.741 | CAD | 61.660 | 0 | (941) | (941) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.500 | € | 2.398 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.902 | PEN | 7.162 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 10.353 | $ | 1.546 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 13 | TWD | 394 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | ZAR | 246.260 | $ | 15.929 | 1.003 | 0 | 1.003 | 0,00 |
| | 10.2022 | | 3.662.192 | | 237.645 | 16.413 | 0 | 16.413 | 0,03 |
| | 11.2022 | COP | 20.255.902 | | 4.766 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | $ | 1.426.147 | £ | 1.140.753 | 0 | (40.759) | (40.759) | (0,07) |
| | 08.2022 | | 119.577 | NOK | 1.172.708 | 0 | (778) | (778) | 0,00 |
| SSB | 07.2022 | | 204 | HKD | 1.602 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | BRL | 1.500.000 | $ | 289.110 | 2.273 | 0 | 2.273 | 0,00 |
| | 07.2022 | CAD | 279.714 | | 217.543 | 735 | (33) | 702 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 4.599.127 | | 36.234 | 2.381 | 0 | 2.381 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 10.000 | AUD | 14.411 | 0 | (91) | (91) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 527.708 | CAD | 674.018 | 0 | (5.193) | (5.193) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 964.192 | ¥ | 128.248.800 | 0 | (20.180) | (20.180) | (0,04) |
| | 08.2022 | | 286.834 | BRL | 1.500.000 | 0 | (2.471) | (2.471) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 217.543 | CAD | 279.732 | 35 | (731) | (696) | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 50.979 | $ | 3.256 | 184 | 0 | 184 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | AUD | 174.430 | | 124.593 | 4.646 | 0 | 4.646 | 0,01 |
| | 07.2022 | CLP | 31.575.181 | | 34.414 | 725 | 0 | 725 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 2.932.614 | | 3.151.390 | 85.488 | 0 | 85.488 | 0,15 |
| | 07.2022 | £ | 500.000 | | 610.180 | 2.942 | 0 | 2.942 | 0,01 |
| | 07.2022 | MXN | 2.839.764 | | 136.771 | 46 | (3.777) | (3.731) | (0,01) |
| | 07.2022 | $ | 325.762 | AUD | 467.907 | 0 | (4.006) | (4.006) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 23.358 | CLP | 18.616.222 | 0 | (3.495) | (3.495) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 3.789 | £ | 3.089 | 0 | (38) | (38) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 324 | MXN | 6.568 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 40.119 | ZAR | 645.521 | 0 | (784) | (784) | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 56.438 | $ | 3.513 | 74 | 0 | 74 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 30.932 | CLP | 27.041.933 | 0 | (2.336) | (2.336) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 666 | MXN | 13.807 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 34.001 | CLP | 31.575.181 | 0 | (746) | (746) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 4.816 | HKD | 37.712 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 632.787 | MXN | 12.609.972 | 15 | (15.172) | (15.157) | (0,03) |
| | 11.2022 | ZAR | 760.886 | $ | 48.282 | 2.428 | 0 | 2.428 | 0,00 |
| | | | | | | $ 456.873 | $ (253.377) | $ 203.496 | 0,36 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) thesaurierend, Institutional AUD (Hedged) ausschüttend, Investor AUD (Hedged) ausschüttend, Administrative AUD (Hedged) ausschüttend, Class E AUD (Hedged) ausschüttend und Class Z AUD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | AUD | 499.794 | $ | 347.458 | $ 3.774 | $ 0 | $ 3.774 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 347.522 | AUD | 499.762 | 0 | (3.789) | (3.789) | (0,01) |
| BOA | 07.2022 | AUD | 589.574 | $ | 409.349 | 3.928 | 0 | 3.928 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 539.783 | AUD | 749.732 | 0 | (24.229) | (24.229) | (0,04) |
| | 08.2022 | AUD | 1.539 | $ | 1.061 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 407.874 | AUD | 587.302 | 0 | (3.932) | (3.932) | (0,01) |
| BPS | 07.2022 | AUD | 9.711 | $ | 6.739 | 61 | 0 | 61 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 4.003 | AUD | 5.806 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | AUD | 68 | $ | 47 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2.200 | AUD | 3.058 | 0 | (98) | (98) | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | AUD | 203.431 | $ | 139.960 | 71 | 0 | 71 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 139.995 | AUD | 203.431 | 0 | (77) | (77) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | AUD | 1.974 | $ | 1.369 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 600.909 | AUD | 836.212 | 0 | (25.887) | (25.887) | (0,04) |
| SCX | 07.2022 | AUD | 509.967 | $ | 350.694 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 350.783 | AUD | 509.967 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | AUD | 398.692 | $ | 274.421 | 260 | 0 | 260 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 672 | AUD | 927 | 0 | (35) | (35) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 271.280 | | 394.091 | 0 | (228) | (228) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | AUD | 1.626 | $ | 1.175 | 57 | 0 | 57 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 555.899 | AUD | 778.256 | 0 | (20.731) | (20.731) | (0,04) |
| | | | | | | $ 8.181 | $ (79.048) | $ (70.867) | (0,12) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | BRL | 632.865 | $ | 122.807 | $ 1.788 | $ 0 | $ 1.788 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 139.924 | BRL | 680.628 | 0 | (9.771) | (9.771) | (0,02) |
| | 08.2022 | BRL | 10.415 | $ | 1.975 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 121.831 | BRL | 632.865 | 0 | (1.855) | (1.855) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | BRL | 632.865 | $ | 122.482 | 1.463 | 0 | 1.463 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 138.753 | BRL | 690.990 | 7 | (6.625) | (6.618) | (0,01) |
| | 08.2022 | BRL | 12.298 | $ | 2.326 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 121.506 | BRL | 632.865 | 0 | (1.530) | (1.530) | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | BRL | 125.687 | $ | 24.906 | 877 | (5) | 872 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 139.725 | BRL | 703.271 | 0 | (5.242) | (5.242) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 8.695 | | 45.426 | 0 | (83) | (83) | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | BRL | 89.240 | $ | 17.624 | 560 | (1) | 559 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 3.086 | BRL | 14.918 | 0 | (233) | (233) | 0,00 |
| | 08.2022 | BRL | 2.835 | $ | 538 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | | 632.865 | | 123.078 | 2.058 | 0 | 2.058 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 3.061 | BRL | 14.929 | 0 | (206) | (206) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 122.096 | | 632.865 | 0 | (2.120) | (2.120) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | | 1.663 | | 8.786 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 08.2022 | BRL | 8.786 | $ | 1.650 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | | | | | | $ 6.772 | $ (27.693) | $ (20.921) | (0,04) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | CAD | 920 | $ | 709 | $ 0 | $ (5) | $ (5) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 57.058 | CAD | 72.413 | 0 | (922) | (922) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | | 3.830 | | 4.857 | 0 | (65) | (65) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | CAD | 2.675 | $ | 2.059 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 913 | CAD | 1.152 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | CAD | 523 | $ | 406 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| RBC | 07.2022 | | 42.978 | | 33.428 | 110 | 0 | 110 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 421 | CAD | 541 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 33.428 | | 42.981 | 0 | (109) | (109) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 57.434 | | 72.656 | 0 | (1.109) | (1.109) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | CAD | 56.624 | $ | 44.046 | 156 | (6) | 150 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 52.446 | CAD | 66.993 | 0 | (512) | (512) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 44.046 | | 56.628 | 7 | (155) | (148) | 0,00 |
| | | | | | | $ 274 | $ (2.919) | $ (2.645) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | CHF | 519 | $ | 526 | $ 0 | $ (16) | $ (16) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 218.388 | CHF | 208.690 | 0 | (401) | (401) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CHF | 5.051 | $ | 5.213 | 2 | (65) | (63) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 3.865 | CHF | 3.707 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | | 218.240 | | 208.894 | 0 | (39) | (39) | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | CHF | 197.367 | $ | 207.783 | 1.623 | 0 | 1.623 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 213.956 | CHF | 205.223 | 410 | 0 | 410 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 207.783 | | 197.040 | 0 | (1.610) | (1.610) | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | CHF | 528 | $ | 541 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | | 1.128 | | 1.175 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 708 | CHF | 691 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | CHF | 1.760 | $ | 1.837 | 5 | (7) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 731 | CHF | 706 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | CHF | 239 | $ | 248 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | | | | | | $ 2.067 | $ (2.154) | $ (87) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 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, Class E EUR (Hedged) ausschüttend II Q, G Retail EUR (Hedged) ausschüttend, H Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Class R EUR (Hedged) ausschüttend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend und Class T EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | € | 51.518 | $ | 55.106 | $ 1.247 | $ 0 | $ 1.247 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | | 5.335.092 | | 5.613.120 | 35.550 | 0 | 35.550 | 0,06 |
| | 07.2022 | $ | 105.065 | € | 97.637 | 0 | (2.991) | (2.991) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 5.268.707 | | 5.000.116 | 0 | (31.679) | (31.679) | (0,05) |
| CBK | 07.2022 | | 88.223 | | 82.178 | 0 | (2.310) | (2.310) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | € | 5.120.144 | $ | 5.385.551 | 33.107 | (409) | 32.698 | 0,06 |
| | 07.2022 | $ | 5.788.711 | € | 5.368.707 | 0 | (175.997) | (175.997) | (0,31) |
| | 08.2022 | | 5.269.688 | | 5.000.116 | 0 | (32.659) | (32.659) | (0,06) |
| SOG | 07.2022 | | 5.701.800 | | 5.304.948 | 0 | (155.744) | (155.744) | (0,27) |
| UAG | 07.2022 | | 4.832.416 | | 4.496.940 | 0 | (131.091) | (131.091) | (0,23) |
| | | | | | | $ 69.904 | $ (532.880) | $ (462.976) | (0,81) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | $ | 446.991 | £ | 353.526 | $ 0 | $ (17.651) | $ (17.651) | (0,03) |
| BPS | 07.2022 | £ | 5.999 | $ | 7.296 | 19 | (9) | 10 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 9.354 | £ | 7.438 | 0 | (321) | (321) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | £ | 535 | $ | 658 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 420.124 | £ | 333.153 | 0 | (15.526) | (15.526) | (0,03) |
| CBK | 07.2022 | £ | 161 | $ | 202 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | | 165 | | 208 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 248 | £ | 202 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | £ | 159 | $ | 192 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 449 | | 552 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | | 330.644 | | 402.394 | 843 | 0 | 843 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 402.581 | £ | 330.644 | 0 | (837) | (837) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | | 429.729 | | 340.860 | 0 | (15.772) | (15.772) | (0,03) |
| | | | | | | $ 891 | $ (50.120) | $ (49.229) | (0,09) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional JPY (Hedged) thesaurierend, Administrative JPY (Hedged) thesaurierend und Class E JPY (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | $ | 937 | ¥ | 126.591 | $ 0 | $ (5) | $ (5) | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | | 2.480 | | 316.214 | (1 ) | (152) | (153) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | ¥ | 271.092 | $ | 1.998 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 27 | ¥ | 3.468 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.998 | | 270.652 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | | 878 | | 117.266 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | ¥ | 664 | $ | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2.506 | ¥ | 318.766 | 0 | (160) | (160) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | ¥ | 179.752 | $ | 1.320 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 1.320 | ¥ | 179.461 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | ¥ | 264.535 | $ | 1.943 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2.494 | ¥ | 320.378 | 0 | (135) | (135) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.943 | | 264.106 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | | | | | | $ 9 | $ (478) | $ (469) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | $ | 73.243 | NOK | 691.308 | $ 0 | $ (3.271) | $ (3.271) | (0,01) |
| BRC | 07.2022 | NOK | 677.168 | $ | 69.075 | 534 | 0 | 534 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 74.279 | NOK | 699.705 | 0 | (3.457) | (3.457) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 69.075 | | 676.871 | 0 | (529) | (529) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | | 70.428 | | 663.683 | 0 | (3.252) | (3.252) | (0,01) |
| GLM | 07.2022 | | 4.860 | | 45.975 | 0 | (206) | (206) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | | 450 | | 4.210 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | NOK | 99 | $ | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | | 32 | | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 779 | NOK | 7.545 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | NOK | 679 | $ | 68 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 534 | $ (10.754) | $ (10.220) | (0,02) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional RMB (Hedged) thesaurierend, 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 | 07.2022 | $ | 31.070 | CNH | 207.589 | $ 0 | $ (106) | $ (106) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | | 31.305 | | 208.905 | 0 | (145) | (145) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 28.760 | | 192.859 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | | 26.609 | | 177.698 | 0 | (103) | (103) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | CNH | 15.783 | $ | 2.354 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2.743 | CNH | 18.423 | 7 | (2) | 5 | 0,00 |
| RBC | 07.2022 | | 51 | | 346 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 438 | | 2.957 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | | | | | | $ 11 | $ (360) | $ (349) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend, Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) thesaurierend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend und Class E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | SGD | 536.093 | $ | 385.762 | $ 554 | $ 0 | $ 554 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 809.805 | SGD | 1.109.542 | 0 | (12.548) | (12.548) | (0,02) |
| | 08.2022 | | 385.762 | | 536.085 | 0 | (552) | (552) | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | SGD | 1.075.182 | $ | 773.894 | 1.326 | 0 | 1.326 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2.290 | SGD | 3.154 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 773.894 | | 1.075.206 | 0 | (1.293) | (1.293) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | SGD | 5.529 | $ | 3.999 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 37.147 | SGD | 51.048 | 0 | (467) | (467) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.177 | | 1.635 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | | 9.906 | | 13.594 | 0 | (138) | (138) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 858.946 | | 1.173.892 | 0 | (15.451) | (15.451) | (0,03) |
| UAG | 07.2022 | SGD | 4.093 | $ | 2.942 | 2 | (1) | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 889.235 | SGD | 1.217.638 | 0 | (14.306) | (14.306) | (0,03) |
| | | | | | | $ 1.908 | $ (44.782) | $ (42.874) | (0,08) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **$ (991.113)** | **(1,74)** |

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.07.2052 (k) | $ 1.285.050 | $ (1.236.158) | (2,17) |
| 4,500 % fällig am 01.08.2052 | 10.700 | (10.720) | (0,02) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (1.246.878)** | **(2,19)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 66.969.332** | **117,79** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (10.112.165)** | **(17,79)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 56.857.167** | **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.**

µ **Bei diesem Betrag handelt es sich ganz oder teilweise um ungedeckte Darlehenszusagen. Der Zinssatz für den ungedeckten Teil wird zum Zeitpunkt der Finanzierung festgelegt.**

(a) **Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

(b) Reines Kapitalwertpapier.

(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) Zum 30. Juni 2022 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

(l) Eingeschränkte Wertpapiere:

| Emittentenbeschreibung | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|
| Chester A PLC 0,000 % fällig am 17.03.2046 | 18.04.2019 | $ 12.673 | $ 13.812 | 0,03 |
| Chester A PLC 0,000 % fällig am 20.05.2046 | 18.04.2019 | 17.298 | 8.350 | 0,02 |
| Chester A PLC 1,570 % fällig am 17.03.2046 | 18.04.2019 | 95.574 | 89.649 | 0,16 |
| Chester A PLC 2,020 % fällig am 17.03.2046 | 18.04.2019 | 19.159 | 17.715 | 0,03 |
| Chester A PLC 2,520 % fällig am 17.03.2046 | 18.04.2019 | 17.790 | 16.383 | 0,03 |
| Chester A PLC 3,020 % fällig am 17.03.2046 | 18.04.2019 | 10.947 | 10.027 | 0,02 |
| Chester A PLC 3,770 % fällig am 17.03.2046 | 18.04.2019 | 5.473 | 5.024 | 0,01 |
| Constellation Oil Services Holding S.A. | 10.06.2022 | 353 | 353 | 0,00 |
| Constellation Oil Services Holding S.A. - Exp. 10. Juni 2071 | 10.06.2022 | 0 | 0 | 0,00 |
| Deutsche Bank AG 3,035 % fällig am 28.05.2032 | 25.05.2021 - 29.09.2021 | 46.094 | 36.381 | 0,06 |
| Intelsat Emergence S.A. | 19.06.2017 - 23.02.2022 | 440.150 | 130.176 | 0,23 |
| Morgan Stanley 0,000 % fällig am 02.04.2032 | 11.02.2020 | 59.346 | 42.779 | 0,08 |
| Neiman Marcus Group Ltd. LLC | 25.09.2020 | 37.976 | 203.912 | 0,36 |
| Noble Corp. | 05.02.2021 - 25.02.2021 | 35.891 | 74.583 | 0,13 |
| Oracle Corp. 3,950 % fällig am 25.03.2051 | 22.03.2021 | 19.695 | 14.521 | 0,03 |
| Oracle Corp. 4,100 % fällig am 25.03.2061 | 22.03.2021 - 05.10.2021 | 28.221 | 19.016 | 0,03 |
| Sierra Hamilton Holder LLC | 31.07.2017 | 560 | 0 | 0,00 |
| Westmoreland Mining Holdings LLC | 08.12.2014 - 19.12.2019 | 1.691 | 0 | 0,00 |
| | | $ 848.891 | $ 682.681 | 1,22 |

(m) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 17.657 und Barmittel in Höhe von USD 14.344 als Sicherheiten verpfändet.

(n) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurde zum 30. Juni 2022 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von USD 38.318 und Barmittel in Höhe von USD 1.027.345 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 11.268 und Barmittel in Höhe von USD 6.953 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 1.979.890 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 344.795 | $ 58.901.148 | $ 727.130 | $ 59.973.073 |
| Investmentfonds | 1.971.634 | 287.243 | 0 | 2.258.877 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 5.903.711 | 0 | 5.903.711 |
| Finanzderivate[3] | 58.491 | 22.055 | 3 | 80.549 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (1.246.878) | 0 | (1.246.878) |
| **Summen** | **$ 2.374.920** | **$ 63.867.279** | **$ 727.133** | **$ 66.969.332** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 484.299 | $ 75.419.974 | $ 888.455 | $ 76.792.728 |
| Investmentfonds | 2.811.875 | 0 | 0 | 2.811.875 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 6.365.633 | 0 | 6.365.633 |
| Finanzderivate[3] | (11.742 ) | 1.055.957 | 3 | 1.044.218 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (484.196) | 0 | (484.196) |
| **Summen** | **$ 3.284.432** | **$ 82.357.368** | **$ 888.458** | **$ 86.530.258** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2022:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | (10,000) % | 24.06.2022 | TBD[1] | € (1.988) | $ (2.074) | 0,00 |
| JML | (3,500) | 29.03.2022 | TBD[1] | (611) | (633) | 0,00 |
| | (1,200) | 29.04.2022 | TBD[1] | (4.947) | (5.160) | (0,01) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (7.867)** | **(0,01)** |

[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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ (20) | $ 0 | $ (20) |
| BOA | 1.239 | (790) | 449 |
| BPS | 2.245 | (2.820) | (575) |
| BRC | 81.936 | (80.690) | 1.246 |
| BYL | (5.033) | 0 | (5.033) |
| CBK | (32.617) | 33.870 | 1.253 |
| DUB | (393) | (350) | (743) |
| FBF | (6.321) | 6.064 | (257) |
| GLM | (152.213) | 158.526 | 6.313 |
| GST | (210.232) | 209.465 | (767) |
| HUS | (3.628) | 5.310 | 1.682 |
| IND | 1 | 0 | 1 |
| JPM | (5.883) | 6.390 | 507 |
| JPS | (1.759) | 1.560 | (199) |
| MBC | (206.852) | 188.155 | (18.697) |
| MEI | (495) | 312 | (183) |
| MSC | 874 | 0 | 874 |
| MYC | (50.241) | 36.483 | (13.758) |
| MYI | (41.762) | 41.500 | (262) |
| RBC | (528) | 620 | 92 |
| RYL | (29) | 0 | (29) |
| SAL | (21.911) | 20.324 | (1.587) |
| SCX | 300 | 1.540 | 1.840 |
| SOG | (197.275) | 205.640 | 8.365 |
| TOR | (39.376) | 44.300 | 4.924 |
| UAG | (100.102) | 94.567 | (5.535) |

[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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 45,19 | 55,79 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 54,21 | 44,39 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 6,09 | 4,19 |
| Investmentfonds | 3,97 | 3,82 |
| Pensionsgeschäfte | 10,38 | 8,65 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,14 | (0,08) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 1,74 | 1,12 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (1,74) | 0,38 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (2,19) | (0,66) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (0,01) | (0,10) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 3,61 | 3,76 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 28,03 | 31,27 |
| Wandelanleihen & Wechsel | 0,04 | 0,04 |
| Kommunalanleihen und Wechsel | 0,30 | 0,54 |
| US-Regierungsbehörden | 27,29 | 17,92 |
| US-Schatzobligationen | 13,23 | 13,22 |
| Non-Agency-MBS | 13,34 | 10,90 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 8,89 | 8,81 |
| Staatsemissionen | 4,78 | 6,91 |
| Stammaktien | 1,03 | 0,87 |
| Bezugsrechte | 0,01 | k. A. |
| Optionsscheine | 0,08 | 0,07 |
| Vorzugswertpapiere | 0,29 | 0,32 |
| Real Estate Investment Trusts | 0,32 | 0,26 |
| Kurzfristige Instrumente | 4,25 | 9,48 |
| Investmentfonds | 3,97 | 3,82 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Pensionsgeschäfte | 10,38 | 8,65 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,14 | (0,08) |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | 0,00 | k. A. |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,04) | 0,02 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | 0,00 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,97) | 0,06 |
| Zinsswaps | 2,75 | 1,04 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoptionen | k. A. | 0,04 |
| Optionen auf Wertpapiere | 0,00 | 0,01 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,01) | 0,00 |
| Devisenoptionen | k. A. | 0,00 |
| Zinsswapoptionen | (0,32) | (0,05) |
| Optionen auf Wertpapiere | (0,01) | (0,01) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf | 0,00 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,49) | 0,01 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,09) | 0,11 |
| Zinsswaps | (0,02) | 0,02 |
| Total Return Swaps auf Indizes | 0,00 | 0,00 |
| Total Return Swaps auf Wertpapiere | 0,00 | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | 0,36 | (0,03) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (1,16) | 0,28 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (2,19) | (0,66) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (17,79) | (17,60) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Air Canada** | | | | |
| 4,250 % fällig am 11.08.2028 (a) | $ | 200 | $ 185 | 0,58 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | |
| 4,920 % fällig am 01.02.2029 (a) | | 20 | 18 | 0,05 |
| **United Airlines, Inc.** | | | | |
| 5,392 % fällig am 21.04.2028 (a) | | 247 | 230 | 0,72 |
| | | | 433 | 1,35 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **AGFC Capital Trust** | | | | |
| 2,794 % fällig am 15.01.2067 | | 440 | 240 | 0,75 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 1,875 % fällig am 09.01.2026 | € | 200 | 175 | 0,55 |
| **Bank of Ireland Group PLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.09.2025 (e)(g) | | 200 | 193 | 0,60 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 12.07.2026 | $ | 200 | 94 | 0,29 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 5,250 % fällig am 11.02.2027 (e)(g) | | 250 | 194 | 0,61 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 3,547 % fällig am 18.09.2031 | | 200 | 168 | 0,52 |
| 4,625 % fällig am 30.10.2027 (e)(g) | € | 200 | 161 | 0,50 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 2,386 % fällig am 17.02.2026 | | 100 | 92 | 0,29 |
| **Huarong Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 24.02.2030 | $ | 300 | 226 | 0,71 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.09.2031 (e)(g) | € | 250 | 204 | 0,64 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 5,750 % fällig am 20.06.2027 (e)(g) | £ | 200 | 218 | 0,68 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2027 | $ | 250 | 206 | 0,64 |
| **Sitka Holdings LLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 06.07.2026 | | 250 | 242 | 0,75 |
| **Swiss Insured Brazil Power Finance SARL** | | | | |
| 9,850 % fällig am 16.07.2032 | BRL | 1.065 | 177 | 0,55 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 4,375 % fällig am 10.02.2031 (e)(g) | $ | 250 | 184 | 0,57 |
| 4,875 % fällig am 12.02.2027 (e)(g) | | 200 | 168 | 0,52 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 5,459 % fällig am 30.06.2035 | | 300 | 243 | 0,76 |
| | | | 3.185 | 9,93 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **Atlantia SpA** | | | | |
| 1,875 % fällig am 12.02.2028 | € | 300 | 245 | 0,76 |
| **Boeing Co.** | | | | |
| 5,705 % fällig am 01.05.2040 | $ | 190 | 178 | 0,55 |
| **Carvana Co.** | | | | |
| 10,250 % fällig am 01.05.2030 | | 100 | 82 | 0,26 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.06.2041 | | 100 | 70 | 0,22 |
| **Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.04.2028 | | 240 | 175 | 0,55 |
| **Community Health Systems, Inc.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 01.04.2030 | | 400 | 245 | 0,76 |
| **CSC Holdings LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.11.2031 | | 200 | 155 | 0,48 |
| **Directv Financing LLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.08.2027 | | 350 | 300 | 0,94 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.12.2026 | | 130 | 102 | 0,32 |
| 5,750 % fällig am 01.12.2028 | | 130 | 96 | 0,30 |
| **Imperial Brands Finance Netherlands BV** | | | | |
| 1,750 % fällig am 18.03.2033 | € | 210 | 160 | 0,50 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.03.2030 | $ | 70 | 58 | 0,18 |
| **Magallanes, Inc.** | | | | |
| 4,054 % fällig am 15.03.2029 | | 150 | 137 | 0,43 |
| **MGM China Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.02.2027 | | 200 | 142 | 0,44 |
| **NCL Corp. Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.02.2027 | $ | 150 | $ 128 | 0,40 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 5,950 % fällig am 28.01.2031 | | 30 | 22 | 0,07 |
| 6,700 % fällig am 16.02.2032 | | 179 | 137 | 0,43 |
| 6,750 % fällig am 21.09.2047 | | 48 | 30 | 0,09 |
| 6,950 % fällig am 28.01.2060 | | 60 | 37 | 0,12 |
| **Prosus NV** | | | | |
| 3,257 % fällig am 19.01.2027 | | 200 | 174 | 0,54 |
| **Studio City Co. Ltd.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.02.2027 | | 200 | 174 | 0,54 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.04.2031 | | 250 | 216 | 0,67 |
| **U.S. Renal Care, Inc.** | | | | |
| 10,625 % fällig am 15.07.2027 | | 240 | 91 | 0,28 |
| **Venture Global Calcasieu Pass LLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.08.2029 | | 200 | 175 | 0,55 |
| | | | 3.329 | 10,38 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 17.02.2027 | € | 250 | 79 | 0,25 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.06.2028 | $ | 300 | 259 | 0,81 |
| 4,450 % fällig am 15.04.2042 ^ | | 250 | 188 | 0,59 |
| 5,250 % fällig am 01.03.2052 | | 200 | 165 | 0,51 |
| 5,900 % fällig am 15.06.2032 | | 300 | 290 | 0,90 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 6,850 % fällig am 05.06.2115 | | 45 | 37 | 0,12 |
| 7,250 % fällig am 17.03.2044 | | 42 | 40 | 0,12 |
| | | | 1.058 | 3,30 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 7.572 | 23,61 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.09.2048 - 01.08.2049 | | 36 | 36 | 0,11 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 | | 300 | 270 | 0,84 |
| 3,000 % fällig am 01.08.2052 | | 900 | 838 | 2,61 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2052 | | 2.300 | 2.210 | 6,89 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2052 | | 1.600 | 1.575 | 4,91 |
| | | | 4.929 | 15,36 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.05.2042 | | 600 | 586 | 1,83 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)** | | | | |
| 0,250 % fällig am 15.07.2029 | | 452 | 438 | 1,36 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2049 | | 115 | 111 | 0,35 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 0,875 % fällig am 15.11.2030 | | 300 | 253 | 0,79 |
| 2,375 % fällig am 31.03.2029 | | 500 | 479 | 1,49 |
| 2,750 % fällig am 15.05.2025 | | 2.500 | 2.481 | 7,74 |
| | | | 4.348 | 13,56 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 1,864 % fällig am 25.08.2036 | | 711 | 294 | 0,92 |
| **Commercial Mortgage Lease-Backed Certificates** | | | | |
| 8,110 % fällig am 20.06.2031 | | 332 | 337 | 1,05 |
| **Credit Suisse Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,792 % fällig am 15.01.2049 | | 8 | 8 | 0,02 |
| **GS Mortgage Securities Corp. Trust** | | | | |
| 3,324 % fällig am 15.11.2032 | | 489 | 468 | 1,46 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 3,735 % fällig am 05.01.2031 | | 457 | 454 | 1,41 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 1,984 % fällig am 25.11.2035 | | 432 | 407 | 1,27 |
| **Liberty Street Trust** | | | | |
| 4,501 % fällig am 10.02.2036 | | 500 | 479 | 1,49 |
| **Morgan Stanley Capital Trust** | | | | |
| 2,524 % fällig am 15.07.2035 | | 300 | 289 | 0,90 |
| **Newgate Funding PLC** | | | | |
| 1,578 % fällig am 01.12.2050 | £ | 419 | 481 | 1,50 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.09.2035 ^ | $ | 270 | $ 249 | 0,78 |
| **Stratton Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 3,461 % fällig am 20.07.2060 | £ | 440 | 531 | 1,66 |
| **Trinity Square PLC** | | | | |
| 3,200 % fällig am 15.07.2059 | | 500 | 587 | 1,83 |
| | | | 4.584 | 14,29 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 3,424 % fällig am 25.11.2034 | $ | 400 | 378 | 1,18 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 1,844 % fällig am 25.08.2037 | | 270 | 246 | 0,77 |
| 1,844 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 260 | 243 | 0,76 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,164 % fällig am 25.03.2036 | | 731 | 636 | 1,98 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 2,284 % fällig am 25.04.2036 | | 737 | 639 | 1,99 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.10.2036 | | 790 | 289 | 0,90 |
| 1,854 % fällig am 25.12.2036 | | 662 | 275 | 0,86 |
| 2,224 % fällig am 25.02.2036 | | 376 | 323 | 1,01 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,134 % fällig am 25.02.2036 | | 427 | 399 | 1,24 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,359 % fällig am 25.10.2035 | | 700 | 593 | 1,85 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | | |
| 2,794 % fällig am 25.12.2035 | | 200 | 194 | 0,60 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 2,599 % fällig am 25.05.2035 | | 711 | 616 | 1,92 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,914 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 662 | 632 | 1,97 |
| | | | 5.463 | 17,03 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 09.07.2030 | | 160 | 35 | 0,11 |
| 1,125 % fällig am 09.07.2035 | | 179 | 38 | 0,12 |
| 2,000 % fällig am 09.01.2038 | | 63 | 18 | 0,06 |
| 2,500 % fällig am 09.07.2041 | | 272 | 71 | 0,22 |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2026 | CLP | 50.000 | 50 | 0,16 |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 10,000 % fällig am 05.12.2024 | MXN | 10.000 | 503 | 1,57 |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 6,900 % fällig am 12.08.2037 | PEN | 700 | 167 | 0,52 |
| **Romania Government International Bond** | | | | |
| 3,750 % fällig am 07.02.2034 | € | 220 | 173 | 0,54 |
| **Russia Government International Bond** | | | | |
| 4,875 % fällig am 16.09.2023 | $ | 200 | 53 | 0,16 |
| 5,250 % fällig am 23.06.2047 ^ | | 200 | 53 | 0,16 |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 10,500 % fällig am 21.12.2026 | ZAR | 5.900 | 381 | 1,19 |
| **Turkey Government International Bond** | | | | |
| 5,750 % fällig am 11.05.2047 | $ | 250 | 155 | 0,48 |
| | | | 1.697 | 5,29 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **FINANZWERTE** | | | | |
| **Intelsat Emergence S.A. (a)(h)** | | 935 | 26 | 0,08 |
| **RECHTE** | | | | |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp 12/05/2025** | | 194 | 1 | 0,00 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **U.S. TREASURY BILLS** | | | | |
| 0,885 % fällig am 26.07.2022 (b)(c) | $ | 1.200 | 1.199 | 3,74 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 1.199 | 3,74 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **$ 30.252** | **94,31** |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000$) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f) | 311.938 | $ 3.103 | 9,67 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$ 3.103** | **9,67** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 1,480 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 2.600 | U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2025 | $ (2.650) | $ 2.600 | $ 2.600 | 8,11 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (2.650)** | **$ 2.600** | **$ 2.600** | **8,11** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## VERKAUFSOPTIONEN

### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CME Kaufoptionen mit Ausübungskurs von @ USD 98,000 auf 3-Month SOFR December Futures | $ 98,000 | 15.12.2023 | 1 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| Call - CME Verkaufoptionen mit Ausübungskurs von @ USD 96,500 auf 3-Month SOFR December Futures | 96,500 | 15.12.2023 | 1 | (1) | (1) | (0,01) |
| | | | | $ (2) | $ (2) | (0,01) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ (2)** | **(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.EM-36 5-Year Index | 1,000 % | 20.12.2026 | $ 700 | $ (53) | (0,17) |
| CDX.HY-38 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2027 | 1.584 | (132) | (0,41) |
| | | | | $ (185) | (0,58) |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 % | 21.09.2032 | £ 200 | $ 16 | 0,05 |
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2052 | 150 | 52 | 0,16 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 16.06.2028 | ¥ 130.000 | 13 | 0,04 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,400 | 15.06.2032 | 40.000 | 2 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,250 | 15.06.2032 | $ 10 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2025 | 2.800 | (17) | (0,05) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 10.05.2031 | 1.025 | 140 | 0,43 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 16.06.2051 | 450 | 91 | 0,29 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2027 | € 400 | 20 | 0,06 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | 800 | 81 | 0,26 |
| | | | | | $ 399 | 1,25 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 214** | **0,67** |

(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

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,150 % | 01.12.2023 | 100 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,650 | 01.12.2023 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,350 | 16.08.2022 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 16.08.2022 | 100 | (1) | (1) | (0,01) |
| BPS | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 28.04.2023 | 100 | 1 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 28.04.2023 | 100 | 1 | 0 | 0,00 |
| CBK | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 01.09.2022 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 01.09.2022 | 100 | (1) | (1) | (0,01) |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,755 | 30.09.2022 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,955 | 30.09.2022 | 100 | (1) | (1) | (0,01) |
| DUB | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,920 | 13.10.2023 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,920 | 13.10.2023 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,790 | 08.04.2024 | 100 | (1) | (1) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,790 | 08.04.2024 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 02.09.2022 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 02.09.2022 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| GLM | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,920 | 13.10.2023 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,920 | 13.10.2023 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,018 | 20.10.2023 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,018 | 20.10.2023 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,140 | 23.10.2023 | 100 | (1) | (1) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,140 | 23.10.2023 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,190 | 23.10.2023 | 100 | (1) | (1) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,190 | 23.10.2023 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,225 | 23.10.2023 | 100 | (1) | (1) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,225 | 23.10.2023 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,973 | 25.10.2023 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,973 | 25.10.2023 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,841 | 27.10.2023 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,841 | 27.10.2023 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,088 | 03.11.2023 | 100 | (1) | (1) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,088 | 03.11.2023 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,910 | 10.11.2023 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,910 | 10.11.2023 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 17.11.2023 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 17.11.2023 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,150 | 20.11.2023 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,650 | 20.11.2023 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 07.12.2023 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 07.12.2023 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,697 | 02.04.2024 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,697 | 02.04.2024 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 05.04.2023 | 100 | 1 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 05.04.2023 | 100 | 1 | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 11.04.2023 | 200 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 11.04.2023 | 200 | 0 | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 26.04.2023 | 100 | 1 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 26.04.2023 | 100 | 1 | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 15.05.2023 | 100 | 1 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 15.05.2023 | 100 | 1 | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,400 | 17.08.2022 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,100 | 17.08.2022 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,370 | 18.08.2022 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,070 | 18.08.2022 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 06.09.2022 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 06.09.2022 | 100 | (1) | (1) | (0,01) |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 | 07.09.2022 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,100 | 07.09.2022 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | | $ (32) | $ (31) | (0,09) |

(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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2026 | $ 100 | $ (3) | $ (72) | $ (75) | (0,24) |
| MYC | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 100 | (5) | (70) | (75) | (0,23) |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 200 | (9) | (7) | (16) | (0,05) |
| | | | | | $ (17) | $ (149) | $ (166) | (0,52) |

(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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYC | Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,880 % | 30.09.2027 | $ 300 | $ 0 | $ (3) | $ (3) | (0,01) |
| | Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,900 | 04.10.2027 | 300 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | | | | | | $ 0 | $ (5) | $ (5) | (0,02) |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | PEN | 335 | $ | 83 | $ 0 | $ (5) | $ (5) | (0,01) |
| | 07.2022 | $ | 44 | PEN | 167 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 27 | $ | 28 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | £ | 35 | | 44 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 97 | € | 92 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 34 | £ | 28 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 134 | IDR | 1.973.342 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 556 | ¥ | 73.800 | 0 | (12) | (12) | (0,04) |
| | 08.2022 | | 3 | RUB | 468 | 5 | 0 | 5 | 0,02 |
| | 11.2022 | ZAR | 248 | $ | 16 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | BRL | 2.165 | | 420 | 6 | 0 | 6 | 0,02 |
| | 07.2022 | MXN | 16.665 | | 829 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 750 | MXN | 15.698 | 28 | 0 | 28 | 0,09 |
| | 08.2022 | € | 21 | $ | 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | MXN | 12.598 | | 574 | 0 | (47) | (47) | (0,15) |
| | 08.2022 | $ | 417 | BRL | 2.165 | 0 | (6) | (6) | (0,02) |
| | 08.2022 | | 191 | CAD | 247 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 16 | IDR | 236.023 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | ZAR | 965 | $ | 60 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 09.2022 | $ | 817 | MXN | 16.665 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 11.2022 | ZAR | 534 | $ | 33 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| BRC | 08.2022 | $ | 18 | IDR | 259.673 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 189 | $ | 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | $ | 78 | PEN | 303 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | MXN | 4.911 | $ | 237 | 0 | (5) | (5) | (0,02) |
| | 08.2022 | $ | 159 | AUD | 228 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 11.2022 | | 92 | PEN | 364 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 04.2023 | PEN | 284 | $ | 72 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| DUB | 08.2022 | € | 1.867 | | 1.982 | 25 | 0 | 25 | 0,08 |
| | 08.2022 | £ | 1.109 | | 1.368 | 20 | 0 | 20 | 0,06 |
| | 08.2022 | TWD | 1.308 | | 44 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 0 | RUB | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10.2022 | | 9 | | 907 | 5 | 0 | 5 | 0,02 |
| GLM | 07.2022 | | 316 | BRL | 1.572 | 0 | (16) | (16) | (0,05) |
| | 07.2022 | | 47 | MXN | 967 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN | 266 | $ | 71 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09.2022 | HKD | 274 | | 35 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10.2022 | $ | 24 | RUB | 2.239 | 12 | 0 | 12 | 0,04 |
| | 11.2022 | ZAR | 263 | $ | 16 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 05.2023 | | 51 | | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 08.2022 | CNH | 273 | | 41 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 48 | CAD | 61 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 28 | CLP | 23.395 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 341 | € | 317 | 0 | (9) | (9) | (0,03) |
| | 08.2022 | | 59 | IDR | 871.172 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 74 | ¥ | 9.900 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 05.2023 | CNH | 191 | $ | 28 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | HKD | 1.001 | | 128 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 122 | BRL | 593 | 0 | (8) | (8) | (0,02) |
| | 08.2022 | € | 9 | $ | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 1.011 | | 34 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 46 | CNY | 312 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 17 | € | 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 57 | IDR | 846.262 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 19 | ZAR | 309 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 08.2022 | CNH | 336 | $ | 50 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | £ | 401 | | 501 | 14 | 0 | 14 | 0,04 |
| | 08.2022 | $ | 75 | CNY | 499 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 09.2022 | HKD | 100 | $ | 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10.2022 | $ | 28 | MXN | 579 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 638 | $ | 41 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | | | | | | $ 133 | $ (123) | $ 10 | 0,03 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Class E 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | AUD 88 | $ 61 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 61 | AUD 88 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | AUD 104 | $ 72 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 91 | AUD 126 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| | 08.2022 | 72 | 104 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | AUD 2 | $ 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | $ 22 | AUD 31 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | AUD 0 | $ 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 96 | AUD 134 | 0 | (4) | (4) | (0,02) |
| SCX | 07.2022 | AUD 90 | $ 62 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 62 | AUD 90 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | 90 | 127 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | | | | $ 2 | $ (13) | $ (11) | (0,04) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 07.2022 | € 280 | $ 295 | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ 267 | € 250 | 0 | (6) | (6) | (0,02) |
| | 08.2022 | 290 | 275 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| CBK | 07.2022 | € 1 | $ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | 275 | 289 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ 213 | € 198 | 0 | (7) | (7) | (0,02) |
| | 08.2022 | 290 | 275 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| SCX | 07.2022 | 187 | 175 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| UAG | 07.2022 | 214 | 199 | 0 | (6) | (6) | (0,02) |
| | | | | $ 4 | $ (27) | $ (23) | (0,07) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Class E 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 | 07.2022 | $ 139 | £ 110 | $ 0 | $ (5) | $ (5) | (0,02) |
| BPS | 07.2022 | 91 | 73 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| BRC | 07.2022 | 139 | 110 | 0 | (5) | (5) | (0,02) |
| CBK | 07.2022 | 50 | 41 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | £ 3 | $ 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 84 | £ 68 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | 45 | 37 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 139 | 110 | 0 | (5) | (5) | (0,01) |
| | | | | $ 0 | $ (20) | $ (20) | (0,06) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Class E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | SGD 47 | $ 34 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 75 | SGD 102 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | 34 | 47 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | SGD 94 | $ 68 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 68 | SGD 94 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | SGD 3 | $ 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | $ 1 | SGD 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 75 | 103 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| UAG | 07.2022 | 78 | 106 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | $ 0 | $ (4) | $ (4) | (0,01) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (250)** | **(0,78)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 35.917** | **111,97** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ (3.840)** | **(11,97)** |
| **Nettovermögen** | **$ 32.077** | **100,00** |

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

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

(b) Nullkuponwertpapier.

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

(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Eingeschränkte Wertpapiere:

| Emittentenbeschreibung | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|
| Intelsat Emergence S.A | 24.02.2021 | $ 77 | $ 26 | 0,08 |

Barmittel in Höhe von USD 389 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 341 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 30.040 | $ 212 | $ 30.252 |
| Investmentfonds | 3.103 | 0 | 0 | 3.103 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 2.600 | 0 | 2.600 |
| Finanzderivate[3] | 0 | (38) | 0 | (38) |
| **Summen** | **$ 3.103** | **$ 32.602** | **$ 212** | **$ 35.917** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 26.438 | $ 76 | $ 26.514 |
| Investmentfonds | 2.701 | 0 | 0 | 2.701 |
| Finanzderivate[3] | 0 | 51 | 0 | 51 |
| **Summen** | **$ 2.701** | **$ 26.489** | **$ 76** | **$ 29.266** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (24) | $ 0 | $ (24) |
| BPS | (23) | 0 | (23) |
| BRC | (5) | 0 | (5) |
| CBK | (83) | 0 | (83) |
| DUB | 45 | 0 | 45 |
| GLM | (23) | 30 | 7 |
| MBC | (26) | 0 | (26) |
| MYC | (96) | 311 | 215 |
| MYI | (10) | 0 | (10) |
| SCX | 3 | 0 | 3 |
| 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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 40,06 | 51,64 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 52,53 | 37,86 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 1,72 | 5,97 |
| Investmentfonds | 9,67 | 9,73 |
| Pensionsgeschäfte | 8,11 | k. A. |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,01) | k. A. |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,67 | 0,05 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (0,78) | 0,14 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 1,35 | 2,12 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 23,61 | 29,17 |
| US-Regierungsbehörden | 15,36 | 12,14 |
| US-Schatzobligationen | 13,56 | 3,33 |
| Non-Agency-MBS | 14,29 | 16,66 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 17,03 | 9,34 |
| Staatsemissionen | 5,29 | 5,79 |
| Stammaktien | 0,08 | k. A. |
| Bezugsrechte | 0,00 | k. A. |
| Kurzfristige Instrumente | 3,74 | 16,92 |
| Investmentfonds | 9,67 | 9,73 |
| Pensionsgeschäfte | 8,11 | k. A. |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | (0,01) | k. A. |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,58) | k. A. |
| Zinsswaps | 1,25 | 0,05 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Zinsswapoptionen | (0,09) | k. A. |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,52) | k. A. |
| Zinsswaps | (0,02) | k. A. |
| Devisenterminkontrakte | 0,03 | 0,08 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (0,18) | 0,06 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (11,97) | (5,39 ) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Finanzanlagen des Inflation Multi-Asset Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.03.2028 (e) | $ | 60 | $ 53 | 0,01 |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 6.735 | 745 | 0,16 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 5.061 | 571 | 0,12 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 1 | 0 | 0,00 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 1.475 | 164 | 0,03 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 295 | 32 | 0,01 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 13.473 | 1.497 | 0,32 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2053 | | 200 | 24 | 0,01 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 24.145 | 2.668 | 0,57 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 2.366 | 258 | 0,05 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 29.674 | 3.327 | 0,71 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2053 | | 499 | 59 | 0,01 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 3 | 0 | 0,00 |
| 3,500 % fällig am 01.10.2053 | | 3.700 | 502 | 0,11 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 12.591 | 1.390 | 0,29 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 593 | 64 | 0,01 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 1.314 | 149 | 0,03 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | | 11.241 | 1.258 | 0,27 |
| 2,500 % fällig am 01.04.2047 | | 2 | 0 | 0,00 |
| | | | 12.761 | 2,71 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **eBay, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.01.2023 | $ | 100 | 100 | 0,02 |
| **Mitsubishi Corp.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 14.07.2022 | | 300 | 300 | 0,07 |
| | | | 400 | 0,09 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 7,250 % fällig am 17.03.2044 | | 157 | 150 | 0,03 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 13.311 | 2,83 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Ginnie Mae** | | | | |
| 0,382 % fällig am 20.08.2068 | | 106 | 103 | 0,02 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 | | 200 | 180 | 0,04 |
| 3,000 % fällig am 01.08.2052 | | 8.000 | 7.445 | 1,58 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2052 | | 11.858 | 11.394 | 2,42 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2052 | | 7.300 | 7.188 | 1,52 |
| | | | 26.310 | 5,58 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.01.2023 | | 1.127 | 1.146 | 0,24 |
| 0,125 % fällig am 15.04.2025 | | 2.014 | 2.016 | 0,43 |
| 0,125 % fällig am 15.04.2026 | | 2.645 | 2.622 | 0,56 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2026 | | 181 | 180 | 0,04 |
| 0,125 % fällig am 15.10.2026 | | 13.011 | 12.898 | 2,74 |
| 0,125 % fällig am 15.04.2027 | | 1.229 | 1.210 | 0,26 |
| 0,125 % fällig am 15.01.2030 | | 112 | 107 | 0,02 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2030 | | 451 | 430 | 0,09 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2031 | | 11.971 | 11.392 | 2,42 |
| 0,125 % fällig am 15.01.2032 | | 38.999 | 37.053 | 7,86 |
| 0,125 % fällig am 15.02.2051 | | 999 | 771 | 0,16 |
| 0,125 % fällig am 15.02.2052 | | 1.661 | 1.293 | 0,27 |
| 0,250 % fällig am 15.07.2029 | | 2.162 | 2.098 | 0,45 |
| 0,375 % fällig am 15.01.2027 | | 1.663 | 1.658 | 0,35 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2027 | | 10.375 | 10.343 | 2,19 |
| 0,500 % fällig am 15.04.2024 | | 1.261 | 1.278 | 0,27 |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028 | | 5.156 | 5.124 | 1,09 |
| 0,625 % fällig am 15.04.2023 | | 465 | 474 | 0,10 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2024 | | 64 | 66 | 0,01 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2026 | | 122 | 123 | 0,03 |
| 0,625 % fällig am 15.02.2043 | | 13 | 11 | 0,00 |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 | | 2.084 | 2.100 | 0,45 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2042 | | 640 | 585 | 0,12 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2045 | $ | 3.805 | $ 3.414 | 0,72 |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 | | 2.473 | 2.497 | 0,53 |
| 0,875 % fällig am 15.02.2047 | | 7.666 | 7.098 | 1,51 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2046 | | 3.135 | 2.977 | 0,63 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2048 | | 410 | 392 | 0,08 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 | | 2.108 | 2.160 | 0,46 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 | | 31 | 32 | 0,01 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2040 | | 67 | 78 | 0,02 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2041 | | 792 | 922 | 0,20 |
| | | | 114.548 | 24,31 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **1211 Avenue of the Americas Trust** | | | | |
| 3,901 % fällig am 10.08.2035 | | 1.900 | 1.836 | 0,39 |
| **Banc of America Alternative Loan Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2046 | | 205 | 186 | 0,04 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 3,266 % fällig am 20.01.2047 | | 225 | 203 | 0,04 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2034 | | 78 | 79 | 0,02 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.08.2034 | | 264 | 248 | 0,05 |
| **CityLine Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 2,871 % fällig am 10.11.2031 | | 2.475 | 2.414 | 0,51 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 | | 109 | 99 | 0,02 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | |
| 1,795 % fällig am 16.09.2069 | £ | 68 | 83 | 0,02 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,512 % fällig am 20.06.2035 | $ | 57 | 53 | 0,01 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | | |
| 1,703 % fällig am 25.05.2053 | £ | 195 | 236 | 0,05 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | | |
| 2,826 % fällig am 25.06.2035 | $ | 0 | 0 | 0,00 |
| **New Residential Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,500 % fällig am 25.05.2058 | | 171 | 170 | 0,04 |
| **One Market Plaza Trust** | | | | |
| 3,614 % fällig am 10.02.2032 | | 2.000 | 1.965 | 0,42 |
| **Polaris PLC** | | | | |
| 1,740 % fällig am 23.10.2059 | £ | 395 | 474 | 0,10 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | | |
| 1,995 % fällig am 20.07.2036 | $ | 191 | 170 | 0,04 |
| **Towd Point Mortgage Trust** | | | | |
| 3,500 % fällig am 25.01.2058 | | 2.230 | 2.118 | 0,45 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,284 % fällig am 25.01.2045 | | 206 | 197 | 0,04 |
| 2,383 % fällig am 25.09.2033 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,644 % fällig am 25.08.2045 | | 1.985 | 1.909 | 0,40 |
| | | | 12.441 | 2,64 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,404 % fällig am 25.05.2034 | | 104 | 103 | 0,02 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | |
| 2,224 % fällig am 25.10.2034 | | 121 | 120 | 0,03 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,254 % fällig am 25.02.2036 | | 135 | 135 | 0,03 |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,974 % fällig am 25.10.2037 | | 55 | 55 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,914 % fällig am 25.09.2036 | | 121 | 118 | 0,03 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,569 % fällig am 25.10.2034 | | 184 | 180 | 0,04 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 1,804 % fällig am 25.06.2047 | | 2.326 | 2.191 | 0,46 |
| 2,419 % fällig am 25.02.2036 | | 21 | 21 | 0,00 |
| **Encore Credit Receivables Trust** | | | | |
| 2,524 % fällig am 25.01.2036 | | 900 | 854 | 0,18 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,934 % fällig am 25.07.2036 | | 169 | 162 | 0,03 |
| 2,404 % fällig am 25.09.2035 | | 110 | 109 | 0,02 |
| 2,494 % fällig am 25.09.2035 | | 261 | 258 | 0,05 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 2,479 % fällig am 25.08.2034 | | 154 | 150 | 0,03 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.05.2037 | $ | 35 | $ 35 | 0,01 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.07.2036 | | 1.675 | 1.631 | 0,35 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 2,284 % fällig am 25.01.2035 | | 134 | 130 | 0,03 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 3,424 % fällig am 25.12.2034 | | 751 | 743 | 0,16 |
| **Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 1,934 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 2.100 | 1.931 | 0,41 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 1,904 % fällig am 25.09.2036 | | 1.000 | 969 | 0,21 |
| 2,119 % fällig am 25.04.2036 | | 50 | 50 | 0,01 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 1,754 % fällig am 25.12.2036 | | 2.014 | 1.870 | 0,40 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 3,349 % fällig am 25.11.2035 | | 1.000 | 997 | 0,21 |
| | | | 12.812 | 2,72 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Australia Government International Bond** | | | | |
| 0,750 % fällig am 21.11.2027 | AUD | 668 | 457 | 0,10 |
| 3,000 % fällig am 20.09.2025 | | 1.128 | 850 | 0,18 |
| **Canadian Government Real Return Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.12.2050 (d) | CAD | 230 | 142 | 0,03 |
| 1,250 % fällig am 01.12.2047 (d) | | 2.126 | 1.592 | 0,34 |
| **Denmark Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.11.2023 (d) | DKK | 3.368 | 495 | 0,10 |
| **France Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 01.03.2026 (d) | € | 327 | 363 | 0,08 |
| 0,100 % fällig am 01.03.2028 (d) | | 881 | 978 | 0,21 |
| 0,100 % fällig am 25.07.2031 (d) | | 6.341 | 6.926 | 1,47 |
| 0,100 % fällig am 25.07.2038 (d) | | 912 | 949 | 0,20 |
| 0,250 % fällig am 25.07.2024 (d) | | 3.258 | 3.646 | 0,77 |
| 0,700 % fällig am 25.07.2030 (d) | | 1.493 | 1.726 | 0,37 |
| 1,800 % fällig am 25.07.2040 (d) | | 39 | 53 | 0,01 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.05.2023 (d) | | 56 | 61 | 0,01 |
| 0,100 % fällig am 15.05.2033 (d) | | 1.384 | 1.254 | 0,27 |
| 0,400 % fällig am 15.05.2030 (d) | | 3.769 | 3.756 | 0,80 |
| 1,400 % fällig am 26.05.2025 (d) | | 6.701 | 7.303 | 1,55 |
| 2,350 % fällig am 15.09.2024 (d) | | 1.099 | 1.260 | 0,27 |
| 2,600 % fällig am 15.09.2023 (d) | | 523 | 592 | 0,13 |
| **Japan Government International Bond** | | | | |
| 0,005 % fällig am 10.03.2031 (d) | ¥ | 20.469 | 159 | 0,03 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2024 (d) | | 414.180 | 3.114 | 0,66 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2028 (d) | | 176.733 | 1.367 | 0,29 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2029 (d) | | 408.172 | 3.164 | 0,67 |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | PEN | 500 | 116 | 0,02 |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 3,875 % fällig am 23.04.2023 | $ | 200 | 201 | 0,04 |
| **Saudi Arabia Government International Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 17.04.2025 | | 380 | 383 | 0,08 |
| **Spain Government International Bond** | | | | |
| 0,650 % fällig am 30.11.2027 (d) | € | 10.160 | 11.265 | 2,39 |
| 0,700 % fällig am 30.11.2033 (d) | | 1.575 | 1.682 | 0,36 |
| 1,450 % fällig am 31.10.2027 | | 300 | 308 | 0,07 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 0,125 % fällig am 10.08.2028 (d) | £ | 287 | 388 | 0,08 |
| 0,125 % fällig am 10.08.2031 (d) | | 7.058 | 9.915 | 2,10 |
| 0,125 % fällig am 22.11.2036 (d) | | 154 | 223 | 0,05 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2039 (d) | | 338 | 493 | 0,10 |
| 0,125 % fällig am 10.08.2041 (d) | | 322 | 479 | 0,10 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2044 (d) | | 551 | 819 | 0,17 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2046 (d) | | 1.713 | 2.564 | 0,54 |
| 0,125 % fällig am 10.08.2048 (d) | | 1.642 | 2.484 | 0,53 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2051 (d) | | 432 | 660 | 0,14 |
| 0,250 % fällig am 22.03.2052 (d) | | 1.243 | 1.973 | 0,42 |
| 0,500 % fällig am 22.03.2050 (d) | | 1.300 | 2.163 | 0,46 |
| 0,625 % fällig am 22.03.2040 (d) | | 232 | 367 | 0,08 |
| 0,625 % fällig am 22.11.2042 (d) | | 787 | 1.280 | 0,27 |
| 0,750 % fällig am 22.11.2047 (d) | | 2.011 | 3.460 | 0,73 |
| 1,250 % fällig am 22.11.2027 (d) | | 1.826 | 2.586 | 0,55 |
| 1,250 % fällig am 22.11.2032 (d) | | 354 | 555 | 0,12 |
| 4,125 % fällig am 22.07.2030 | | 465 | 876 | 0,19 |
| | | | 85.447 | 18,13 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Activision Blizzard, Inc. | 2.060 | $ 161 | 0,03 |
| TEGNA, Inc. | 9.670 | 203 | 0,04 |
| Twitter, Inc. (a) | 7.175 | 268 | 0,06 |
| | | 632 | 0,13 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Hilton Worldwide Holdings, Inc. | 121 | 14 | 0,00 |
| Marriott International, Inc. 'A' | 121 | 16 | 0,01 |
| | | 30 | 0,01 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Alleghany Corp. (a) | 429 | 357 | 0,08 |
| First Horizon Corp. | 9.765 | 214 | 0,04 |
| | | 571 | 0,12 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Biohaven Pharmaceutical Holding Co. Ltd. (a) | 2.898 | 422 | 0,09 |
| Change Healthcare, Inc. (a) | 2.746 | 63 | 0,02 |
| LHC Group, Inc. (a) | 1.809 | 282 | 0,06 |
| Turning Point Therapeutics, Inc. (a) | 6.446 | 485 | 0,10 |
| | | 1.252 | 0,27 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Rogers Corp. (a) | 555 | 145 | 0,03 |
| Switch, Inc. 'A' | 12.612 | 423 | 0,09 |
| Vonage Holdings Corp. (a) | 7.380 | 139 | 0,03 |
| | | 707 | 0,15 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| GCP Applied Technologies, Inc. (a) | 4.904 | 153 | 0,03 |
| **IMMOBILIEN** | | | |
| CBRE Group, Inc. 'A' (a) | 428 | 32 | 0,01 |
| Howard Hughes Corp. (a) | 754 | 51 | 0,01 |
| | | 83 | 0,02 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| PNM Resources, Inc. | 1.296 | 62 | 0,01 |
| | | 3.490 | 0,74 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| Nationwide Building Society 10,250 % | 3.685 | $ 656 | 0,14 |
| **REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS** | | | |
| Agree Realty Corp. | 750 | 54 | 0,01 |
| Alexandria Real Estate Equities, Inc. | 1.373 | 199 | 0,04 |
| American Assets Trust, Inc. | 1.851 | 55 | 0,01 |
| American Homes 4 Rent 'A' | 5.875 | 208 | 0,04 |
| American Tower Corp. | 1.100 | 281 | 0,06 |
| Apartment Income REIT Corp. | 2.639 | 110 | 0,02 |
| AvalonBay Communities, Inc. | 1.535 | 298 | 0,06 |
| Camden Property Trust | 430 | 58 | 0,01 |
| Crown Castle International Corp. | 423 | 71 | 0,02 |
| CubeSmart | 1.825 | 78 | 0,02 |
| Digital Realty Trust, Inc. | 1.470 | 191 | 0,04 |
| Duke Realty Corp. | 5.529 | 304 | 0,07 |
| Equinix, Inc. | 210 | 138 | 0,03 |
| Equity LifeStyle Properties, Inc. | 3.818 | 269 | 0,06 |
| Equity Residential | 3.866 | 279 | 0,06 |
| Essex Property Trust, Inc. | 345 | 90 | 0,02 |
| Extra Space Storage, Inc. | 429 | 73 | 0,02 |
| First Industrial Realty Trust, Inc. | 3.127 | 149 | 0,03 |
| Gaming and Leisure Properties, Inc. | 2.280 | 105 | 0,02 |
| Healthpeak Properties, Inc. | 4.091 | 106 | 0,02 |
| Host Hotels & Resorts, Inc. | 4.835 | 76 | 0,02 |
| Hudson Pacific Properties, Inc. | 2.542 | 38 | 0,01 |
| Invitation Homes, Inc. | 12.792 | 455 | 0,10 |
| Kilroy Realty Corp. | 1.217 | 64 | 0,01 |
| Life Storage, Inc. | 718 | 80 | 0,02 |
| Medical Properties Trust, Inc. | 6.120 | 93 | 0,02 |
| Mid-America Apartment Communities, Inc. | 341 | 60 | 0,01 |
| Prologis, Inc. | 4.764 | 561 | 0,12 |
| Public Storage | 1.461 | 457 | 0,10 |
| Regency Centers Corp. | 671 | 40 | 0,01 |
| Retail Opportunity Investments Corp. | 2.171 | 34 | 0,01 |
| Rexford Industrial Realty, Inc. | 1.918 | 110 | 0,02 |
| RLJ Lodging Trust | 10.141 | 112 | 0,02 |
| Ryman Hospitality Properties, Inc. | 1.000 | 76 | 0,02 |
| Safehold, Inc. | 509 | 18 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| SBA Communications Corp. | 798 | 255 | 0,05 |
| Simon Property Group, Inc. | 2.893 | $ 275 | 0,06 |
| SITE Centers Corp. | 2.914 | 39 | 0,01 |
| Sun Communities, Inc. | 2.152 | 343 | 0,07 |
| Sunstone Hotel Investors, Inc. | 5.417 | 54 | 0,01 |
| Terreno Realty Corp. | 971 | 54 | 0,01 |
| UDR, Inc. | 1.429 | 66 | 0,01 |
| Ventas, Inc. | 2.380 | 122 | 0,03 |
| VICI Properties, Inc. | 24.881 | 741 | 0,16 |
| Welltower, Inc. | 2.190 | 180 | 0,04 |
| WP Carey, Inc. | 2.526 | 209 | 0,04 |
| | | 7.728 | 1,64 |

| | | PARI (000S) | | |
|---|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | | |
| 51,049 % fällig am 30.09.2022 (b)(c) | ARS | 4.800 | 16 | 0,00 |
| **U.S. TREASURY BILLS** | | | | |
| 0,672 % fällig am 07.07.2022 (b)(c) | $ | 4.300 | 4.300 | 0,91 |
| 0,704 % fällig am 26.07.2022 (b)(c)(g) | | 2.600 | 2.598 | 0,55 |
| 0,722 % fällig am 26.07.2022 (b)(c)(g) | | 2.200 | 2.198 | 0,47 |
| 0,830 % fällig am 19.07.2022 (b)(c) | | 8.400 | 8.396 | 1,78 |
| 1,159 % fällig am 06.09.2022 (b)(c) | | 23.700 | 23.633 | 5,02 |
| | | | 41.125 | 8,73 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 41.141 | 8,73 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **$ 317.884** | **67,46** |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f) | 4.706.635 | 46.822 | 9,94 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| Invesco Physical Gold ETC | 215.749 | 37.704 | 8,00 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$ 84.526** | **17,94** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GSC | 1,490 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 62.500 | Fannie Mae 2,500 % fällig am 01.12.2051 | $ (64.805) | $ 62.500 | $ 62.503 | 13,27 |
| SSB | 0,400 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 603 | U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026 | (615) | 603 | 603 | 0,13 |
| TDM | 1,480 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 25.700 | U.S. Treasury Notes 0,875 % - 2,875 % fällig am 30.04.2029 - 15.11.2030 | (26.414) | 25.700 | 25.701 | 5,45 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (91.834)** | **$ 88.803** | **$ 88.807** | **18,85** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 3-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 8 | $ (1) | 0,00 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 1 | 0 | 0,00 |
| E-mini S&P 500 Index September Futures | Long | 09.2022 | 33 | (211) | (0,05) |

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro STOXX 50 September Futures | Long | 09.2022 | 173 | $ (158) | (0,03) |
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09.2022 | 33 | 52 | 0,01 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09.2022 | 13 | 5 | 0,00 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09.2022 | 230 | (1.449) | (0,31) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 370 | 896 | 0,19 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 42 | 310 | 0,07 |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 45 | 197 | 0,04 |
| Euro-Schatz September Futures | Long | 09.2022 | 45 | (16) | 0,00 |
| FTSE 100 Index September Futures | Long | 09.2022 | 18 | (8) | 0,00 |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 62 | (143) | (0,03) |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 133 | (104) | (0,02) |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 71 | (169) | (0,04) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 193 | 203 | 0,04 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2022 | 219 | 318 | 0,07 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 47 | (11) | 0,00 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2022 | 31 | 148 | 0,03 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Long | 09.2022 | 377 | (1.382) | (0,29) |
| | | | | $ (1.523) | (0,32) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ (1.523)** | **(0,32)** |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-31 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 470 | $ (38) | (0,01) |
| CDX.EM-36 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 700 | (65) | (0,01) |
| | | | | $ (103) | (0,02) |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fest-Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 % | 21.09.2052 | £ 8.400 | $ 475 | 0,10 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 16.06.2031 | ¥ 50.000 | 13 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,450 | 20.03.2029 | 154.390 | 37 | 0,01 |
| Zahlung[3] | 3-Month EUR-EURIBOR | 0,526 | 21.11.2023 | € 1.500 | (29) | (0,01) |
| Erhalt[3] | 3-Month USD-LIBOR | 1,840 | 21.11.2028 | $ 3.100 | 156 | 0,03 |
| Zahlung[3] | 3-Month USD-LIBOR | 1,888 | 21.11.2053 | 600 | (115) | (0,02) |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | € 19.600 | (392) | (0,08) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 12.04.2027 | 600 | (28) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 11.05.2027 | 300 | (14) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,700 | 11.04.2027 | 300 | (13) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 13.05.2027 | 600 | (19) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.05.2027 | 200 | (7) | 0,00 |
| Erhalt | CPTFEMU | 2,600 | 15.05.2032 | 2.400 | (24) | (0,01) |
| Erhalt | CPTFEMU | 2,720 | 15.06.2032 | 4.200 | (133) | (0,03) |
| Erhalt | CPTFEMU | 2,965 | 15.05.2027 | 10.700 | 55 | 0,01 |
| Erhalt | CPTFEMU | 2,980 | 15.06.2027 | 19.000 | (239) | (0,05) |
| Erhalt | CPTFEMU | 3,000 | 15.05.2027 | 1.900 | 5 | 0,00 |
| Erhalt | CPTFEMU | 3,130 | 15.05.2027 | 2.100 | (8) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,280 | 19.05.2030 | $ 600 | (34) | (0,01) |
| Erhalt | CPURNSA | 1,794 | 24.08.2027 | 850 | 58 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 1,798 | 25.08.2027 | 300 | 21 | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 1,890 | 27.08.2027 | 500 | 34 | 0,01 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,954 | 03.06.2029 | 750 | (49) | (0,01) |
| Zahlung | CPURNSA | 2,165 | 16.04.2029 | 500 | (34) | (0,01) |
| Erhalt | CPURNSA | 2,220 | 13.04.2023 | 1.380 | 108 | 0,02 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,263 | 27.04.2023 | 80 | 6 | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,263 | 09.05.2023 | 300 | 23 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,281 | 10.05.2023 | 460 | 35 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,314 | 26.02.2026 | 400 | 29 | 0,01 |
| Zahlung | CPURNSA | 2,353 | 09.05.2028 | 300 | (22) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 2,360 | 09.05.2028 | 450 | (34) | (0,01) |
| Zahlung | CPURNSA | 2,364 | 10.05.2028 | 460 | (34) | (0,01) |
| Zahlung | CPURNSA | 2,379 | 09.07.2028 | 300 | (22) | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,419 | 05.03.2026 | 700 | 52 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,703 | 25.05.2026 | 300 | 23 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,768 | 13.05.2026 | 500 | 38 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,813 | 14.05.2026 | 300 | 23 | 0,00 |
| Zahlung | FRCPXTOB | 1,280 | 15.11.2034 | € 200 | (37) | (0,01) |
| Zahlung | FRCPXTOB | 1,590 | 15.02.2028 | 180 | (26) | (0,01) |
| Zahlung | UKRPI | 3,480 | 15.01.2030 | £ 800 | (125) | (0,03) |
| Zahlung | UKRPI | 3,566 | 15.03.2036 | 500 | (67) | (0,01) |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fest-Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | UKRPI | 3,850 % | 15.09.2024 | £ 400 | $ (63) | (0,01) |
| Erhalt | UKRPI | 4,140 | 15.10.2031 | 1.900 | 43 | 0,01 |
| Erhalt | UKRPI | 4,288 | 15.02.2032 | 3.200 | 43 | 0,01 |
| Erhalt | UKRPI | 4,300 | 15.01.2032 | 700 | 15 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 4,615 | 15.02.2027 | 4.900 | (68) | (0,01) |
| Erhalt | UKRPI | 4,735 | 15.12.2026 | 400 | 20 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 5,200 | 15.06.2024 | 1.300 | 4 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 5,330 | 15.06.2024 | 4.000 | 1 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 6,600 | 15.05.2024 | 800 | 1 | 0,00 |
| | | | | | $ (318) | (0,07) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (421)** | **(0,09)** |

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

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

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

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

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

### OPTIONSKAUF

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag(1) | Kosten | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,195 % | 02.11.2022 | 200 | $ 0 | $ 85 | 0,02 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,197 | 04.11.2022 | 250 | 19 | 106 | 0,02 |
| BRC | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,410 | 02.02.2023 | 6.900 | 34 | 6 | 0,00 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,197 | 04.11.2022 | 150 | 11 | 64 | 0,01 |
| CBK | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,720 | 23.02.2023 | 4.800 | 26 | 8 | 0,00 |
| DUB | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,237 | 17.11.2023 | 2.300 | 143 | 362 | 0,08 |
| GLM | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,200 | 26.04.2023 | 8.100 | 86 | 82 | 0,02 |
| JPM | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,710 | 25.01.2023 | 5.000 | 31 | 7 | 0,00 |
| MYC | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,428 | 31.01.2023 | 7.000 | 36 | 6 | 0,00 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,190 | 02.11.2022 | 200 | 15 | 85 | 0,02 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,200 | 31.05.2023 | 23.000 | 276 | 258 | 0,06 |
| | | | | | | | $ 677 | $ 1.069 | 0,23 |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag(1) | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 % | 20.07.2022 | 400 | $ (1) | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 600 | (2) | (2) | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 300 | (1) | 0 | 0,00 |
| BRC | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,600 | 17.08.2022 | 200 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 700 | (1) | (1) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 1.800 | (3) | (2) | 0,00 |
| GST | Call - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Kauf | 0,700 | 17.08.2022 | 200 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,300 | 17.08.2022 | 800 | (2) | (1) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 95,000 | 17.08.2022 | 400 | (5) | (6) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,250 | 20.07.2022 | 300 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,350 | 17.08.2022 | 400 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ (18) | $ (14) | 0,00 |

#### INFLATION-CAPPED OPTIONS

| Kontrahent | Beschreibung | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfalls-datum | Nenn-betrag(1) | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | Cap - OTC CPALEMU | $ 100,151 | Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0 | 22.06.2035 | 300 | $ (14) | $ (4) | 0,00 |

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag(1) | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,000 % | 02.11.2022 | 600 | $ 0 | $ (131) | (0,03) |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,000 | 04.11.2022 | 740 | (18) | (162) | (0,03) |

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag(1) | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,558 % | 02.02.2023 | 1.500 | $ (34) | $ (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,000 | 04.11.2022 | 460 | (11) | (101) | (0,02) |
| CBK | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,736 | 23.02.2023 | 1.100 | (27) | (5) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,340 | 17.11.2023 | 11.200 | (141) | (460) | (0,10) |
| GLM | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,350 | 26.04.2023 | 4.500 | (89) | (76) | (0,02) |
| JPM | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,785 | 25.01.2023 | 1.100 | (31) | (4) | 0,00 |
| MYC | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,579 | 31.01.2023 | 1.500 | (35) | (4) | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,350 | 31.05.2023 | 12.700 | (277) | (235) | (0,05) |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,000 | 02.11.2022 | 600 | (15) | (131) | (0,03) |
| | | | | | | | $ (678) | $ (1.313) | (0,28) |

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag(1) | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPM | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2052 | $ 96,906 | 04.08.2022 | 200 | $ (1) | $ (3) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,141 | 07.09.2022 | 300 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,156 | 07.09.2022 | 500 | (2) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,656 | 07.09.2022 | 900 | (3) | (7) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 101,141 | 07.09.2022 | 300 | (1) | (1) | 0,00 |
| SAL | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | 94,688 | 07.09.2022 | 900 | (5) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 99,156 | 07.07.2022 | 1.700 | (12) | (11) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 99,563 | 07.07.2022 | 600 | (3) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 100,281 | 07.07.2022 | 1.200 | (6) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 98,234 | 07.09.2022 | 1.700 | (10) | (7) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,406 | 07.09.2022 | 600 | (2) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,656 | 07.09.2022 | 800 | (3) | (7) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 100,234 | 07.09.2022 | 1.700 | (8) | (14) | (0,01) |
| | | | | | $ (57) | $ (67) | (0,01) |

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF(1)

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag(2) | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 % | 17.11.2059 | $ 200 | $ (6) | $ 5 | $ (1) | 0,00 |
| MYC | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 800 | (26) | 23 | (3) | 0,00 |
| SAL | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 200 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| UAG | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 400 | (12) | 11 | (1) | 0,00 |
| | | | | | $ (44) | $ 37 | $ (7) | 0,00 |

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

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

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYC | Erhalt | CPURNSA | 1,800 % | 20.07.2026 | $ 600 | $ 0 | $ (88) | $ (88) | (0,02) |
| | Erhalt | CPURNSA | 1,805 | 20.09.2026 | 50 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | Erhalt | CPURNSA | 1,810 | 19.07.2026 | 500 | 0 | (72) | (72) | (0,02) |
| | | | | | | $ 0 | $ (167) | $ (167) | (0,04) |

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nenn-betrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Erhalt | DWRTFT Index | 242 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 3.080 | 12.10.2022 | $ 0 | $ (242) | $ (242) | (0,05) |
| BPS | Erhalt | TRNGLU Index | 2.052 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | 10.700 | 12.10.2022 | 0 | (932) | (932) | (0,20) |
| | Erhalt | BCOMF1TC Index | 30.040 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 3.630 | 15.02.2023 | 0 | (353) | (353) | (0,07) |
| | Erhalt | BCOMTR Index | 160.733 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 44.560 | 15.02.2023 | 0 | (4.273) | (4.273) | (0,92) |
| | Erhalt | TRNGLU Index | 1.133 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | 5.866 | 24.05.2023 | 0 | (473) | (473) | (0,10) |
| CBK | Erhalt | BCOMF1TC Index | 21.724 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 2.999 | 15.02.2023 | 0 | (291) | (291) | (0,06) |
| | Erhalt | BCOMTR Index | 15.078 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 4.180 | 15.02.2023 | (261) | (140) | (401) | (0,09) |

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nenn-betrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | Erhalt | BCOMF1TC Index | 7.939 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 3.554 | 15.02.2023 | $ 0 | $ (345) | $ (345) | (0,07) |
| | Erhalt | BCOMTR Index | 47.063 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 13.047 | 15.02.2023 | 0 | (1.251) | (1.251) | (0,27) |
| JPM | Erhalt | DWRTFT Index | 418 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 5.319 | 12.10.2022 | 0 | (419) | (419) | (0,09) |
| | Erhalt | BCOMF1TC Index | 28.657 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 6.710 | 15.02.2023 | 0 | (652) | (652) | (0,14) |
| | Erhalt | BCOMTR Index | 45.127 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 12.511 | 15.02.2023 | 0 | (1.200) | (1.200) | (0,25) |
| | Erhalt | JMABDEWU Index | 16.708 | 0,053 % | 2.576 | 15.02.2023 | 0 | 43 | 43 | 0,01 |
| MAC | Erhalt | BCOMTR Index | 18.189 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 5.042 | 15.02.2023 | 0 | (483) | (483) | (0,10) |
| MYI | Erhalt | DWRTFT Index | 10 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 127 | 12.10.2022 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | Erhalt | DWRTFT Index | 1.205 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 15.242 | 04.01.2023 | 0 | (1.112) | (1.112) | (0,24) |
| SOG | Erhalt | BCOMTR Index | 11.446 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 3.173 | 15.02.2023 | 0 | (304) | (304) | (0,06) |
| | | | | | | | $ (261) | $ (12.437) | $ (12.698) | (2,70) |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | DKK | 695 | $ | 104 | $ 6 | $ 0 | $ 6 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 237 | CLP | 197.980 | 0 | (26) | (26) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 2.116 | € | 1.977 | 0 | (49) | (49) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 229 | HUF | 83.092 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 93 | PEN | 360 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09.2022 | PEN | 783 | $ | 203 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | € | 1.176 | | 1.238 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 30.163 | | 37.981 | 1.350 | 0 | 1.350 | 0,29 |
| | 07.2022 | ¥ | 218.300 | | 1.618 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 11.925 | | 593 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | PLN | 13 | | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 267 | CHF | 256 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 285 | DKK | 1.940 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 49.424 | € | 46.933 | 0 | (360) | (360) | (0,08) |
| | 07.2022 | | 613 | ¥ | 82.400 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.180 | MXN | 24.631 | 40 | 0 | 40 | 0,01 |
| | 08.2022 | € | 40.125 | $ | 42.280 | 254 | 0 | 254 | 0,05 |
| | 08.2022 | SGD | 16 | | 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | THB | 59 | | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 1.857 | INR | 144.754 | 0 | (31) | (31) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 442 | ZAR | 7.061 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 08.2022 | ZAR | 7.061 | $ | 459 | 30 | 0 | 30 | 0,01 |
| | 09.2022 | $ | 585 | MXN | 11.925 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 10.2022 | | 2.632 | ZAR | 39.330 | 0 | (256) | (256) | (0,06) |
| | 11.2022 | | 118 | | 1.906 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 1.906 | $ | 123 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | $ | 4.108 | ¥ | 557.246 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 556.341 | $ | 4.108 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 527 | IDR | 7.677.020 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 724 | SGD | 1.000 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | € | 882 | $ | 947 | 25 | 0 | 25 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 2.736 | £ | 2.179 | 0 | (89) | (89) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 1.016 | MXN | 20.590 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 385 | CLP | 339.403 | 0 | (26) | (26) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 282 | PHP | 14.907 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 12.2022 | PEN | 159 | $ | 38 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | DKK | 23.806 | | 3.525 | 179 | 0 | 179 | 0,04 |
| | 07.2022 | $ | 4.243 | PLN | 18.512 | 0 | (131) | (131) | (0,03) |
| | 08.2022 | | 1.090 | THB | 37.835 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 229 | TWD | 6.789 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | BRL | 16.229 | $ | 3.131 | 28 | 0 | 28 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 3.256 | BRL | 16.229 | 0 | (153) | (153) | (0,03) |
| | 07.2022 | | 349 | DKK | 2.420 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 273 | MXN | 5.571 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 3.106 | BRL | 16.229 | 0 | (30) | (30) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 51 | PEN | 192 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 2.451 | TRY | 43.072 | 61 | 0 | 61 | 0,01 |
| | 09.2022 | | 858 | HKD | 6.719 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10.2022 | | 2.017 | MXN | 41.288 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 05.2023 | | 55 | ZAR | 917 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| HUS | 07.2022 | AUD | 599 | $ | 433 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| | 07.2022 | CAD | 1.466 | | 1.161 | 25 | 0 | 25 | 0,01 |
| | 07.2022 | € | 656 | | 683 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 960 | ¥ | 127.500 | 0 | (22) | (22) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 517 | SEK | 5.050 | 0 | (24) | (24) | (0,01) |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08.2022 | $ | 988 | CLP | 827.720 | $ 0 | $ (110) | $ (110) | (0,02) |
| | 08.2022 | | 680 | IDR | 9.966.495 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | CZK | 225 | $ | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2.953 | CZK | 69.220 | 0 | (31) | (31) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 1.540 | IDR | 22.655.645 | 0 | (27) | (27) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 2.506 | KRW | 3.189.479 | 0 | (47) | (47) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 5.836 | SGD | 8.023 | 0 | (71) | (71) | (0,02) |
| | 08.2022 | | 2.685 | TWD | 79.108 | 0 | (20) | (20) | (0,01) |
| MYI | 07.2022 | DKK | 80.011 | $ | 11.868 | 620 | 0 | 620 | 0,13 |
| | 07.2022 | € | 131 | | 137 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 465 | | 562 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07.2022 | SGD | 118 | | 85 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 322 | DKK | 2.275 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 2.710 | CNY | 18.197 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 3.112 | INR | 243.119 | 0 | (46) | (46) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 3.241 | KRW | 4.128.152 | 0 | (58) | (58) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 494 | PEN | 1.851 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 2.679 | THB | 92.298 | 0 | (65) | (65) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 799 | TWD | 23.526 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 695 | MYR | 3.051 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| RBC | 08.2022 | | 1.208 | INR | 94.410 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | CLP | 1.114.965 | $ | 1.357 | 169 | 0 | 169 | 0,03 |
| | 07.2022 | $ | 878 | ILS | 2.961 | 0 | (32) | (32) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 4.352 | CNY | 29.127 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 09.2022 | COP | 3.084.968 | $ | 768 | 37 | 0 | 37 | 0,01 |
| | 11.2022 | $ | 1.085 | COP | 4.610.549 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | € | 46.672 | $ | 50.163 | 1.371 | 0 | 1.371 | 0,29 |
| | 08.2022 | $ | 895 | TWD | 25.769 | 0 | (27) | (27) | (0,01) |
| SSB | 09.2022 | | 2.840 | MYR | 12.439 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | ¥ | 794.394 | $ | 6.259 | 411 | 0 | 411 | 0,09 |
| UAG | 07.2022 | $ | 107 | CLP | 92.223 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.649 | HUF | 585.240 | 0 | (111) | (111) | (0,02) |
| | 08.2022 | | 641 | CLP | 560.527 | 0 | (48) | (48) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 1.398 | KRW | 1.735.901 | 0 | (60) | (60) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 1.143 | PHP | 59.949 | 0 | (55) | (55) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 561 | TRY | 10.078 | 26 | 0 | 26 | 0,01 |
| | 08.2022 | | 1.326 | ZAR | 19.918 | 0 | (115) | (115) | (0,03) |
| | 09.2022 | | 311 | HKD | 2.437 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 2.600 | MXN | 51.804 | 0 | (62) | (62) | (0,01) |
| | 10.2022 | | 373 | | 7.632 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 10.2022 | ZAR | 39.330 | $ | 2.660 | 283 | 0 | 283 | 0,06 |
| | 11.2022 | $ | 62 | ZAR | 1.011 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ 4.982 | $ (2.406) | $ 2.576 | 0,55 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | € | 223 | $ | 236 | $ 3 | $ 0 | $ 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 433 | € | 404 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | € | 87.446 | $ | 92.044 | 622 | 0 | 622 | 0,13 |
| | 07.2022 | $ | 11.179 | € | 10.528 | 0 | (172) | (172) | (0,04) |
| | 08.2022 | | 88.335 | | 83.832 | 0 | (531) | (531) | (0,11) |
| CBK | 07.2022 | | 3.922 | | 3.659 | 0 | (97) | (97) | (0,02) |
| HUS | 07.2022 | € | 83.832 | $ | 88.191 | 549 | 0 | 549 | 0,12 |
| | 07.2022 | $ | 90.188 | € | 83.688 | 5 | (2.700) | (2.695) | (0,57) |
| | 08.2022 | | 88.352 | | 83.832 | 0 | (548) | (548) | (0,12) |
| SOG | 07.2022 | | 86.849 | | 80.804 | 0 | (2.372) | (2.372) | (0,50) |
| UAG | 07.2022 | | 13.502 | | 12.565 | 0 | (366) | (366) | (0,08) |
| | | | | | | $ 1.179 | $ (6.798) | $ (5.619) | (1,19) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | £ | 21 | $ | 26 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 18.543 | £ | 14.666 | 0 | (732) | (732) | (0,16) |
| BPS | 07.2022 | | 498 | | 399 | 0 | (13) | (13) | (0,01) |
| BRC | 07.2022 | | 5.282 | | 4.188 | 0 | (196) | (196) | (0,04) |
| CBK | 07.2022 | £ | 804 | $ | 1.009 | 33 | 0 | 33 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 6 | € | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| HUS | 07.2022 | £ | 40 | $ | 49 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 140 | £ | 114 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 26 | | 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | £ | 14.058 | $ | 17.108 | 36 | 0 | 36 | 0,01 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08.2022 | $ 17.116 | £ 14.058 | $ 0 | $ (36) | $ (36) | (0,01) |
| TOR | 07.2022 | 18.264 | 14.487 | 0 | (670) | (670) | (0,14) |
| | | | | $ 70 | $ (1.649) | $ (1.579) | (0,34) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Administrative 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 | 07.2022 | SGD 1.664 | $ 1.197 | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 2.579 | SGD 3.533 | 0 | (40) | (40) | (0,01) |
| | 08.2022 | 1.197 | 1.664 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| BPS | 08.2022 | COP 4.138 | $ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 27 | SGD 37 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | SGD 32 | $ 23 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 34 | € 32 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | SGD 3.336 | $ 2.401 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 223 | SGD 307 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN 63 | $ 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 17 | PEN 63 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 2.401 | SGD 3.336 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| HUS | 07.2022 | SGD 1.957 | $ 1.418 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 1.819 | SGD 2.508 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 08.2022 | 54 | 75 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 08.2022 | 1 | COP 4.138 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 2.438 | SGD 3.332 | 0 | (44) | (44) | (0,01) |
| SOG | 07.2022 | 194 | 269 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | $ 18 | $ (111) | $ (93) | (0,02) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (17.916)** | **(3,80)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 471.353** | **100,04** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ (172)** | **(0,04)** |
| **Nettovermögen** | **$ 471.181** | **100,00** |

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

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

**^** **Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a)** **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

**(b)** **Nullkuponwertpapier.**

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

**(d)** **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

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

**(f)** **Mit dem Fonds verbunden.**

**(g)** **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 3 und Barmittel in Höhe von USD 12.523 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von USD 7.877 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 11.218 | $ 306.666 | $ 0 | $ 317.884 |
| Investmentfonds | 84.526 | 0 | 0 | 84.526 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 88.803 | 0 | 88.803 |
| Finanzderivate[3] | (1.909) | (17.951) | 0 | (19.860) |
| **Summen** | **$ 93.835** | **$ 377.518** | **$ 0** | **$ 471.353** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 20.179 | $ 122.440 | $ 0 | $ 142.619 |
| Investmentfonds | 12.603 | 7.844 | 0 | 20.447 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 500 | 0 | 500 |
| Finanzderivate[3] | 519 | (138) | 0 | 381 |
| **Summen** | **$ 33.301** | **$ 130.646** | **$ 0** | **$ 163.947** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (1.107) | $ 1.120 | $ 13 |
| BPS | (5.207) | 2.820 | (2.387) |
| BRC | (251) | 243 | (8) |
| CBK | (856) | 320 | (536) |
| DUB | (70) | 0 | (70) |
| GLM | (108) | 80 | (28) |
| GST | (1.598) | 1.100 | (498) |
| HUS | (2.827) | 0 | (2.827) |
| JPM | (2.443) | 1.550 | (893) |
| MAC | (483) | 333 | (150) |
| MBC | 0 | 2.550 | 2.550 |
| MYC | (192) | 260 | 68 |
| MYI | (691) | 470 | (221) |
| RBC | (17) | 0 | (17) |
| SAL | (53) | 0 | (53) |
| SCX | 118 | (260) | (142) |
| SOG | (1.333) | 1.240 | (93) |
| SSB | (19) | 0 | (19) |
| TOR | (259) | 50 | (209) |
| UAG | (520) | 390 | (130) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 46,58 | 80,61 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 18,87 | 5,58 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 2,01 | 0,60 |
| Investmentfonds | 17,94 | 12,44 |
| Pensionsgeschäfte | 18,85 | 0,30 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,32) | 0,23 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,09) | (1,16) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (3,80) | 1,16 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 2,83 | 9,40 |
| US-Regierungsbehörden | 5,58 | 2,73 |
| US-Schatzobligationen | 24,31 | 25,38 |
| Non-Agency-MBS | 2,64 | 1,28 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 2,72 | 1,81 |
| Staatsemissionen | 18,13 | 33,33 |
| Stammaktien | 0,74 | 6,22 |
| Vorzugswertpapiere | 0,14 | 0,58 |
| Real Estate Investment Trusts | 1,64 | 6,06 |
| Kurzfristige Instrumente | 8,73 | k. A. |
| Investmentfonds | 17,94 | 12,44 |
| Pensionsgeschäfte | 18,85 | 0,30 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,32) | 0,23 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,02) | 0,00 |
| Zinsswaps | (0,07) | (1,16) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoptionen | 0,23 | 0,14 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | 0,00 | 0,00 |
| Inflation-Capped Options | 0,00 | 0,00 |
| Zinsswapoptionen | (0,28) | (0,15) |
| Optionen auf Wertpapiere | (0,01) | (0,01) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | 0,00 | 0,01 |
| Zinsswaps | (0,04) | (0,09) |
| Total Return Swaps auf Indizes | (2,70) | 0,47 |
| Total Return Swaps auf Wertpapiere | k. A. | 0,09 |
| Devisenterminkontrakte | 0,55 | 0,22 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (1,55) | 0,48 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (0,04) | 0,24 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | |
| 2,375 % fällig am 01.06.2027 | € | 3.600 | $ 3.621 | 0,23 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.06.2023 | $ | 3.560 | 3.524 | 0,22 |
| **Asian Development Bank** | | | | |
| 6,550 % fällig am 26.01.2025 | ZAR | 46.000 | 2.727 | 0,17 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 0,875 % fällig am 18.09.2023 | $ | 2.400 | 2.316 | 0,15 |
| **Banco de Sabadell S.A.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 24.03.2026 | € | 3.500 | 3.488 | 0,22 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 3,892 % fällig am 24.05.2024 | $ | 3.600 | 3.584 | 0,23 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,822 % fällig am 22.09.2026 | € | 2.400 | 2.476 | 0,16 |
| 2,144 % fällig am 23.07.2024 | $ | 3.500 | 3.492 | 0,22 |
| 3,384 % fällig am 02.04.2026 | | 4.000 | 3.882 | 0,25 |
| 3,841 % fällig am 25.04.2025 | | 3.400 | 3.386 | 0,21 |
| **BNZ International Funding Ltd.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 03.11.2022 | | 4.200 | 4.199 | 0,27 |
| **Canadian Imperial Bank of Commerce** | | | | |
| 3,300 % fällig am 07.04.2025 | | 2.100 | 2.062 | 0,13 |
| **Capital One Financial Corp.** | | | | |
| 4,166 % fällig am 09.05.2025 | | 4.000 | 3.944 | 0,25 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 1,669 % fällig am 25.01.2026 (g) | | 2.900 | 2.802 | 0,18 |
| 2,014 % fällig am 25.01.2026 (g) | | 2.900 | 2.720 | 0,17 |
| 3,290 % fällig am 17.03.2026 (g) | | 4.000 | 3.872 | 0,24 |
| **Corsair International Ltd.** | | | | |
| 4,850 % fällig am 28.01.2027 | € | 2.600 | 2.566 | 0,16 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 12.05.2026 | | 2.200 | 2.049 | 0,13 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 2,204 % fällig am 24.04.2023 | $ | 4.450 | 4.450 | 0,28 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 3,700 % fällig am 21.02.2025 | | 4.000 | 3.910 | 0,25 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 4,550 % fällig am 17.04.2026 | | 2.400 | 2.350 | 0,15 |
| **Cromwell Ereit Lux Finco SARL** | | | | |
| 2,125 % fällig am 19.11.2025 | € | 1.975 | 1.690 | 0,11 |
| **CTP NV** | | | | |
| 0,500 % fällig am 21.06.2025 | | 2.300 | 2.051 | 0,13 |
| **Danske Bank A/S** | | | | |
| 3,773 % fällig am 28.03.2025 | $ | 4.000 | 3.937 | 0,25 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 1,000 % fällig am 19.11.2025 | € | 3.000 | 2.960 | 0,19 |
| 1,665 % fällig am 08.11.2023 | $ | 2.800 | 2.767 | 0,17 |
| 2,444 % fällig am 16.11.2027 | | 1.500 | 1.373 | 0,09 |
| 3,300 % fällig am 16.11.2022 | | 4.100 | 4.100 | 0,26 |
| 3,961 % fällig am 26.11.2025 | | 4.000 | 3.869 | 0,24 |
| **Equinix, Inc.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 18.11.2024 | | 3.400 | 3.264 | 0,21 |
| **Equitable Holdings, Inc.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 20.04.2023 | | 52 | 52 | 0,00 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 3,550 % fällig am 07.10.2022 | | 3.000 | 2.990 | 0,19 |
| 3,810 % fällig am 09.01.2024 | | 1.000 | 972 | 0,06 |
| **GA Global Funding Trust** | | | | |
| 1,250 % fällig am 08.12.2023 | | 3.400 | 3.265 | 0,21 |
| 3,850 % fällig am 11.04.2025 | | 3.500 | 3.437 | 0,22 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 3,550 % fällig am 08.07.2022 | | 2.800 | 2.800 | 0,18 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 1,757 % fällig am 24.01.2025 | | 1.800 | 1.732 | 0,11 |
| 2,009 % fällig am 06.12.2023 | | 2.800 | 2.768 | 0,18 |
| 2,255 % fällig am 23.02.2023 | | 1.000 | 999 | 0,06 |
| 3,000 % fällig am 15.03.2024 | | 3.300 | 3.259 | 0,21 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 2,999 % fällig am 10.03.2026 | | 3.600 | 3.431 | 0,22 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 3,869 % fällig am 28.03.2026 | | 4.000 | 3.925 | 0,25 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 1,514 % fällig am 01.06.2024 | | 2.800 | 2.731 | 0,17 |
| 2,595 % fällig am 24.02.2026 | | 2.700 | 2.569 | 0,16 |
| **Manulife Financial Corp.** | | | | |
| 4,150 % fällig am 04.03.2026 | $ | 1.500 | $ 1.483 | 0,09 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | |
| 1,763 % fällig am 19.07.2023 | AUD | 4.800 | 3.316 | 0,21 |
| 1,979 % fällig am 10.07.2024 | $ | 3.100 | 3.089 | 0,20 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 2,630 % fällig am 18.02.2026 | | 6.700 | 6.401 | 0,41 |
| 3,620 % fällig am 17.04.2025 | | 4.000 | 3.952 | 0,25 |
| **NatWest Markets PLC** | | | | |
| 3,479 % fällig am 22.03.2025 | | 4.000 | 3.903 | 0,25 |
| **Nissan Motor Acceptance Co. LLC** | | | | |
| 1,050 % fällig am 08.03.2024 | | 1.800 | 1.690 | 0,11 |
| 2,650 % fällig am 13.07.2022 | | 500 | 500 | 0,03 |
| **NTT Finance Corp.** | | | | |
| 0,373 % fällig am 03.03.2023 | | 3.000 | 2.949 | 0,19 |
| **Santander Holdings USA, Inc.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 18.01.2023 | | 2.300 | 2.297 | 0,15 |
| 3,450 % fällig am 02.06.2025 | | 2.700 | 2.599 | 0,16 |
| **SBB Treasury Oyj** | | | | |
| 0,129 % fällig am 08.02.2024 | € | 2.500 | 2.154 | 0,14 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 1,319 % fällig am 14.10.2023 | $ | 3.500 | 3.475 | 0,22 |
| 1,822 % fällig am 23.11.2025 | | 2.600 | 2.410 | 0,15 |
| **Steas Funding DAC** | | | | |
| 7,230 % fällig am 17.03.2026 | | 4.000 | 3.750 | 0,24 |
| **Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.** | | | | |
| 0,800 % fällig am 12.09.2023 | | 3.100 | 2.998 | 0,19 |
| **Swedbank AB** | | | | |
| 3,356 % fällig am 04.04.2025 | | 4.000 | 3.933 | 0,25 |
| **Toronto-Dominion Bank** | | | | |
| 2,350 % fällig am 08.03.2024 | | 11.400 | 11.174 | 0,71 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 2,361 % fällig am 15.08.2023 | | 3.000 | 2.999 | 0,19 |
| 2,859 % fällig am 15.08.2023 | | 2.900 | 2.899 | 0,18 |
| 4,125 % fällig am 24.09.2025 | | 2.400 | 2.384 | 0,15 |
| 4,488 % fällig am 12.05.2026 | | 4.000 | 3.990 | 0,25 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | | 6.350 | 6.578 | 0,42 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 1,032 % fällig am 01.08.2022 | € | 2.600 | 2.720 | 0,17 |
| **Volkswagen Financial Services NV** | | | | |
| 1,125 % fällig am 18.09.2023 | £ | 600 | 705 | 0,04 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 20.12.2023 | | 900 | 1.067 | 0,07 |
| 3,908 % fällig am 25.04.2026 | $ | 2.700 | 2.659 | 0,17 |
| | | | 216.435 | 13,73 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **7-Eleven, Inc.** | | | | |
| 0,625 % fällig am 10.02.2023 | | 2.900 | 2.845 | 0,18 |
| **ASTM SpA** | | | | |
| 1,000 % fällig am 25.11.2026 | € | 2.500 | 2.297 | 0,15 |
| **Boeing Co.** | | | | |
| 1,167 % fällig am 04.02.2023 | $ | 3.500 | 3.461 | 0,22 |
| 1,950 % fällig am 01.02.2024 | | 3.500 | 3.389 | 0,21 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | |
| 3,137 % fällig am 15.11.2035 | | 504 | 383 | 0,02 |
| 3,469 % fällig am 15.04.2034 | | 2.400 | 1.956 | 0,12 |
| **CenterPoint Energy Resources Corp.** | | | | |
| 2,111 % fällig am 02.03.2023 | | 1.725 | 1.720 | 0,11 |
| **Chanel Ceres PLC** | | | | |
| 0,500 % fällig am 31.07.2026 | € | 4.300 | 4.122 | 0,26 |
| **CommonSpirit Health** | | | | |
| 1,547 % fällig am 01.10.2025 | $ | 2.900 | 2.678 | 0,17 |
| **Continental Resources, Inc.** | | | | |
| 2,268 % fällig am 15.11.2026 | | 2.900 | 2.577 | 0,16 |
| **CRH America, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 18.05.2025 | | 2.700 | 2.688 | 0,17 |
| **Daimler Finance North America LLC** | | | | |
| 0,750 % fällig am 01.03.2024 | | 2.000 | 1.902 | 0,12 |
| **Daimler Trucks Finance North America LLC** | | | | |
| 1,125 % fällig am 14.12.2023 | | 3.000 | 2.882 | 0,18 |
| 1,930 % fällig am 14.06.2023 | | 3.300 | 3.288 | 0,21 |
| 2,088 % fällig am 14.12.2023 | | 3.000 | 2.978 | 0,19 |
| 2,230 % fällig am 13.12.2024 | | 2.800 | 2.767 | 0,18 |
| **Danone S.A.** | | | | |
| 2,947 % fällig am 02.11.2026 | | 2.400 | 2.305 | 0,15 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 5,450 % fällig am 15.06.2023 | $ | 240 | $ 243 | 0,02 |
| **Elevance Health, Inc.** | | | | |
| 3,350 % fällig am 01.12.2024 | | 1.000 | 987 | 0,06 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | |
| 0,375 % fällig am 01.03.2023 | | 3.000 | 2.939 | 0,19 |
| **General Mills, Inc.** | | | | |
| 6,410 % fällig am 15.10.2022 | | 3.000 | 3.027 | 0,19 |
| **Hasbro, Inc.** | | | | |
| 3,550 % fällig am 19.11.2026 | | 2.800 | 2.679 | 0,17 |
| **Hyatt Hotels Corp.** | | | | |
| 2,563 % fällig am 01.10.2023 | | 3.000 | 2.995 | 0,19 |
| **Hyundai Capital America** | | | | |
| 1,000 % fällig am 17.09.2024 | | 3.000 | 2.787 | 0,18 |
| 1,150 % fällig am 10.11.2022 | | 3.500 | 3.475 | 0,22 |
| **Nissan Motor Co. Ltd.** | | | | |
| 3,043 % fällig am 15.09.2023 | | 3.600 | 3.541 | 0,22 |
| **NXP BV** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.03.2024 | | 2.700 | 2.728 | 0,17 |
| **Panasonic Holdings Corp.** | | | | |
| 2,536 % fällig am 19.07.2022 | | 2.500 | 2.500 | 0,16 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | | |
| 1,700 % fällig am 15.06.2026 | | 3.300 | 2.946 | 0,19 |
| 4,875 % fällig am 11.07.2022 | | 700 | 700 | 0,04 |
| **Reliance Steel & Aluminum Co.** | | | | |
| 1,300 % fällig am 15.08.2025 | | 3.900 | 3.556 | 0,23 |
| **Renesas Electronics Corp.** | | | | |
| 2,170 % fällig am 25.11.2026 | | 2.800 | 2.500 | 0,16 |
| **SK Hynix, Inc.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 19.01.2024 | | 2.900 | 2.770 | 0,18 |
| **Southern Co.** | | | | |
| 0,600 % fällig am 26.02.2024 | | 3.000 | 2.841 | 0,18 |
| **Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 22.03.2023 | | 500 | 501 | 0,03 |
| **TD SYNNEX Corp.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 09.08.2024 | | 4.300 | 4.017 | 0,25 |
| **VMware, Inc.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 15.08.2024 | | 2.700 | 2.528 | 0,16 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 12.05.2023 | | 3.300 | 3.277 | 0,21 |
| **WRKCo, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.03.2025 | | 2.700 | 2.679 | 0,17 |
| | | | 100.454 | 6,37 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **AES Corp.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 15.01.2026 | | 3.200 | 2.826 | 0,18 |
| **Atmos Energy Corp.** | | | | |
| 2,070 % fällig am 09.03.2023 | | 3.600 | 3.592 | 0,23 |
| **Constellation Energy Generation LLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 01.06.2025 | | 2.600 | 2.493 | 0,16 |
| **Enel Finance International NV** | | | | |
| 2,650 % fällig am 10.09.2024 | | 4.000 | 3.878 | 0,25 |
| **Eversource Energy** | | | | |
| 0,800 % fällig am 15.08.2025 | | 3.000 | 2.712 | 0,17 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | |
| 1,775 % fällig am 22.02.2023 | | 2.900 | 2.882 | 0,18 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | | |
| 1,367 % fällig am 10.03.2023 | | 3.000 | 2.955 | 0,19 |
| 3,150 % fällig am 01.01.2026 | | 3.300 | 3.026 | 0,19 |
| 3,400 % fällig am 15.08.2024 ^ | | 500 | 481 | 0,03 |
| 3,850 % fällig am 15.11.2023 ^ | | 1.000 | 987 | 0,06 |
| 4,250 % fällig am 01.08.2023 | | 3.100 | 3.084 | 0,19 |
| 4,950 % fällig am 08.06.2025 | | 2.500 | 2.454 | 0,16 |
| **SSE PLC** | | | | |
| 1,250 % fällig am 16.04.2025 | € | 2.200 | 2.220 | 0,14 |
| | | | 33.590 | 2,13 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 350.479 | 22,23 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.04.2040 (b)(c) | $ | 155 | 128 | 0,01 |
| 1,000 % fällig am 25.01.2043 | | 68 | 61 | 0,00 |
| 1,001 % fällig am 25.07.2037 | | 18 | 17 | 0,00 |
| 1,523 % fällig am 01.06.2043 | | 23 | 24 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| 1,524 % fällig am 01.07.2042 | $ | 21 | $ | 21 | 0,00 |
| 1,574 % fällig am 01.09.2041 | | 53 | | 54 | 0,00 |
| 1,765 % fällig am 01.01.2035 | | 4 | | 4 | 0,00 |
| 1,867 % fällig am 01.12.2034 | | 19 | | 19 | 0,00 |
| 1,872 % fällig am 01.12.2034 | | 3 | | 3 | 0,00 |
| 1,906 % fällig am 01.01.2035 | | 6 | | 6 | 0,00 |
| 1,952 % fällig am 01.07.2035 | | 2 | | 2 | 0,00 |
| 1,974 % fällig am 25.12.2036 - 25.03.2044 | | 1.718 | | 1.709 | 0,11 |
| 1,978 % fällig am 01.01.2035 | | 19 | | 18 | 0,00 |
| 2,032 % fällig am 01.08.2035 | | 113 | | 117 | 0,01 |
| 2,034 % fällig am 25.09.2035 | | 145 | | 144 | 0,01 |
| 2,352 % fällig am 01.05.2038 | | 678 | | 699 | 0,04 |
| 2,550 % fällig am 01.03.2035 | | 1 | | 1 | 0,00 |
| **Freddie Mac** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.05.2037 (b)(c) | | 62 | | 56 | 0,00 |
| 0,650 % fällig am 22.10.2025 | | 23.500 | | 21.586 | 1,37 |
| 0,680 % fällig am 06.08.2025 | | 11.300 | | 10.514 | 0,67 |
| 0,800 % fällig am 28.10.2026 | | 7.000 | | 6.291 | 0,40 |
| 1,524 % fällig am 25.02.2045 | | 72 | | 73 | 0,01 |
| 1,644 % fällig am 15.02.2037 | | 19 | | 19 | 0,00 |
| 1,774 % fällig am 15.09.2041 | | 5 | | 5 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 15.11.2026 - 01.12.2034 | | 1.635 | | 1.617 | 0,10 |
| 2,021 % fällig am 01.09.2035 | | 67 | | 69 | 0,00 |
| 2,150 % fällig am 01.01.2035 | | 10 | | 10 | 0,00 |
| 2,789 % fällig am 01.07.2035 | | 13 | | 13 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.07.2043 | | 85 | | 92 | 0,01 |
| **Ginnie Mae** | | | | | |
| 0,898 % fällig am 20.06.2065 | | 1.518 | | 1.507 | 0,10 |
| 1,047 % fällig am 20.07.2067 | | 5.819 | | 5.804 | 0,37 |
| 1,503 % fällig am 20.10.2065 | | 17 | | 17 | 0,00 |
| 1,603 % fällig am 20.05.2066 | | 1.349 | | 1.343 | 0,09 |
| 1,703 % fällig am 20.04.2066 | | 2.109 | | 2.102 | 0,13 |
| 1,853 % fällig am 20.02.2062 | | 21 | | 21 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 20.06.2027 | | 12 | | 12 | 0,00 |
| 2,053 % fällig am 20.08.2070 | | 2.746 | | 2.795 | 0,18 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.02.2052 | | 19.195 | | 17.920 | 1,14 |
| 3,500 % fällig am 01.07.2047 | | 32.651 | | 31.937 | 2,03 |
| 4,000 % fällig am 01.10.2047 | | 23 | | 23 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 01.02.2025 - 01.10.2031 | | 770 | | 791 | 0,05 |
| 5,500 % fällig am 01.02.2027 - 01.03.2028 | | 0 | | 0 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 01.01.2023 - 01.01.2041 | | 1.045 | | 1.144 | 0,07 |
| 6,500 % fällig am 01.12.2035 - 01.01.2036 | | 12 | | 13 | 0,00 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.07.2052 | | 6.100 | | 5.683 | 0,36 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2052 | | 4.100 | | 3.940 | 0,25 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2052 | | 17.000 | | 16.740 | 1,06 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2052 | | 27.800 | | 27.853 | 1,77 |
| | | | | 163.017 | 10,34 |

## US-SCHATZOBLIGATIONEN

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **U.S. Treasury Notes** | | | | | |
| 0,875 % fällig am 31.01.2024 | | 244.100 | | 236.243 | 14,99 |
| 1,500 % fällig am 29.02.2024 | | 190.000 | | 185.540 | 11,77 |
| 2,875 % fällig am 15.05.2032 | | 1.800 | | 1.780 | 0,11 |
| | | | | 423.563 | 26,87 |

## NON-AGENCY-MBS

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | | | |
| 4,086 % fällig am 25.02.2045 | | 0 | | 0 | 0,00 |
| **Avon Finance PLC** | | | | | |
| 1,690 % fällig am 20.09.2048 | £ | 2.018 | | 2.439 | 0,15 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | | | |
| 2,560 % fällig am 25.08.2034 | $ | 314 | | 313 | 0,02 |
| 3,538 % fällig am 25.07.2034 | | 15 | | 14 | 0,00 |
| **Barclays Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | | |
| 2,174 % fällig am 15.08.2036 | | 4.600 | | 4.510 | 0,29 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | | |
| 2,086 % fällig am 25.01.2034 | | 7 | | 7 | 0,00 |
| 3,899 % fällig am 25.07.2034 | | 126 | | 117 | 0,01 |
| 4,570 % fällig am 25.01.2035 | | 8 | | 7 | 0,00 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.02.2034 | | 55 | | 51 | 0,00 |
| 2,838 % fällig am 25.12.2033 | | 30 | | 29 | 0,00 |
| **Citigroup Commercial Mortgage Trust** | | | | | |
| 3,024 % fällig am 10.09.2045 | $ | 281 | $ | 281 | 0,02 |
| **Citigroup Global Markets Mortgage Securities, Inc.** | | | | | |
| 7,000 % fällig am 25.12.2018 | | 1 | | 1 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,470 % fällig am 25.10.2035 | | 17 | | 16 | 0,00 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.10.2033 | | 10 | | 10 | 0,00 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | | |
| 2,520 % fällig am 20.02.2035 | | 10 | | 10 | 0,00 |
| 2,711 % fällig am 25.11.2034 | | 35 | | 34 | 0,00 |
| **DBGS Mortgage Trust** | | | | | |
| 2,119 % fällig am 15.06.2033 | | 2.800 | | 2.705 | 0,17 |
| **Eurosail PLC** | | | | | |
| 2,540 % fällig am 13.06.2045 | £ | 4.846 | | 5.791 | 0,37 |
| **FirstMac Mortgage Funding Trust** | | | | | |
| 1,860 % fällig am 08.03.2049 | AUD | 1.015 | | 697 | 0,04 |
| 2,110 % fällig am 08.03.2049 | | 8.000 | | 5.500 | 0,35 |
| **Formentera Issuer PLC** | | | | | |
| 1,348 % fällig am 28.07.2047 | £ | 3.031 | | 3.617 | 0,23 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | | |
| 2,193 % fällig am 18.06.2039 | $ | 662 | | 650 | 0,04 |
| **GS Mortgage Securities Trust** | | | | | |
| 2,773 % fällig am 10.11.2045 | | 2.862 | | 2.857 | 0,18 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,938 % fällig am 25.09.2035 | | 89 | | 87 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2032 | | 0 | | 0 | 0,00 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,703 % fällig am 25.05.2053 | £ | 8.383 | | 10.162 | 0,64 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,104 % fällig am 25.04.2035 | $ | 287 | | 253 | 0,02 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | | |
| 1,906 % fällig am 15.10.2045 (a) | | 2.756 | | 0 | 0,00 |
| 2,840 % fällig am 15.12.2047 | | 2.493 | | 2.487 | 0,16 |
| **Morgan Stanley Capital Trust** | | | | | |
| 2,224 % fällig am 15.07.2035 | | 4.260 | | 4.134 | 0,26 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,550 % fällig am 25.10.2034 | | 353 | | 343 | 0,02 |
| **MortgageIT Trust** | | | | | |
| 2,264 % fällig am 25.02.2035 | | 79 | | 78 | 0,01 |
| **Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | | |
| 2,184 % fällig am 25.12.2035 | | 314 | | 298 | 0,02 |
| **Pepper Residential Securities Trust** | | | | | |
| 2,193 % fällig am 16.09.2059 | AUD | 1.561 | | 1.071 | 0,07 |
| **Prime Mortgage Trust** | | | | | |
| 2,024 % fällig am 25.02.2034 | $ | 2 | | 2 | 0,00 |
| **Primrose Residential DAC** | | | | | |
| 0,238 % fällig am 24.03.2061 | € | 3.234 | | 3.334 | 0,21 |
| **Ripon Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,351 % fällig am 28.08.2056 | £ | 5.585 | | 6.716 | 0,43 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | | | |
| 2,015 % fällig am 20.06.2036 | $ | 276 | | 263 | 0,02 |
| 2,395 % fällig am 20.10.2027 | | 2 | | 2 | 0,00 |
| **Stratton Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2060 | £ | 3.422 | | 4.123 | 0,26 |
| 1,853 % fällig am 25.05.2051 | | 1.680 | | 2.042 | 0,13 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 3,032 % fällig am 25.01.2035 | $ | 153 | | 152 | 0,01 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | | |
| 2,095 % fällig am 19.07.2035 | | 17 | | 15 | 0,00 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | | | |
| 2,304 % fällig am 25.04.2043 | | 0 | | 0 | 0,00 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2045 | £ | 5.694 | | 6.905 | 0,44 |
| 1,527 % fällig am 20.05.2045 | | 5.928 | | 7.171 | 0,46 |
| 1,605 % fällig am 20.10.2051 | | 3.188 | | 3.859 | 0,24 |
| **Trinity Square PLC** | | | | | |
| 1,300 % fällig am 15.07.2059 | | 2.578 | | 3.111 | 0,20 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | | |
| 1,902 % fällig am 12.06.2053 | | 2.480 | | 3.013 | 0,19 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | | |
| 1,876 % fällig am 25.06.2042 | $ | 4 | | 4 | 0,00 |
| 2,304 % fällig am 25.01.2045 | | 484 | | 463 | 0,03 |
| **Warwick Finance Residential Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,742 % fällig am 21.12.2049 | £ | 1.198 | | 1.454 | 0,09 |
| **Wells Fargo Commercial Mortgage Trust** | | | | | |
| 1,768 % fällig am 15.10.2045 (a) | $ | 648 | $ | 0 | 0,00 |
| **Wells Fargo-RBS Commercial Mortgage Trust** | | | | | |
| 3,995 % fällig am 15.05.2047 | | 4.300 | | 4.248 | 0,27 |
| | | | | 95.446 | 6,06 |

## FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | | |
| 2,644 % fällig am 25.10.2034 | | 1.607 | | 1.590 | 0,10 |
| **Apidos CLO** | | | | | |
| 2,073 % fällig am 20.04.2031 | | 2.800 | | 2.751 | 0,17 |
| **Ares European CLO DAC** | | | | | |
| 0,850 % fällig am 20.04.2032 | € | 3.100 | | 3.157 | 0,20 |
| **Avoca CLO DAC** | | | | | |
| 0,820 % fällig am 15.10.2032 | | 3.000 | | 3.059 | 0,19 |
| **Black Diamond CLO DAC** | | | | | |
| 0,980 % fällig am 15.05.2032 | | 2.700 | | 2.758 | 0,18 |
| **BlueMountain Fuji EUR CLO DAC** | | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.01.2031 | | 2.400 | | 2.445 | 0,16 |
| **BNPP AM Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,820 % fällig am 22.07.2032 | | 3.000 | | 3.044 | 0,19 |
| **Bridgepoint CLO DAC** | | | | | |
| 1,210 % fällig am 15.01.2034 | | 3.400 | | 3.493 | 0,22 |
| **Cairn CLO DAC** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 20.10.2028 | | 1.057 | | 1.098 | 0,07 |
| **Carbone CLO Ltd.** | | | | | |
| 2,203 % fällig am 20.01.2031 | $ | 3.630 | | 3.561 | 0,23 |
| **Carlyle Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,700 % fällig am 15.01.2031 | € | 2.200 | | 2.247 | 0,14 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.11.2031 | | 2.600 | | 2.670 | 0,17 |
| **Catamaran CLO Ltd.** | | | | | |
| 2,236 % fällig am 22.04.2030 | $ | 3.482 | | 3.437 | 0,22 |
| **CIFC Funding Ltd.** | | | | | |
| 1,863 % fällig am 20.01.2028 | | 1.632 | | 1.614 | 0,10 |
| 2,224 % fällig am 16.11.2030 | | 2.250 | | 2.219 | 0,14 |
| 2,234 % fällig am 24.04.2030 | | 3.000 | | 2.963 | 0,19 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | | |
| 2,674 % fällig am 25.11.2034 | | 643 | | 639 | 0,04 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | | |
| 2,244 % fällig am 25.01.2032 | | 9 | | 8 | 0,00 |
| **Fortress Investment Group LLC** | | | | | |
| 2,753 % fällig am 23.02.2039 | | 7.200 | | 7.110 | 0,45 |
| **Gallatin CLO Ltd.** | | | | | |
| 2,148 % fällig am 21.01.2028 | | 2.020 | | 2.004 | 0,13 |
| **GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC** | | | | | |
| 0,900 % fällig am 20.01.2032 | € | 2.500 | | 2.540 | 0,16 |
| **GoldenTree Loan Opportunities Ltd.** | | | | | |
| 2,183 % fällig am 20.07.2031 | $ | 2.650 | | 2.609 | 0,17 |
| 2,349 % fällig am 29.10.2029 | | 3.883 | | 3.839 | 0,24 |
| **Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.** | | | | | |
| 2,504 % fällig am 15.09.2037 | | 3.000 | | 2.959 | 0,19 |
| **Griffith Park CLO DAC** | | | | | |
| 0,720 % fällig am 21.11.2031 | € | 3.000 | | 3.071 | 0,19 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 26.06.2030 | | 2.970 | | 3.051 | 0,19 |
| **Jubilee CLO DAC** | | | | | |
| 0,610 % fällig am 15.04.2030 | | 4.000 | | 4.131 | 0,26 |
| **LoanCore Issuer Ltd.** | | | | | |
| 2,624 % fällig am 15.11.2038 | $ | 3.530 | | 3.395 | 0,22 |
| **Madison Park Euro Funding DAC** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.01.2032 | € | 2.700 | | 2.733 | 0,17 |
| **Madison Park Funding Ltd.** | | | | | |
| 1,794 % fällig am 15.04.2029 | $ | 3.888 | | 3.836 | 0,24 |
| **Marble Point CLO Ltd.** | | | | | |
| 2,224 % fällig am 18.12.2030 | | 3.600 | | 3.533 | 0,22 |
| **Mountain View CLO LLC** | | | | | |
| 2,134 % fällig am 16.10.2029 | | 1.844 | | 1.821 | 0,12 |
| **Nassau Ltd.** | | | | | |
| 2,194 % fällig am 15.10.2029 | | 2.810 | | 2.797 | 0,18 |
| **Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd.** | | | | | |
| 2,103 % fällig am 20.04.2031 | | 2.800 | | 2.731 | 0,17 |
| **Octagon Loan Funding Ltd.** | | | | | |
| 2,635 % fällig am 18.11.2031 | | 3.400 | | 3.336 | 0,21 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **OZLM Ltd.** | | | | |
| 2,336 % fällig am 30.04.2027 | $ | 136 | $ 136 | 0,01 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.10.2031 | € | 2.700 | 2.765 | 0,18 |
| 0,730 % fällig am 15.07.2031 | | 2.433 | 2.494 | 0,16 |
| **Regatta Funding Ltd.** | | | | |
| 2,294 % fällig am 17.10.2030 | $ | 4.600 | 4.547 | 0,29 |
| **Saranac CLO Ltd.** | | | | |
| 3,723 % fällig am 22.06.2030 | | 3.853 | 3.813 | 0,24 |
| **SLC Student Loan Trust** | | | | |
| 1,939 % fällig am 15.03.2027 | | 117 | 117 | 0,01 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 1,334 % fällig am 25.10.2029 | | 1.283 | 1.271 | 0,08 |
| **South Carolina Student Loan Corp.** | | | | |
| 2,580 % fällig am 03.09.2024 | | 124 | 124 | 0,01 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 2,599 % fällig am 25.10.2033 | | 48 | 47 | 0,00 |
| **TICP CLO Ltd.** | | | | |
| 1,903 % fällig am 20.04.2028 | | 1.290 | 1.278 | 0,08 |
| **Tikehau CLO BV** | | | | |
| 0,870 % fällig am 04.08.2034 | € | 2.300 | 2.344 | 0,15 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | |
| 0,810 % fällig am 15.02.2034 | | 3.200 | 3.233 | 0,21 |
| 0,920 % fällig am 12.01.2032 | | 2.500 | 2.539 | 0,16 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | |
| 2,163 % fällig am 20.01.2029 | $ | 2.892 | 2.864 | 0,18 |
| | | | 125.821 | 7,98 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 8,200 % fällig am 12.08.2026 | PEN | 17.000 | 4.679 | 0,30 |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 10,500 % fällig am 21.12.2026 | ZAR | 286.300 | $ 18.506 | 1,17 |
| | | | 23.185 | 1,47 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | | |
| **Southern Californi+a Edison Co.** | | | | |
| 1,840 % fällig am 02.12.2022 | $ | 2.800 | 2.794 | 0,18 |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | | |
| 51,049 % fällig am 30.09.2022 (c)(d) | ARS | 6.700 | 22 | 0,00 |
| **ISRAEL TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,020) % fällig am 07.12.2022 (c)(d) | ILS | 7.300 | 2.079 | 0,13 |
| (0,005) % fällig am 03.08.2022 (c)(d) | | 13.000 | 3.712 | 0,24 |
| (0,005) % fällig am 07.09.2022 (c)(d) | | 9.000 | 2.568 | 0,16 |
| (0,005) % fällig am 07.10.2022 (c)(d) | | 9.800 | 2.792 | 0,18 |
| 0,020 % fällig am 04.01.2023 (c)(d) | | 9.000 | 2.557 | 0,16 |
| 0,788 % fällig am 02.03.2023 (c)(d) | | 13.000 | 3.680 | 0,23 |
| 0,886 % fällig am 03.05.2023 (c)(d) | | 15.500 | 4.378 | 0,28 |
| | | | 21.766 | 1,38 |
| **JAPAN TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,135) % fällig am 19.07.2022 (c)(d) | ¥ | 2.094.800 | 15.421 | 0,98 |
| (0,094) % fällig am 12.09.2022 (c)(d) | ¥ | 1.100.000 | $ 8.099 | 0,51 |
| (0,085) % fällig am 04.07.2022 (c)(d) | | 2.185.600 | 16.088 | 1,02 |
| | | | 39.608 | 2,51 |
| ne kurzfristige Instrumente | | | 64.190 | 4,07 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **$1.245.701** | **79,02** |
| **INVESTMENTFONDS** | | **AKTIEN** | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (e)** | | 3.177.616 | 31.617 | 2,01 |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)** | | 7.064.336 | 70.276 | 4,46 |
| | | | 101.893 | 6,47 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (e)** | | 484.660 | 47.956 | 3,04 |
| **Summe Investmentfonds** | | | **$149.849** | **9,51** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende ErlöseausPensionsgeschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 3.583 | U,S, Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | $ (3.655) | $ 3.583 | $ 3.583 | 0,23 |
| MBC | 1,490 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 199.900 | U,S, Treasury Notes 0,750 % - 3,250 % fällig am 31.12.2023 - 30.06.2027 | (206.349) | 199.900 | 199.908 | 12,68 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (210.004 )** | **$ 203.483** | **$ 203.491** | **12,91** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 90-Day Eurodollar March Futures | Long | 03.2024 | 170 | $ (587) | (0,04) |
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09.2022 | 255 | 533 | 0,03 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09.2022 | 358 | (2.008) | (0,13) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 232 | 1.123 | 0,07 |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 42 | 193 | 0,01 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 1.051 | (874) | (0,05) |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 505 | 893 | 0,06 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 282 | (516) | (0,03) |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2022 | 240 | 568 | 0,04 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09.2022 | 123 | 611 | 0,04 |
| | | | | $ (64) | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ (64)** | **0,00** |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF(1)

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-38 5-Year Index | (5,000) % | 20.06.2027 | $ 41.580 | $ 11 | 0,00 |
| CDX.IG-38 5-Year Index | (1,000 ) | 20.06.2027 | 146.300 | 16 | 0,00 |
| | | | | $ 27 | 0,00 |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF(2)

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-35 5-Year Index | 1,000 % | 20.12.2025 | $ 200 | $ (2) | 0,00 |
| CDX.IG-36 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2026 | 1.000 | (20) | (0,01) |
| CDX.IG-37 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 1.500 | (15) | 0,00 |
| iTraxx Crossover 37 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2027 | 30.100 | (2.854) | (0,18) |
| | | | | $ (2.891) | (0,19) |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 % | 17.03.2024 | ¥ 5.680.000 | $ (133) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,380 | 18.06.2028 | 90.000 | (10) | 0,00 |
| Zahlung[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,400 | 07.12.2024 | $ 170.500 | (2.256) | (0,14) |
| Erhalt[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,050 | 23.06.2052 | 103.600 | (138) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,150 | 15.06.2027 | 18.500 | (466) | (0,03) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,200 | 15.06.2024 | 18.500 | (241) | (0,02) |
| Zahlung[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,130 | 21.06.2025 | 164.100 | 782 | 0,05 |
| Zahlung[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,175 | 24.03.2025 | 80.900 | 138 | 0,01 |
| Zahlung[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,530 | 21.06.2024 | 159.000 | 757 | 0,05 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,212 | 02.01.2025 | BRL 168.000 | (825) | (0,05) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,235 | 02.01.2025 | 69.100 | (104) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,316 | 04.01.2027 | 69.000 | (76) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,590 | 02.01.2025 | 2.500 | (1) | 0,00 |
| Zahlung[4] | 3-Month NZD-BBR | 4,000 | 14.06.2024 | NZD 225.600 | 169 | 0,01 |
| Zahlung[4] | 3-Month USD-LIBOR | 1,270 | 04.11.2023 | $ 94.400 | (418) | (0,03) |
| Zahlung[4] | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 4,500 | 20.06.2024 | AUD 74.100 | 278 | 0,02 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,580 | 24.05.2024 | € 144.500 | (498) | (0,03) |
| | | | | | $ (3.042) | (0,19) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (5.906)** | **(0,38)** |

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

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

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

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

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

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

### OPTIONSKAUF

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag(1) | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,770 % | 04.08.2022 | 4.600 | $ 42 | $ 71 | 0,00 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag(1) | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC AUD versus USD | $ 0,722 | 08.07.2022 | 10.280 | $ (53) | $ (1) | 0,00 |
| BRC | Call - OTC AUD versus USD | 0,738 | 11.08.2022 | 3.800 | (22) | (2) | 0,00 |
| DUB | Call - OTC USD versus BRL | BRL 5,720 | 12.08.2022 | 18.130 | (298) | (104) | (0,01) |
| | | | | | $ (373) | $ (107) | (0,01) |

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag(1) | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,088 % | 03.11.2023 | 26.600 | $ (193) | $ (215) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,088 | 03.11.2023 | 26.600 | (193) | (132) | (0,01) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 17.11.2023 | 40.700 | (148) | (170) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 17.11.2023 | 40.700 | (148) | (125) | (0,01) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 07.12.2023 | 14.800 | (46) | (65) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 07.12.2023 | 14.800 | (46) | (46) | 0,00 |
| MYC | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,993 | 11.10.2023 | 53.500 | (361) | (390) | (0,03) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,993 | 11.10.2023 | 53.500 | (361) | (287) | (0,02) |
| | | | | | | | $ (1.496) | $ (1.430) | (0,09) |

### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag(1) | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | $ 99,141 | 07.07.2022 | 2.409 | $ (17) | $ (15) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,000 % fällig am 01.08.2052 | 97,625 | 04.08.2022 | 7.700 | (43) | (35) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,000 % fällig am 01.08.2052 | 97,820 | 04.08.2022 | 15.000 | (91) | (77) | (0,01) |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.08.2052 | 99,367 | 04.08.2022 | 7.400 | (46) | (27) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.08.2052 | 100,313 | 04.08.2022 | 9.200 | (29) | (66) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.08.2052 | 99,828 | 04.08.2022 | 3.800 | (10) | (19) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,156 | 07.09.2022 | 3.700 | (13) | (24) | 0,00 |
| MSC | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 3,000 % fällig am 01.08.2052 | 92,656 | 04.08.2022 | 3.100 | (27) | (23) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 3,000 % fällig am 01.08.2052 | 93,098 | 04.08.2022 | 11.200 | (88) | (105) | (0,01) |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,000 % fällig am 01.08.2052 | 98,344 | 04.08.2022 | 15.100 | (74) | (107) | (0,01) |
| SAL | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 3,500 % fällig am 01.07.2052 | 96,000 | 07.07.2022 | 7.500 | (39) | (18) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 97,305 | 07.07.2022 | 8.700 | (54) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 99,156 | 07.07.2022 | 4.291 | (31) | (27) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 99,078 | 07.07.2022 | 3.900 | (19) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.08.2052 | 99,773 | 04.08.2022 | 15.000 | (40) | (74) | (0,01) |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,000 % fällig am 01.08.2052 | 100,938 | 04.08.2022 | 22.500 | (70) | (63) | 0,00 |
| | | | | | $ (691) | $ (683) | (0,04) |

(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 | South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2026 | $ 2.000 | $ (94) | $ (64) | $ (158) | (0,01) |
| CBK | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 5.600 | (270) | (173) | (443) | (0,03) |
| MYC | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 4.300 | (243) | (114) | (357) | (0,02) |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 4.200 | (195) | (137) | (332) | (0,02) |
| | | | | | $ (802) | $ (488) | $ (1.290) | (0,08) |

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

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

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | ¥ 2.185.600 | $ 17.963 | $ 1.874 | $ 0 | $ 1.874 | 0,12 |
| | 07.2022 | ZAR 100.108 | 6.524 | 419 | 0 | 419 | 0,03 |
| | 08.2022 | € 3.033 | 3.269 | 89 | 0 | 89 | 0,01 |
| | 08.2022 | £ 237 | 295 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ 43.700 | 324 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 1.815 | BRL 9.598 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | 781 | € 736 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 08.2022 | 1.368 | ¥ 181.400 | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| | 08.2022 | 2.135 | NOK 20.324 | 0 | (76) | (76) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 11.2022 | PEN | 22.466 | $ | 5.432 | $ 0 | $ (402) | $ (402) | (0,03) |
| BPS | 07.2022 | AUD | 38.751 | | 26.885 | 238 | 0 | 238 | 0,01 |
| | 07.2022 | MXN | 1.089 | | 52 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 54 | MXN | 1.089 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 6.214 | $ | 397 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 923 | € | 858 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| | 09.2022 | ¥ | 505.000 | $ | 3.780 | 45 | 0 | 45 | 0,00 |
| | 09.2022 | MXN | 1.089 | | 53 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 08.2022 | $ | 1.081 | € | 1.032 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.471 | NOK | 14.397 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 09.2022 | ¥ | 595.000 | $ | 4.453 | 53 | 0 | 53 | 0,00 |
| CBK | 08.2022 | £ | 2.483 | | 3.142 | 124 | 0 | 124 | 0,01 |
| | 08.2022 | ILS | 13.001 | | 4.057 | 340 | 0 | 340 | 0,02 |
| | 08.2022 | NZD | 586 | | 366 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 1.815 | BRL | 9.596 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 10.2022 | ILS | 9.800 | $ | 3.057 | 240 | 0 | 240 | 0,01 |
| | 12.2022 | | 7.301 | | 2.367 | 258 | 0 | 258 | 0,02 |
| | 01.2023 | | 8.998 | | 2.848 | 244 | 0 | 244 | 0,02 |
| | 03.2023 | | 12.934 | | 3.921 | 164 | 0 | 164 | 0,01 |
| | 05.2023 | | 15.370 | | 4.658 | 176 | 0 | 176 | 0,01 |
| DUB | 08.2022 | BRL | 19.232 | | 3.630 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 89.841 | | 95.398 | 1.202 | 0 | 1.202 | 0,08 |
| | 08.2022 | £ | 55.235 | | 68.135 | 1.004 | 0 | 1.004 | 0,06 |
| | 12.2022 | ZAR | 138.225 | | 8.798 | 495 | 0 | 495 | 0,03 |
| HUS | 07.2022 | AUD | 1.232 | | 890 | 43 | 0 | 43 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 23.981 | AUD | 34.821 | 0 | (37) | (37) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 34.821 | $ | 23.984 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 38.547 | | 5.740 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 1.586.500 | | 11.833 | 124 | 0 | 124 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 6.116 | £ | 5.055 | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| | 05.2023 | CNH | 23.846 | $ | 3.553 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| JPM | 08.2022 | | 16.946 | | 2.520 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 1.184 | | 1.241 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 83.165 | | 637 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | 08.2022 | NOK | 41.895 | | 4.206 | 0 | (38) | (38) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 1.130 | £ | 925 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 09.2022 | ILS | 9.000 | $ | 2.828 | 246 | 0 | 246 | 0,02 |
| MYI | 07.2022 | € | 86 | | 91 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 12 | € | 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 67 | £ | 56 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 888 | CNY | 5.965 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| RBC | 07.2022 | ¥ | 2.094.800 | $ | 16.735 | 1.303 | 0 | 1.303 | 0,08 |
| | 08.2022 | NZD | 256 | | 167 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | $ | 10.451 | ¥ | 1.422.760 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 68.377 | $ | 10.207 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 1.420.453 | | 10.451 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 08.2022 | NZD | 886 | | 556 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 1.427 | CNY | 9.548 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 09.2022 | ZAR | 126.048 | $ | 8.153 | 513 | 0 | 513 | 0,03 |
| SOG | 08.2022 | $ | 2.261 | NOK | 22.172 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | | 3.687 | AUD | 5.162 | 0 | (138) | (138) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 935 | ZAR | 15.038 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | | | | | | $ 9.361 | $ (863) | $ 8.498 | 0,54 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | € | 5 | $ | 5 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | | 21.519 | | 22.634 | 136 | 0 | 136 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 639 | € | 599 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 22.605 | | 21.452 | 0 | (136) | (136) | (0,01) |
| CBK | 07.2022 | € | 1.801 | $ | 1.934 | 51 | 0 | 51 | 0,00 |
| HUS | 07.2022 | | 21.640 | | 22.765 | 142 | 0 | 142 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 26.205 | € | 24.358 | 0 | (740) | (740) | (0,05) |
| | 08.2022 | | 22.609 | | 21.452 | 0 | (140) | (140) | (0,01) |
| SOG | 07.2022 | | 22.808 | | 21.221 | 0 | (623) | (623) | (0,04) |
| UAG | 07.2022 | | 19.366 | | 18.022 | 0 | (525) | (525) | (0,03) |
| | | | | | | $ 329 | $ (2.176) | $ (1.847) | (0,12) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | $ 8.296 | £ 6.562 | $ 0 | $ (328) | $ (328) | (0,02) |
| BPS | 07.2022 | 181 | 144 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | 8.404 | 6.668 | 0 | (306) | (306) | (0,02) |
| CBK | 07.2022 | 52 | 42 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| HUS | 07.2022 | 63 | 51 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | £ 6.594 | $ 8.024 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 8.028 | £ 6.594 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | 8.240 | 6.536 | 0 | (302) | (302) | (0,02) |
| | | | | $ 17 | $ (961) | $ (944) | (0,06) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **$ 2.268** | **0,14** |

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.07.2052 (f) | $ 61.600 | $ (57.389) | (3,64) |
| 3,500 % fällig am 01.08.2052 (f) | 35.100 | (33.726) | (2,14) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (91.115)** | **(5,78)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 1.504.216** | **95,42** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ 72.220** | **4,58** |
| **Nettovermögen** | | **$ 1.576.436** | **100,00** |

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

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

**^** **Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a)** **Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

**(b)** **Reines Kapitalwertpapier.**

**(c)** **Nullkuponwertpapier.**

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

**(e)** **Mit dem Fonds verbunden.**

**(f)** **Zum 30. Juni 2022 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.**

**(g)** **Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeits-datum | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Citigroup, Inc. | 1,669 % | 25.01.2026 | 18.01.2022 | $ 2.900 | $ 2.802 | 0,18 |
| Citigroup, Inc. | 2,014 | 25.01.2026 | 18.01.2022 | 2.900 | 2.720 | 0,17 |
| Citigroup, Inc. | 3,290 | 17.03.2026 | 10.03.2022 | 4.000 | 3.872 | 0,24 |
| | | | | $ 9.800 | $ 9.394 | 0,59 |

**Barmittel in Höhe von USD 18.873 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 4.481 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 1.245.701 | $ 0 | $ 1.245.701 |
| Investmentfonds | 101.893 | 47.956 | 0 | 149.849 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 203.483 | 0 | 203.483 |
| Finanzderivate[3] | 452 | (4.154) | 0 | (3.702) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (91.115) | 0 | (91.115) |
| **Summen** | **$ 102.345** | **$ 1.401.871** | **$ 0** | **$ 1.504.216** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 1.057.626 | $ 0 | $ 1.057.626 |
| Investmentfonds | 113.421 | 0 | 0 | 113.421 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 24.177 | 0 | 24.177 |
| Finanzderivate[3] | 444 | (3.896) | 0 | (3.452) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (38.058) | 0 | (38.058) |
| **Summen** | **$ 113.865** | **$ 1.039.849** | **$ 0** | **$ 1.153.714** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 1.236 | $ (1.190) | $ 46 |
| BPS | 258 | (270) | (12) |
| BRC | (267) | 300 | 33 |
| CBK | 1.151 | (790) | 361 |
| DUB | 2.595 | (2.380 | 215 |
| GLM | (753) | 931 | 178 |
| HUS | (563) | 0 | (563) |
| JPM | 176 | 0 | 176 |
| MBC | 0 | 280 | 280 |
| MSC | (235) | 350 | 115 |
| MYC | (1.366) | 660 | (706) |
| MYI | 2 | 0 | 2 |
| RBC | 1.311 | (1.390) | (79) |
| SAL | (185) | 460 | 275 |
| SCX | 529 | (470) | 59 |
| SOG | (638) | 670 | 32 |
| TOR | (302) | 310 | 8 |
| UAG | (681) | 520 | (161) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 47,80 | 44,41 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 28,96 | 45,03 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 2,26 | 0,25 |
| Investmentfonds | 9,51 | 9,62 |
| Pensionsgeschäfte | 12,91 | 2,05 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,00 | (0,08) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,38) | (0,12) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,14 | (0,09) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (5,78) | (3,23) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 22,23 | 32,21 |
| US-Regierungsbehörden | 10,34 | 11,35 |
| US-Schatzobligationen | 26,87 | 4,05 |
| Non-Agency-MBS | 6,06 | 6,41 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 7,98 | 5,91 |
| Staatsemissionen | 1,47 | 0,41 |
| Kurzfristige Instrumente | 4,07 | 29,35 |
| Investmentfonds | 9,51 | 9,62 |
| Pensionsgeschäfte | 12,91 | 2,05 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,00 | (0,08) |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | k. A. | 0,00 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | 0,00 | k. A. |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,19) | 0,00 |
| Zinsswaps | (0,19) | (0,12) |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoptionen | 0,00 | k. A. |
| Verkaufsoptionen | | |
| Devisenoptionen | (0,01) | k. A. |
| Zinsswapoptionen | (0,09) | (0,03) |
| Optionen auf Wertpapiere | (0,04) | k. A. |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,08) | k. A. |
| Devisenterminkontrakte | 0,54 | (0,15) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (0,18) | 0,09 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (5,78) | (3,23) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 4,58 | 2,16 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Caesars Resort Collection LLC** | | | | |
| 5,166 % fällig am 21.07.2025 | $ | 98 | $ 95 | 0,01 |
| **Carnival Corp.** | | | | |
| 5,877 % fällig am 30.06.2025 | | 695 | 648 | 0,10 |
| **Delos Finance SARL** | | | | |
| 4,000 % fällig am 06.10.2023 | | 420 | 416 | 0,06 |
| **FinCo LLC** | | | | |
| 4,166 % fällig am 27.06.2025 | | 197 | 188 | 0,03 |
| **RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,416 % fällig am 16.11.2025 | | 2.500 | 2.338 | 0,34 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | | |
| 4,416 % fällig am 15.03.2024 | | 246 | 242 | 0,04 |
| | | | 3.927 | 0,58 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **Aegon Bank NV** | | | | |
| 0,625 % fällig am 21.06.2024 | € | 3.300 | 3.341 | 0,49 |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 1,150 % fällig am 29.10.2023 | $ | 1.700 | 1.621 | 0,24 |
| 2,875 % fällig am 14.08.2024 | | 700 | 667 | 0,10 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 02.10.2023 | | 500 | 484 | 0,07 |
| **American Express Co.** | | | | |
| 1,896 % fällig am 01.08.2022 | | 3.200 | 3.200 | 0,47 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 1,300 % fällig am 15.09.2025 | | 2.000 | 1.813 | 0,27 |
| 1,450 % fällig am 15.09.2026 | | 4.000 | 3.502 | 0,52 |
| 3,650 % fällig am 15.03.2027 | | 900 | 855 | 0,13 |
| **Ares Capital Corp.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.06.2027 | | 800 | 668 | 0,10 |
| **Assurant, Inc.** | | | | |
| 4,200 % fällig am 27.09.2023 | | 1.125 | 1.133 | 0,17 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 17.10.2022 | € | 152 | 158 | 0,02 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 30.01.2024 | $ | 800 | 786 | 0,12 |
| 5,500 % fällig am 15.12.2024 | | 700 | 694 | 0,10 |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | |
| 2,528 % fällig am 18.11.2027 | | 1.896 | 1.547 | 0,23 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 1,875 % fällig am 09.01.2026 | € | 900 | 788 | 0,12 |
| 2,625 % fällig am 28.04.2025 | | 500 | 464 | 0,07 |
| 3,625 % fällig am 24.09.2024 | | 4.100 | 3.966 | 0,58 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 0,875 % fällig am 18.09.2023 | $ | 1.400 | 1.351 | 0,20 |
| **Banco Bradesco S.A.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 27.01.2023 | | 700 | 697 | 0,10 |
| **Banco BTG Pactual S.A.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 10.01.2025 | | 500 | 482 | 0,07 |
| 5,500 % fällig am 31.01.2023 | | 1.500 | 1.506 | 0,22 |
| **Banco de Sabadell S.A.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 10.05.2024 | € | 500 | 506 | 0,07 |
| **Banco Santander Chile** | | | | |
| 2,700 % fällig am 10.01.2025 | $ | 500 | 479 | 0,07 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 14.04.2026 | £ | 1.700 | 1.859 | 0,27 |
| **BanColombia S.A.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 29.01.2025 | $ | 300 | 277 | 0,04 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 1,949 % fällig am 27.10.2026 | € | 600 | 608 | 0,09 |
| 2,375 % fällig am 19.06.2024 | | 10.200 | 10.690 | 1,59 |
| **Bank of China Luxembourg S.A.** | | | | |
| 0,125 % fällig am 16.01.2023 | | 1.300 | 1.354 | 0,20 |
| **Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT** | | | | |
| 4,625 % fällig am 20.07.2023 | $ | 700 | 704 | 0,10 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (g) | | 1.391 | 1.405 | 0,21 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 2,791 % fällig am 16.05.2024 | | 709 | 709 | 0,10 |
| 3,375 % fällig am 02.04.2025 | € | 400 | 422 | 0,06 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (e)(g) | £ | 600 | 718 | 0,11 |
| **BBVA Bancomer S.A.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 10.04.2024 | $ | 200 | $ 199 | 0,03 |
| 6,750 % fällig am 30.09.2022 | | 3.627 | 3.639 | 0,54 |
| **Blackstone Private Credit Fund** | | | | |
| 2,350 % fällig am 22.11.2024 | | 900 | 828 | 0,12 |
| 4,700 % fällig am 24.03.2025 | | 700 | 673 | 0,10 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 2,219 % fällig am 09.06.2026 | | 1.500 | 1.387 | 0,20 |
| 3,800 % fällig am 10.01.2024 | | 500 | 497 | 0,07 |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 18.09.2022 | | 1.700 | 1.699 | 0,25 |
| 3,500 % fällig am 31.01.2023 | | 200 | 200 | 0,03 |
| 3,500 % fällig am 10.10.2024 | | 1.000 | 989 | 0,15 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 1,652 % fällig am 06.10.2026 | | 300 | 269 | 0,04 |
| **Canadian Imperial Bank of Commerce** | | | | |
| 1,856 % fällig am 14.12.2023 | | 700 | 695 | 0,10 |
| **Cantor Fitzgerald LP** | | | | |
| 4,500 % fällig am 14.04.2027 | | 600 | 577 | 0,09 |
| **Capital One Financial Corp.** | | | | |
| 4,166 % fällig am 09.05.2025 | | 300 | 296 | 0,04 |
| **Charles Schwab Corp.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 18.03.2024 | | 600 | 576 | 0,08 |
| 2,006 % fällig am 18.03.2024 | | 1.500 | 1.488 | 0,22 |
| **China Construction Bank Europe S.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 28.06.2024 (c) | € | 2.800 | 2.822 | 0,42 |
| **CIFI Holdings Group Co. Ltd.** | | | | |
| 6,450 % fällig am 07.11.2024 | $ | 300 | 193 | 0,03 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 2,014 % fällig am 25.01.2026 (h) | | 2.000 | 1.876 | 0,28 |
| 3,290 % fällig am 17.03.2026 (h) | | 3.200 | 3.098 | 0,46 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 2,625 % fällig am 22.07.2024 | | 700 | 678 | 0,10 |
| **Corebridge Financial, Inc.** | | | | |
| 3,650 % fällig am 05.04.2027 | | 1.800 | 1.694 | 0,25 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 12.07.2026 | | 200 | 94 | 0,01 |
| 3,125 % fällig am 22.10.2025 | | 1.700 | 837 | 0,12 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 12.05.2026 | € | 700 | 652 | 0,10 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 24.06.2024 | | 2.300 | 2.329 | 0,34 |
| 3,173 % fällig am 22.03.2024 | $ | 2.600 | 2.609 | 0,38 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (g) | | 400 | 401 | 0,06 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 3,800 % fällig am 09.06.2023 | | 400 | 396 | 0,06 |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.09.2022 | | 4.150 | 4.154 | 0,61 |
| **Cromwell Ereit Lux Finco SARL** | | | | |
| 2,125 % fällig am 19.11.2025 | € | 1.600 | 1.369 | 0,20 |
| **CTP NV** | | | | |
| 0,500 % fällig am 21.06.2025 | | 100 | 89 | 0,01 |
| **DAE Sukuk Difc Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.02.2026 | $ | 700 | 663 | 0,10 |
| **Danske Bank A/S** | | | | |
| 2,781 % fällig am 12.09.2023 | | 2.100 | 2.102 | 0,31 |
| **Dell Bank International DAC** | | | | |
| 0,500 % fällig am 27.10.2026 | € | 3.300 | 3.128 | 0,46 |
| 0,625 % fällig am 17.10.2022 | | 2.000 | 2.092 | 0,31 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 1,447 % fällig am 01.04.2025 (h) | $ | 1.600 | 1.496 | 0,22 |
| 2,129 % fällig am 24.11.2026 (h) | | 500 | 445 | 0,07 |
| 2,601 % fällig am 16.11.2022 | | 1.700 | 1.700 | 0,25 |
| 3,961 % fällig am 26.11.2025 | | 2.700 | 2.612 | 0,39 |
| **Digital Dutch Finco BV** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.10.2022 | € | 1.000 | 1.044 | 0,15 |
| **Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.11.2024 | $ | 73 | 72 | 0,01 |
| **EPR Properties** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.06.2027 | | 400 | 362 | 0,05 |
| **F&G Global Funding** | | | | |
| 2,300 % fällig am 11.04.2027 | | 1.000 | 893 | 0,13 |
| **Fidelity National Financial, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.09.2022 | | 300 | 301 | 0,04 |
| **First Abu Dhabi Bank PJSC** | | | | |
| 1,375 % fällig am 19.02.2023 | £ | 1.000 | $ 1.204 | 0,18 |
| **First American Financial Corp.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 01.02.2023 | $ | 1.000 | 1.001 | 0,15 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 0,324 % fällig am 15.11.2023 | € | 100 | 101 | 0,01 |
| 0,346 % fällig am 01.12.2024 | | 1.100 | 1.073 | 0,16 |
| 1,514 % fällig am 17.02.2023 | | 500 | 516 | 0,08 |
| 1,744 % fällig am 19.07.2024 | | 100 | 97 | 0,01 |
| 2,366 % fällig am 03.08.2022 | $ | 300 | 299 | 0,04 |
| 2,386 % fällig am 17.02.2026 | € | 300 | 275 | 0,04 |
| 3,021 % fällig am 06.03.2024 | | 1.900 | 1.909 | 0,28 |
| 3,250 % fällig am 15.09.2025 | | 200 | 192 | 0,03 |
| 3,350 % fällig am 01.11.2022 | $ | 500 | 497 | 0,07 |
| 3,550 % fällig am 07.10.2022 | | 4.100 | 4.087 | 0,60 |
| 4,250 % fällig am 20.09.2022 | | 500 | 500 | 0,07 |
| 4,535 % fällig am 06.03.2025 | £ | 600 | 684 | 0,10 |
| **Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.10.2025 | $ | 900 | 851 | 0,13 |
| **Freedom Mortgage Corp.** | | | | |
| 8,125 % fällig am 15.11.2024 | | 400 | 346 | 0,05 |
| **FS KKR Capital Corp.** | | | | |
| 1,650 % fällig am 12.10.2024 | | 800 | 712 | 0,10 |
| 2,625 % fällig am 15.01.2027 | | 400 | 337 | 0,05 |
| **GA Global Funding Trust** | | | | |
| 1,000 % fällig am 08.04.2024 | | 1.400 | 1.322 | 0,19 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 2,439 % fällig am 17.11.2023 | | 2.900 | 2.859 | 0,42 |
| 5,100 % fällig am 17.01.2024 | | 300 | 303 | 0,04 |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 29.03.2025 | € | 400 | 369 | 0,05 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.03.2024 | $ | 3.200 | 3.160 | 0,47 |
| **Groupe Bruxelles Lambert S.A.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 19.06.2025 | € | 1.700 | 1.766 | 0,26 |
| **Growthpoint Properties International Pty. Ltd.** | | | | |
| 5,872 % fällig am 02.05.2023 | $ | 300 | 300 | 0,04 |
| **Grupo Aval Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 26.09.2022 | | 200 | 200 | 0,03 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 3,019 % fällig am 15.06.2027 | € | 1.000 | 1.033 | 0,15 |
| 3,950 % fällig am 18.05.2024 | $ | 3.000 | 2.988 | 0,44 |
| **HSBC USA, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 24.05.2024 | | 1.900 | 1.890 | 0,28 |
| **Huarong Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 30.09.2023 | | 1.100 | 1.048 | 0,15 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 1,000 % fällig am 20.09.2023 | € | 2.000 | 2.079 | 0,31 |
| **Intercontinental Exchange, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.09.2027 | $ | 1.100 | 1.083 | 0,16 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 3,125 % fällig am 14.07.2022 | | 1.600 | 1.600 | 0,24 |
| 3,375 % fällig am 12.01.2023 | | 1.300 | 1.295 | 0,19 |
| 5,017 % fällig am 26.06.2024 | | 2.200 | 2.101 | 0,31 |
| **Itau Unibanco Holding S.A.** | | | | |
| 2,900 % fällig am 24.01.2023 | | 250 | 249 | 0,04 |
| **Jackson National Life Global Funding** | | | | |
| 1,750 % fällig am 12.01.2025 | | 1.000 | 944 | 0,14 |
| **Kilroy Realty LP** | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.12.2024 | | 800 | 781 | 0,12 |
| **KWG Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 7,400 % fällig am 05.03.2024 | | 200 | 39 | 0,01 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 0,125 % fällig am 13.09.2023 | € | 800 | 817 | 0,12 |
| 0,750 % fällig am 03.10.2022 | | 500 | 523 | 0,08 |
| 2,875 % fällig am 24.10.2024 | $ | 1.500 | 1.438 | 0,21 |
| **Lincoln Financing SARL** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.04.2024 | € | 200 | 203 | 0,03 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 4,050 % fällig am 16.08.2023 | $ | 2.000 | 2.006 | 0,30 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.07.2024 | € | 1.200 | 1.190 | 0,18 |
| **Lseg Netherlands BV** | | | | |
| 0,000 % fällig am 06.04.2025 (c) | | 1.000 | 987 | 0,15 |
| **LSEGA Financing PLC** | | | | |
| 1,375 % fällig am 06.04.2026 | $ | 1.600 | 1.439 | 0,21 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **MassMutual Global Funding** | | | | |
| 0,480 % fällig am 28.08.2023 | $ | 1.900 $ | 1.844 | 0,27 |
| **Metropolitan Life Global Funding** | | | | |
| 0,375 % fällig am 09.04.2024 | € | 2.100 | 2.145 | 0,32 |
| 0,450 % fällig am 01.09.2023 | $ | 300 | 291 | 0,04 |
| 0,900 % fällig am 08.06.2023 | | 1.500 | 1.469 | 0,22 |
| **Mitsubishi HC Capital, Inc.** | | | | |
| 3,960 % fällig am 19.09.2023 | | 200 | 200 | 0,03 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | |
| 2,074 % fällig am 26.07.2023 | | 3.000 | 3.000 | 0,44 |
| 2,623 % fällig am 18.07.2022 | | 1.600 | 1.600 | 0,24 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | |
| 1,020 % fällig am 11.10.2023 | € | 400 | 414 | 0,06 |
| 2,154 % fällig am 25.05.2024 | $ | 1.900 | 1.880 | 0,28 |
| 2,601 % fällig am 11.09.2022 | | 2.700 | 2.699 | 0,40 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 0,731 % fällig am 05.04.2024 | | 2.700 | 2.633 | 0,39 |
| **MPT Operating Partnership LP** | | | | |
| 2,500 % fällig am 24.03.2026 | £ | 700 | 754 | 0,11 |
| **MUFG Bank Ltd.** | | | | |
| 3,200 % fällig am 26.02.2023 | $ | 1.450 | 1.448 | 0,21 |
| **MUFG Union Bank N.A.** | | | | |
| 2,156 % fällig am 09.12.2022 | | 900 | 900 | 0,13 |
| **Multibank, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 09.11.2022 | | 200 | 200 | 0,03 |
| **Nationale-Nederlanden Bank NV** | | | | |
| 0,375 % fällig am 31.05.2023 | € | 400 | 414 | 0,06 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 3,766 % fällig am 08.03.2024 | $ | 800 | 798 | 0,12 |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 2,359 % fällig am 22.05.2024 | | 3.000 | 2.947 | 0,43 |
| **NatWest Markets PLC** | | | | |
| 1,000 % fällig am 28.05.2024 | € | 1.300 | 1.331 | 0,20 |
| **New Metro Global Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 02.05.2026 | $ | 1.700 | 787 | 0,12 |
| **Nissan Motor Acceptance Co. LLC** | | | | |
| 1,125 % fällig am 16.09.2024 | | 1.400 | 1.288 | 0,19 |
| 2,650 % fällig am 13.07.2022 | | 150 | 150 | 0,02 |
| 3,875 % fällig am 21.09.2023 | | 1.000 | 994 | 0,15 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | | |
| 2,924 % fällig am 28.09.2022 | | 300 | 299 | 0,04 |
| **Nomura Holdings, Inc.** | | | | |
| 1,851 % fällig am 16.07.2025 | | 200 | 183 | 0,03 |
| 2,648 % fällig am 16.01.2025 | | 2.800 | 2.675 | 0,39 |
| 5,386 % fällig am 06.07.2027 (a) | | 2.800 | 2.804 | 0,41 |
| **NongHyup Bank** | | | | |
| 0,875 % fällig am 28.07.2024 | | 2.500 | 2.361 | 0,35 |
| **Nordea Bank Abp** | | | | |
| 1,125 % fällig am 16.02.2027 | € | 900 | 867 | 0,13 |
| **Nova Kreditna Banka Maribor d.d.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 27.01.2025 | | 600 | 593 | 0,09 |
| **NTT Finance Corp.** | | | | |
| 0,583 % fällig am 01.03.2024 | $ | 1.200 | 1.142 | 0,17 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 1,375 % fällig am 12.07.2027 | € | 3.000 | 2.923 | 0,43 |
| **Omega Healthcare Investors, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 01.08.2023 | $ | 83 | 83 | 0,01 |
| **Pacific Life Global Funding** | | | | |
| 1,375 % fällig am 14.04.2026 | | 1.700 | 1.533 | 0,23 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.08.2022 | | 700 | 700 | 0,10 |
| **Poly Real Estate Finance Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 17.09.2023 | | 800 | 803 | 0,12 |
| **Powerlong Real Estate Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 30.04.2025 | | 800 | 128 | 0,02 |
| **Protective Life Global Funding** | | | | |
| 1,170 % fällig am 15.07.2025 | | 1.000 | 919 | 0,14 |
| 1,646 % fällig am 13.01.2025 | | 1.000 | 943 | 0,14 |
| 4,714 % fällig am 06.07.2027 (a) | | 3.300 | 3.331 | 0,49 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 26.01.2026 | | 300 | 273 | 0,04 |
| 3,500 % fällig am 28.03.2024 | | 1.100 | 1.095 | 0,16 |
| **Reliance Standard Life Global Funding** | | | | |
| 2,150 % fällig am 21.01.2023 | | 500 | 495 | 0,07 |
| 2,625 % fällig am 22.07.2022 | | 1.400 | 1.400 | 0,21 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Sagax Euro MTN NL BV** | | | | |
| 1,625 % fällig am 24.02.2026 | € | 1.500 $ | 1.431 | 0,21 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 1,532 % fällig am 21.08.2026 | $ | 1.200 | 1.076 | 0,16 |
| 3,373 % fällig am 05.01.2024 | | 2.600 | 2.588 | 0,38 |
| **SBA Tower Trust** | | | | |
| 1,631 % fällig am 15.05.2051 | | 1.900 | 1.702 | 0,25 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 29.10.2022 ^ | | 1.400 | 98 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 23.05.2023 ^(g) | | 500 | 35 | 0,01 |
| **Scentre Group Trust** | | | | |
| 1,375 % fällig am 22.03.2023 | € | 200 | 209 | 0,03 |
| **Shinhan Bank Co. Ltd.** | | | | |
| 0,250 % fällig am 16.10.2024 | | 1.100 | 1.108 | 0,16 |
| 1,183 % fällig am 29.09.2025 | AUD | 800 | 495 | 0,07 |
| **Shriram Transport Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 24.10.2022 | $ | 900 | 890 | 0,13 |
| **Sirius Real Estate Ltd.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 22.06.2026 | € | 1.200 | 1.085 | 0,16 |
| **Sitka Holdings LLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 06.07.2026 | $ | 1.800 | 1.742 | 0,26 |
| **SL Green Operating Partnership LP** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.10.2022 | | 700 | 698 | 0,10 |
| **SL Green Realty Corp.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.12.2022 | | 4.400 | 4.406 | 0,65 |
| **SLM Corp.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 02.11.2026 | | 600 | 485 | 0,07 |
| **SMBC Aviation Capital Finance DAC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.07.2022 | | 400 | 400 | 0,06 |
| 3,550 % fällig am 15.04.2024 | | 3.330 | 3.243 | 0,48 |
| 4,125 % fällig am 15.07.2023 | | 800 | 794 | 0,12 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 1,488 % fällig am 14.12.2026 | | 2.400 | 2.121 | 0,31 |
| 4,677 % fällig am 15.06.2027 | | 3.500 | 3.481 | 0,51 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 0,991 % fällig am 12.01.2025 | | 1.000 | 945 | 0,14 |
| 1,214 % fällig am 23.03.2025 | | 500 | 472 | 0,07 |
| 1,319 % fällig am 14.10.2023 | | 200 | 199 | 0,03 |
| 2,104 % fällig am 14.10.2023 | | 200 | 200 | 0,03 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,010 % fällig am 10.09.2025 | € | 5.000 | 4.940 | 0,73 |
| **Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.** | | | | |
| 0,800 % fällig am 12.09.2023 | $ | 700 | 677 | 0,10 |
| **Svenska Handelsbanken AB** | | | | |
| 0,625 % fällig am 30.06.2023 | | 1.500 | 1.458 | 0,21 |
| 1,418 % fällig am 11.06.2027 | | 300 | 268 | 0,04 |
| **Synchrony Financial** | | | | |
| 4,375 % fällig am 19.03.2024 | | 600 | 597 | 0,09 |
| **Toronto-Dominion Bank** | | | | |
| 1,510 % fällig am 27.01.2023 | | 800 | 798 | 0,12 |
| **TP ICAP Finance PLC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 18.11.2028 | £ | 600 | 601 | 0,09 |
| 5,250 % fällig am 26.01.2024 | | 895 | 1.077 | 0,16 |
| **UBS AG** | | | | |
| 0,375 % fällig am 01.06.2023 | $ | 1.000 | 968 | 0,14 |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (g) | | 300 | 300 | 0,04 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (g) | | 2.650 | 2.658 | 0,39 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 1,494 % fällig am 10.08.2027 | | 2.300 | 2.014 | 0,30 |
| 2,859 % fällig am 15.08.2023 | | 300 | 300 | 0,04 |
| 4,488 % fällig am 12.05.2026 | | 3.500 | 3.491 | 0,51 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | | 2.800 | 2.901 | 0,43 |
| **Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.** | | | | |
| 3,074 % fällig am 25.05.2023 | | 1.100 | 1.092 | 0,16 |
| **VICI Properties LP** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.12.2026 | | 800 | 732 | 0,11 |
| 4,500 % fällig am 01.09.2026 | | 400 | 369 | 0,05 |
| 5,625 % fällig am 01.05.2024 | | 700 | 693 | 0,10 |
| **Virgin Money UK PLC** | | | | |
| 0,375 % fällig am 27.05.2024 | € | 2.500 | 2.565 | 0,38 |
| **Visa, Inc.** | | | | |
| 2,150 % fällig am 15.09.2022 | $ | 3.200 | 3.199 | 0,47 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 1,250 % fällig am 10.06.2024 | € | 600 | 615 | 0,09 |
| 1,875 % fällig am 31.01.2024 | | 200 | 208 | 0,03 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 12.02.2025 (c) | € | 2.700 $ | 2.621 | 0,39 |
| **Volkswagen Financial Services NV** | | | | |
| 1,125 % fällig am 18.09.2023 | £ | 2.700 | 3.171 | 0,47 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** | | | | |
| 0,000 % fällig am 19.07.2024 (c) | € | 1.000 | 995 | 0,15 |
| 1,000 % fällig am 16.02.2023 | | 900 | 941 | 0,14 |
| **Vonovia SE** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.09.2023 (c) | | 2.800 | 2.865 | 0,42 |
| 1,375 % fällig am 28.01.2026 | | 1.300 | 1.261 | 0,19 |
| | | | 284.374 | 41,92 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.07.2043 | £ | 900 | 1.071 | 0,16 |
| **ABB Finance BV** | | | | |
| 0,625 % fällig am 31.03.2024 | € | 2.100 | 2.164 | 0,32 |
| **AbbVie, Inc.** | | | | |
| 2,300 % fällig am 21.11.2022 | $ | 1.500 | 1.497 | 0,22 |
| 2,900 % fällig am 06.11.2022 | | 3.850 | 3.850 | 0,57 |
| 3,250 % fällig am 01.10.2022 | | 400 | 400 | 0,06 |
| **Aeroporti di Roma SpA** | | | | |
| 5,441 % fällig am 20.02.2023 | £ | 400 | 491 | 0,07 |
| **Air Canada Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.06.2029 | $ | 711 | 672 | 0,10 |
| **American Airlines, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 20.04.2026 | | 2.600 | 2.398 | 0,35 |
| **American Medical Systems Europe BV** | | | | |
| 0,750 % fällig am 08.03.2025 | € | 3.000 | 3.008 | 0,44 |
| **Aptiv PLC** | | | | |
| 2,396 % fällig am 18.02.2025 | $ | 900 | 860 | 0,13 |
| **Asahi Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 0,010 % fällig am 19.04.2024 | € | 1.200 | 1.213 | 0,18 |
| 0,155 % fällig am 23.10.2024 | | 500 | 500 | 0,07 |
| **Ashtead Capital, Inc.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 12.08.2026 | $ | 400 | 350 | 0,05 |
| **Atlantia SpA** | | | | |
| 1,625 % fällig am 03.02.2025 | € | 1.300 | 1.243 | 0,18 |
| **Bacardi Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 03.07.2023 | | 300 | 316 | 0,05 |
| **BAE Systems Holdings, Inc.** | | | | |
| 3,850 % fällig am 15.12.2025 | $ | 1.100 | 1.082 | 0,16 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 16.11.2023 | € | 300 | 309 | 0,05 |
| 3,222 % fällig am 15.08.2024 | $ | 900 | 876 | 0,13 |
| **Bayer AG** | | | | |
| 0,050 % fällig am 12.01.2025 | € | 500 | 494 | 0,07 |
| 0,375 % fällig am 06.07.2024 | | 1.500 | 1.522 | 0,22 |
| **Bayer Capital Corp. BV** | | | | |
| 0,625 % fällig am 15.12.2022 | | 300 | 314 | 0,05 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** | | | | |
| 2,839 % fällig am 15.12.2023 | $ | 1.737 | 1.728 | 0,25 |
| **Becton Dickinson and Co.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 15.12.2022 | € | 1.000 | 1.047 | 0,15 |
| **Berry Global, Inc.** | | | | |
| 0,950 % fällig am 15.02.2024 | $ | 3.170 | 3.005 | 0,44 |
| **Bio-Rad Laboratories, Inc.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 15.03.2027 | | 800 | 756 | 0,11 |
| **BlueScope Finance Americas LLC** | | | | |
| 4,625 % fällig am 25.05.2023 | | 2.500 | 2.513 | 0,37 |
| **BMW U.S. Capital LLC** | | | | |
| 1,250 % fällig am 12.08.2026 | | 500 | 448 | 0,07 |
| **BOC Aviation USA Corp.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 29.04.2024 | | 400 | 383 | 0,06 |
| **Boeing Co.** | | | | |
| 1,433 % fällig am 04.02.2024 | | 900 | 860 | 0,13 |
| **Booking Holdings, Inc.** | | | | |
| 0,100 % fällig am 08.03.2025 | € | 300 | 296 | 0,04 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | |
| 3,137 % fällig am 15.11.2035 | $ | 521 | 396 | 0,06 |
| **Bureau Veritas S.A.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 07.09.2023 | € | 700 | 727 | 0,11 |
| **Caesars Entertainment, Inc.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 01.07.2025 | $ | 350 | 338 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **CDW LLC** | | | | |
| 2,670 % fällig am 01.12.2026 | $ | 1.800 | $ 1.607 | 0,24 |
| 4,125 % fällig am 01.05.2025 | | 1.149 | 1.119 | 0,16 |
| **Central Japan Railway Co.** | | | | |
| 2,200 % fällig am 02.10.2024 | | 3.300 | 3.197 | 0,47 |
| 3,400 % fällig am 06.09.2023 | | 300 | 300 | 0,04 |
| **CGI, Inc.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 14.09.2026 | | 2.700 | 2.387 | 0,35 |
| **Chanel Ceres PLC** | | | | |
| 0,500 % fällig am 31.07.2026 | € | 1.900 | 1.821 | 0,27 |
| **Cheniere Corpus Christi Holdings LLC** | | | | |
| 7,000 % fällig am 30.06.2024 | $ | 2.065 | 2.141 | 0,32 |
| **China Modern Dairy Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 14.07.2026 | | 1.400 | 1.220 | 0,18 |
| **Clear Channel International BV** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.08.2025 | | 200 | 186 | 0,03 |
| **Comcast Cable Communications Holdings, Inc.** | | | | |
| 9,455 % fällig am 15.11.2022 | | 1.315 | 1.345 | 0,20 |
| **CommonSpirit Health** | | | | |
| 2,760 % fällig am 01.10.2024 | | 100 | 97 | 0,01 |
| **ConocoPhillips Co.** | | | | |
| 2,400 % fällig am 07.03.2025 | | 100 | 97 | 0,01 |
| **Continental Resources, Inc.** | | | | |
| 2,268 % fällig am 15.11.2026 | | 500 | 444 | 0,07 |
| **Corp. Nacional del Cobre de Chile** | | | | |
| 3,000 % fällig am 17.07.2022 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **Crown European Holdings S.A.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.02.2023 | € | 1.000 | 1.025 | 0,15 |
| **CSL Finance PLC** | | | | |
| 3,850 % fällig am 27.04.2027 | $ | 800 | 793 | 0,12 |
| **D.R. Horton, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.09.2022 | | 500 | 500 | 0,07 |
| **DAE Funding LLC** | | | | |
| 1,550 % fällig am 01.08.2024 | | 900 | 844 | 0,12 |
| 1,625 % fällig am 15.02.2024 | | 2.500 | 2.369 | 0,35 |
| 2,625 % fällig am 20.03.2025 | | 300 | 279 | 0,04 |
| **Delta Air Lines, Inc.** | | | | |
| 2,900 % fällig am 28.10.2024 | | 2.100 | 1.945 | 0,29 |
| 3,800 % fällig am 19.04.2023 | | 300 | 297 | 0,04 |
| 4,500 % fällig am 20.10.2025 | | 3.100 | 3.015 | 0,44 |
| **Devon Energy Corp.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.09.2024 | | 300 | 306 | 0,05 |
| 5,250 % fällig am 15.10.2027 | | 600 | 608 | 0,09 |
| **Enbridge, Inc.** | | | | |
| 1,639 % fällig am 17.02.2023 | | 400 | 398 | 0,06 |
| **Entergy Louisiana LLC** | | | | |
| 0,620 % fällig am 17.11.2023 | | 1.632 | 1.573 | 0,23 |
| 0,950 % fällig am 01.10.2024 | | 1.400 | 1.316 | 0,19 |
| **EQM Midstream Partners LP** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2024 | | 75 | 70 | 0,01 |
| **Expedia Group, Inc.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 01.05.2025 | | 2.015 | 2.078 | 0,31 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | |
| 0,125 % fällig am 03.12.2022 | € | 1.000 | 1.045 | 0,15 |
| **Flex Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.02.2023 | $ | 100 | 101 | 0,01 |
| **Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide** | | | | |
| 1,625 % fällig am 09.07.2024 | € | 2.600 | 2.634 | 0,39 |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 2,949 % fällig am 24.01.2024 | | 2.200 | 747 | 0,11 |
| **Geely Automobile Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 25.01.2023 | $ | 1.100 | 1.099 | 0,16 |
| **Georgia-Pacific LLC** | | | | |
| 0,625 % fällig am 15.05.2024 | | 2.700 | 2.539 | 0,37 |
| **GN Store Nord A/S** | | | | |
| 0,875 % fällig am 25.11.2024 | € | 1.500 | 1.485 | 0,22 |
| **GSK Consumer Healthcare Capital NL BV** | | | | |
| 1,250 % fällig am 29.03.2026 | | 3.700 | 3.713 | 0,55 |
| **GSK Consumer Healthcare Capital U.S. LLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 24.03.2027 | $ | 750 | 718 | 0,11 |
| **HF Sinclair Corp.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 01.10.2023 | | 1.300 | 1.263 | 0,19 |
| **Home Depot, Inc.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.04.2027 | | 600 | 580 | 0,09 |
| **HPHT Finance Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 05.11.2024 | | 700 | 685 | 0,10 |
| **Huntington Ingalls Industries, Inc.** | | | | |
| 3,844 % fällig am 01.05.2025 | $ | 1.200 | $ 1.183 | 0,17 |
| **Hyatt Hotels Corp.** | | | | |
| 1,300 % fällig am 01.10.2023 | | 1.700 | 1.647 | 0,24 |
| 2,563 % fällig am 01.10.2023 | | 100 | 100 | 0,01 |
| 4,850 % fällig am 15.03.2026 | | 300 | 299 | 0,04 |
| **Hyundai Capital America** | | | | |
| 0,875 % fällig am 14.06.2024 | | 1.600 | 1.497 | 0,22 |
| 1,150 % fällig am 10.11.2022 | | 2.200 | 2.185 | 0,32 |
| 1,500 % fällig am 15.06.2026 | | 500 | 443 | 0,07 |
| **IMCD NV** | | | | |
| 2,125 % fällig am 31.03.2027 | € | 2.700 | 2.542 | 0,37 |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 11.02.2023 | $ | 1.300 | 1.293 | 0,19 |
| **Infor, Inc.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 15.07.2023 | | 300 | 292 | 0,04 |
| **Informa PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 05.07.2023 | € | 100 | 103 | 0,02 |
| **InterContinental Hotels Group PLC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 08.10.2024 | | 800 | 801 | 0,12 |
| 3,875 % fällig am 28.11.2022 | £ | 300 | 366 | 0,05 |
| **International Flavors & Fragrances, Inc.** | | | | |
| 0,697 % fällig am 15.09.2022 | $ | 800 | 796 | 0,12 |
| 3,200 % fällig am 01.05.2023 | | 1.600 | 1.595 | 0,24 |
| **Jaguar Land Rover Automotive PLC** | | | | |
| 2,200 % fällig am 15.01.2024 | € | 300 | 285 | 0,04 |
| **John Lewis PLC** | | | | |
| 6,125 % fällig am 21.01.2025 | £ | 200 | 251 | 0,04 |
| **KLA Corp.** | | | | |
| 4,650 % fällig am 01.11.2024 | $ | 2.000 | 2.031 | 0,30 |
| **Komatsu Finance America, Inc.** | | | | |
| 0,849 % fällig am 09.09.2023 | | 2.350 | 2.278 | 0,34 |
| 2,437 % fällig am 11.09.2022 | | 200 | 200 | 0,03 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 30.06.2023 | € | 900 | 942 | 0,14 |
| **Lenovo Group Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.04.2025 | $ | 600 | 618 | 0,09 |
| **Magallanes, Inc.** | | | | |
| 3,755 % fällig am 15.03.2027 | | 1.200 | 1.127 | 0,17 |
| **Marriott International, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.05.2025 | | 74 | 77 | 0,01 |
| **Marvell Technology, Inc.** | | | | |
| 1,650 % fällig am 15.04.2026 | | 2.000 | 1.794 | 0,26 |
| **Melco Resorts Finance Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 06.06.2025 | | 800 | 599 | 0,09 |
| **Mitsubishi Corp.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 14.07.2022 | | 3.200 | 3.200 | 0,47 |
| **Mondelez International, Inc.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 17.03.2024 | | 2.300 | 2.243 | 0,33 |
| **NetApp, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.12.2022 | | 400 | 400 | 0,06 |
| **Newell Brands, Inc.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 01.04.2026 | | 650 | 621 | 0,09 |
| **Nissan Motor Co. Ltd.** | | | | |
| 1,940 % fällig am 15.09.2023 | € | 2.000 | 2.081 | 0,31 |
| 3,043 % fällig am 15.09.2023 | $ | 2.400 | 2.361 | 0,35 |
| **NXP BV** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2033 | | 400 | 391 | 0,06 |
| **ONEOK Partners LP** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.09.2023 | | 200 | 202 | 0,03 |
| **Oracle Corp.** | | | | |
| 1,650 % fällig am 25.03.2026 (h) | | 1.899 | 1.705 | 0,25 |
| **Pacific National Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 07.04.2023 | | 271 | 274 | 0,04 |
| **Panasonic Holdings Corp.** | | | | |
| 2,536 % fällig am 19.07.2022 | | 2.600 | 2.600 | 0,38 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.08.2023 | | 700 | 703 | 0,10 |
| **Pinnacle Bidco PLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.02.2025 | € | 1.000 | 946 | 0,14 |
| **Qorvo, Inc.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 15.12.2024 | $ | 550 | 515 | 0,08 |
| **Renesas Electronics Corp.** | | | | |
| 1,543 % fällig am 26.11.2024 | | 4.100 | 3.832 | 0,56 |
| **Royalty Pharma PLC** | | | | |
| 0,750 % fällig am 02.09.2023 | | 1.100 | 1.060 | 0,16 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2027 | $ | 568 | $ 571 | 0,08 |
| 5,625 % fällig am 15.04.2023 | | 400 | 404 | 0,06 |
| 5,625 % fällig am 01.03.2025 | | 200 | 204 | 0,03 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 2,550 % fällig am 08.03.2027 | | 4.200 | 3.066 | 0,45 |
| 5,125 % fällig am 08.08.2025 | | 1.400 | 1.177 | 0,17 |
| **SEB S.A.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 16.06.2025 | € | 500 | 502 | 0,07 |
| 1,500 % fällig am 31.05.2024 | | 200 | 207 | 0,03 |
| 2,375 % fällig am 25.11.2022 | | 400 | 419 | 0,06 |
| **Silfin NV** | | | | |
| 2,875 % fällig am 11.04.2027 | | 800 | 611 | 0,09 |
| **Sixt SE** | | | | |
| 1,750 % fällig am 09.12.2024 | | 2.100 | 2.148 | 0,32 |
| **SK Hynix, Inc.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 19.01.2024 | $ | 1.300 | 1.242 | 0,18 |
| **SK Telecom Co. Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 16.04.2023 | | 200 | 200 | 0,03 |
| **Sky Ltd.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 24.11.2023 | € | 2.100 | 2.205 | 0,32 |
| **Skyworks Solutions, Inc.** | | | | |
| 0,900 % fällig am 01.06.2023 | $ | 1.600 | 1.547 | 0,23 |
| **Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA** | | | | |
| 3,500 % fällig am 09.10.2025 | € | 200 | 209 | 0,03 |
| **Southwest Airlines Co. Pass-Through Trust** | | | | |
| 6,650 % fällig am 01.08.2022 | $ | 16 | 16 | 0,00 |
| **Spirit AeroSystems, Inc.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.04.2025 | | 3.100 | 2.888 | 0,43 |
| **Stryker Corp.** | | | | |
| 0,250 % fällig am 03.12.2024 | € | 1.000 | 998 | 0,15 |
| 1,125 % fällig am 30.11.2023 | | 2.500 | 2.595 | 0,38 |
| **Studio City Co. Ltd.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.02.2027 | $ | 2.800 | 2.431 | 0,36 |
| **Studio City Finance Ltd.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.07.2025 | | 600 | 381 | 0,06 |
| **Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 23.01.2023 | | 2.300 | 2.302 | 0,34 |
| **Suntory Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 16.10.2024 | | 1.100 | 1.052 | 0,16 |
| **Swedish Match AB** | | | | |
| 0,875 % fällig am 23.09.2024 | € | 500 | 505 | 0,07 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 3,375 % fällig am 16.04.2026 | | 2.700 | 2.789 | 0,41 |
| 4,441 % fällig am 24.04.2023 | $ | 1.000 | 1.008 | 0,15 |
| 4,892 % fällig am 24.04.2025 | | 400 | 401 | 0,06 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.04.2025 | | 450 | 441 | 0,06 |
| **Take-Two Interactive Software, Inc.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 28.03.2024 | | 900 | 889 | 0,13 |
| **Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.** | | | | |
| 0,752 % fällig am 21.11.2022 | € | 100 | 105 | 0,02 |
| **Targa Resources Corp.** | | | | |
| 5,200 % fällig am 01.07.2027 (a) | $ | 2.500 | 2.513 | 0,37 |
| **TD SYNNEX Corp.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 09.08.2024 | | 2.000 | 1.868 | 0,28 |
| 1,750 % fällig am 09.08.2026 | | 900 | 794 | 0,12 |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,985 % fällig am 19.01.2023 | | 400 | 399 | 0,06 |
| **Tesco Corporate Treasury Services PLC** | | | | |
| 1,375 % fällig am 24.10.2023 | € | 250 | 260 | 0,04 |
| **Thermo Fisher Scientific Finance BV** | | | | |
| 0,000 % fällig am 18.11.2023 | | 3.700 | 3.855 | 0,57 |
| **Ubisoft Entertainment S.A.** | | | | |
| 0,878 % fällig am 24.11.2027 | | 700 | 605 | 0,09 |
| 1,289 % fällig am 30.01.2023 | | 1.800 | 1.882 | 0,28 |
| **United Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,300 % fällig am 15.02.2027 | $ | 565 | 541 | 0,08 |
| **United Airlines, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.04.2026 | | 1.400 | 1.239 | 0,18 |
| **Vantage Towers AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 31.03.2025 (c) | € | 1.900 | 1.822 | 0,27 |
| **VMware, Inc.** | | | | |
| 0,600 % fällig am 15.08.2023 | $ | 2.000 | 1.934 | 0,28 |
| 4,500 % fällig am 15.05.2025 | | 1.600 | 1.606 | 0,24 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | | |
| 4,350 % fällig am 08.06.2027 | $ | 800$ | 785 | 0,12 |
| **Weir Group PLC** | | | | |
| 2,200 % fällig am 13.05.2026 | | 4.700 | 4.138 | 0,61 |
| **West Fraser Timber Co. Ltd.** | | | | |
| 4,350 % fällig am 15.10.2024 | | 200 | 200 | 0,03 |
| **Westinghouse Air Brake Technologies Corp.** | | | | |
| 3,200 % fällig am 15.06.2025 | | 562 | 536 | 0,08 |
| **Woodside Finance Ltd.** | | | | |
| 3,650 % fällig am 05.03.2025 | | 600 | 590 | 0,09 |
| **Worldline S.A.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 30.06.2023 | € | 600 | 619 | 0,09 |
| 1,625 % fällig am 13.09.2024 | | 100 | 102 | 0,02 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.10.2024 | $ | 2.100 | 1.565 | 0,23 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2026 | | 600 | 416 | 0,06 |
| | | | 197.473 | 29,10 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **Atmos Energy Corp.** | | | | |
| 0,625 % fällig am 09.03.2023 | | 1.200 | 1.179 | 0,17 |
| **Avangrid, Inc.** | | | | |
| 3,150 % fällig am 01.12.2024 | | 500 | 489 | 0,07 |
| **East Ohio Gas Co.** | | | | |
| 1,300 % fällig am 15.06.2025 | | 1.800 | 1.657 | 0,24 |
| **Edison International** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.11.2022 | | 200 | 200 | 0,03 |
| **Electricite de France S.A.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 13.10.2025 | | 1.900 | 1.869 | 0,28 |
| **Enel Finance International NV** | | | | |
| 0,000 % fällig am 17.06.2024 (c) | € | 800 | 806 | 0,12 |
| 1,375 % fällig am 12.07.2026 | $ | 1.000 | 879 | 0,13 |
| 2,650 % fällig am 10.09.2024 | | 2.500 | 2.424 | 0,36 |
| 4,250 % fällig am 15.06.2025 | | 1.700 | 1.684 | 0,25 |
| **Georgia Power Co.** | | | | |
| 2,100 % fällig am 30.07.2023 | | 200 | 197 | 0,03 |
| **India Green Energy Holdings** | | | | |
| 5,375 % fällig am 29.04.2024 | | 250 | 234 | 0,03 |
| **Ipalco Enterprises, Inc.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 01.09.2024 | | 1.348 | 1.334 | 0,20 |
| **Jersey Central Power & Light Co.** | | | | |
| 4,700 % fällig am 01.04.2024 | | 1.083 | 1.090 | 0,16 |
| **Metropolitan Edison Co.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.03.2023 | | 3.650 | 3.627 | 0,53 |
| **Midwest Connector Capital Co. LLC** | | | | |
| 3,900 % fällig am 01.04.2024 | | 200 | 196 | 0,03 |
| **Mississippi Power Co.** | | | | |
| 1,811 % fällig am 28.06.2024 | | 2.750 | 2.697 | 0,40 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | |
| 1,498 % fällig am 03.11.2023 | | 2.900 | 2.859 | 0,42 |
| 2,200 % fällig am 02.12.2026 | AUD | 2.500 | 1.523 | 0,22 |
| **ONEOK, Inc.** | | | | |
| 4,550 % fällig am 15.07.2028 | $ | 1.600 | 1.549 | 0,23 |
| 7,500 % fällig am 01.09.2023 | | 2.418 | 2.505 | 0,37 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.06.2023 ^ | | 200 | 197 | 0,03 |
| 3,300 % fällig am 15.03.2027 ^ | | 300 | 269 | 0,04 |
| 3,400 % fällig am 15.08.2024 ^ | | 100 | 96 | 0,01 |
| 3,450 % fällig am 01.07.2025 | | 100 | 94 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 15.06.2025 ^ | | 1.700 | 1.612 | 0,24 |
| 3,750 % fällig am 15.02.2024 ^ | | 200 | 196 | 0,03 |
| 3,850 % fällig am 15.11.2023 ^ | | 200 | 197 | 0,03 |
| 4,250 % fällig am 01.08.2023 | | 2.400 | 2.387 | 0,35 |
| 4,950 % fällig am 08.06.2025 | | 2.000 | 1.963 | 0,29 |
| **Pennsylvania Electric Co.** | | | | |
| 4,150 % fällig am 15.04.2025 | | 1.950 | 1.919 | 0,28 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Potomac Electric Power Co.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 15.03.2024 | $ | 1.262$ | 1.264 | 0,19 |
| **San Diego Gas & Electric Co.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.05.2026 | | 226 | 214 | 0,03 |
| **Sempra Energy** | | | | |
| 3,300 % fällig am 01.04.2025 | | 3.100 | 3.031 | 0,45 |
| **Sinopec Group Overseas Development Ltd.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 13.09.2022 | | 2.600 | 2.598 | 0,38 |
| **Southern California Edison Co.** | | | | |
| 0,975 % fällig am 01.08.2024 | | 800 | 755 | 0,11 |
| 4,200 % fällig am 01.06.2025 | | 3.200 | 3.223 | 0,47 |
| **Southern California Gas Co.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 15.04.2027 | | 1.000 | 947 | 0,14 |
| **Southern Power Co.** | | | | |
| 0,900 % fällig am 15.01.2026 | | 3.000 | 2.683 | 0,40 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.11.2022 | | 800 | 806 | 0,12 |
| **Sprint Corp.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.06.2024 | | 125 | 129 | 0,02 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2023 | | 1.100 | 1.137 | 0,17 |
| **State Grid Overseas Investment BVI Ltd.** | | | | |
| 0,797 % fällig am 05.08.2026 | € | 500 | 475 | 0,07 |
| 1,000 % fällig am 05.08.2025 | $ | 500 | 463 | 0,07 |
| **Systems Energy Resources, Inc.** | | | | |
| 2,140 % fällig am 09.12.2025 | | 1.150 | 1.069 | 0,16 |
| **Trans-Allegheny Interstate Line Co.** | | | | |
| 3,850 % fällig am 01.06.2025 | | 1.305 | 1.285 | 0,19 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | |
| 2,296 % fällig am 20.03.2026 | | 800 | 787 | 0,12 |
| 2,355 % fällig am 15.03.2032 | | 201 | 167 | 0,02 |
| **Vistra Operations Co. LLC** | | | | |
| 3,550 % fällig am 15.07.2024 | | 1.825 | 1.763 | 0,26 |
| **Wisconsin Power & Light Co.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.11.2022 | | 3.600 | 3.596 | 0,53 |
| | | | 64.320 | 9,48 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 546.167 | 80,50 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020** | | | | |
| 1,258 % fällig am 01.07.2025 | | 1.200 | 1.123 | 0,17 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Ginnie Mae, TBA** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 | | 2.700 | 2.472 | 0,36 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.08.2052 | | 17.440 | 16.757 | 2,47 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2052 | | 4.600 | 4.530 | 0,67 |
| | | | 23.759 | 3,50 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 0,125 % fällig am 30.06.2023 | | 7.900 | 7.684 | 1,13 |
| 0,125 % fällig am 31.07.2023 | | 8.200 | 7.955 | 1,17 |
| 0,125 % fällig am 31.08.2023 | | 15.800 | 15.292 | 2,25 |
| 1,500 % fällig am 29.02.2024 | | 20.500 | 20.019 | 2,95 |
| 1,500 % fällig am 30.11.2024 | | 800 | 772 | 0,12 |
| 2,250 % fällig am 31.03.2024 | | 12.100 | 11.949 | 1,76 |
| | | | 63.671 | 9,38 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,938 % fällig am 25.09.2035 | | 2 | 2 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,726 % fällig am 25.11.2034 | | 4 | 4 | 0,00 |
| 6,353 % fällig am 25.09.2034 | | 339 | 346 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 1,473 % fällig am 25.01.2047 | $ | 180 | $ 161 | 0,03 |
| 2,593 % fällig am 25.01.2033 | | 5 | 5 | 0,00 |
| | | | 518 | 0,08 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **IXIS Real Estate Capital Trust** | | | | |
| 2,254 % fällig am 25.02.2036 | | 64 | 66 | 0,01 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 2,244 % fällig am 25.12.2035 | | 384 | 377 | 0,06 |
| | | | 443 | 0,07 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Canada Government International Bond** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.09.2024 | CAD | 2.800 | $ 2.099 | 0,31 |
| **France Government International Bond** | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.03.2025 (c) | € | 9.000 | 9.148 | 1,35 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.04.2026 (c) | | 2.700 | 2.602 | 0,38 |
| 1,850 % fällig am 01.07.2025 | | 1.000 | 1.043 | 0,15 |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 10,500 % fällig am 21.12.2026 | ZAR | 139.500 | 9.017 | 1,33 |
| **Ukraine Government International Bond** | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.09.2022 | $ | 100 | 57 | 0,01 |
| | | | 23.966 | 3,53 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **FINANZWERTE** | | | | |
| **Stearns Holdings LLC 'B' (b)** | | 43.861 | 0 | 0,00 |
| **OPTIONSSCHEINE** | | | | |
| **Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31. Dezember 2060** | | 211 | 0 | 0,00 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | | |
| **Pacific Gas and Electric Co.** | | | | |
| 2,370 % fällig am 14.11.2022 | $ | 3.700 | 3.685 | 0,54 |
| **Yango Justice International Ltd.** | | | | |
| 8,200 % fällig am 11.01.2022 ^ | | 200 | 18 | 0,00 |
| | | | 3.703 | 0,54 |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | | |
| 51,049 % fällig am 30.09.2022 (c)(d) | ARS | 74.700 | 251 | 0,04 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 3.954 | 0,58 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **$667.528** | **98,39** |
| | | **AKTIEN** | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)** | | 2.536.821 | 25.237 | 3,72 |
| **PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)** | | 5.163 | 70 | 0,01 |
| **Summe Investmentfonds** | | | **$ 25.307** | **3,73** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 683 | U,S, Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | $ (697) | $ 683 | $ 683 | 0,10 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (697)** | **$ 683** | **$ 683** | **0,10** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

### FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bobl September Futures | Long | 09.2022 | 153 | $ (8) | 0,00 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 227 | (42) | (0,01) |
| | | | | $ (50) | (0,01) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ (50)** | **(0,01)** |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

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

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Newell Brands, Inc. | (1,000) % | 20.06.2023 | $ 1.000 | $ 5 | 0,00 |

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

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20.12.2024 | $ 1.300 | $ (20) | (0,01) |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.12.2025 | 200 | (4) | 0,00 |
| Barclays Bank PLC | 1,000 | 20.12.2022 | € 3.500 | (20) | 0,00 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 | 20.12.2022 | $ 2.400 | (9) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.12.2022 | 800 | (5) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.06.2023 | 2.000 | (21) | (0,01) |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.12.2024 | 1.500 | 1 | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.12.2026 | 1.300 | (73) | (0,01) |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.06.2027 | 1.200 | (13) | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2026 | 3.700 | (123) | (0,02) |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2026 | 400 | (16) | 0,00 |
| General Motors Co. | 5,000 | 20.12.2026 | 200 | (18) | 0,00 |
| International Lease Finance Corp. | 5,000 | 20.12.2023 | 900 | (20) | 0,00 |
| NextEra Energy Capital Holdings, Inc. | 1,000 | 20.06.2026 | 300 | (5) | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.12.2024 | € 2.200 | (103) | (0,02) |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.12.2025 | 500 | (39) | (0,01) |
| Ryder System, Inc. | 1,000 | 20.12.2023 | $ 1.100 | (11) | 0,00 |
| Sherwin-Williams Co. | 1,000 | 20.12.2022 | 1.600 | (8) | 0,00 |
| Stellantis NV | 5,000 | 20.06.2026 | € 1.100 | (87) | (0,01) |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20.06.2027 | $ 1.800 | (17) | 0,00 |
| Vodafone Group PLC | 1,000 | 20.06.2024 | € 1.200 | (6) | 0,00 |
| | | | | $ (617) | (0,09) |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF(2)

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Crossover 37 5-Year Index | 5,000 % | 20.06.2027 | € 500 | $ (27) | (0,01) |
| iTraxx Europe Main 36 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 1.300 | (9) | 0,00 |
| iTraxx Europe Main 37 10-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 19.700 | (363) | (0,05) |
| | | | | $ (399) | (0,06) |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 % | 21.09.2027 | £ 5.100 | $ (177) | (0,03) |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,399 | 18.06.2028 | ¥ 77.700 | 10 | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 | 15.06.2027 | $ 16.300 | 41 | 0,01 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2027 | 30.300 | (166) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,250 | 04.01.2027 | BRL 9.600 | (63) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,665 | 04.01.2027 | 32.800 | (143) | (0,02) |
| Zahlung[4] | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,000 | 14.11.2023 | CAD 30.500 | (340) | (0,06) |
| Zahlung[4] | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,050 | 16.11.2023 | 7.800 | (86) | (0,01) |
| Zahlung[4] | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,070 | 22.11.2023 | 11.900 | (131) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,250 | 15.06.2024 | 24.700 | (48) | (0,01) |
| Zahlung[4] | 3-Month USD-LIBOR | 1,270 | 04.11.2023 | $ 22.900 | (101) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,300 | 28.04.2027 | ZAR 68.300 | 119 | 0,02 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 % | 21.09.2027 | € | 7.300 | $ (75) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 11.05.2027 | | 4.400 | (203) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,700 | 11.04.2027 | | 1.300 | (57) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 13.05.2027 | | 3.200 | (104) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.05.2027 | | 1.500 | (49) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 1,250 | 19.09.2023 | HUF | 1.604.100 | (151) | (0,02) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,015 | 03.06.2026 | MXN | 100.900 | (229) | (0,03) |
| | | | | | | $ (1.953) | (0,29) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | | **$ (2.964)** | **(0,44)** |

(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 | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag(1) | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 % | 20.07.2022 | 1.500 | $ (2) | $ (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Crossover 36 5-Year Index | Verkauf | 5,250 | 20.07.2022 | 500 | (5) | (10) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 10.600 | (49) | (23) | (0,01) |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 1.500 | (4) | (5) | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 1.700 | (3) | (1) | 0,00 |
| BRC | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 400 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 2.600 | (12) | (6) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,600 | 17.08.2022 | 600 | (1) | (1) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 700 | (1) | (1) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 1.300 | (3) | (2) | 0,00 |
| GST | Call - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Kauf | 0,700 | 17.08.2022 | 700 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,300 | 17.08.2022 | 2.000 | (5) | (3) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 800 | (7) | (9) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,100 | 20.07.2022 | 2.900 | (11) | (11) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 900 | (3) | (3) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,250 | 20.07.2022 | 800 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,350 | 17.08.2022 | 1.400 | (3) | (2) | 0,00 |
| | | | | | | $ (115) | $ (82) | (0,01) |

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| DUB | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,350 % | 08.08.2022 | 1.700 | $ (6) | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,550 | 08.08.2022 | 1.700 | (7) | (34) | (0,01) |
| GLM | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,870 | 02.11.2022 | 85.800 | (174) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,270 | 02.11.2022 | 85.800 | (174) | (1.966) | (0,29) |
| | | | | | | | $ (361) | $ (2.001) | (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 | | Nenn-betrag[2] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2026 | $ | 100 | $ (3) | $ (2) | $ (5) | 0,00 |
| JPM | Hochtief AG | 5,000 | 20.12.2025 | € | 600 | 139 | (86) | 53 | 0,01 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.06.2023 | $ | 100 | (10) | 10 | 0 | 0,00 |
| MYC | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | | 1.500 | (93) | (33) | (126) | (0,02) |
| | | | | | | $ 33 | $ (111) | $ (78) | (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 | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | £ | 10.781 | $ | 13.631 | $ 538 | $ 0 | $ 538 | 0,08 |
| | 07.2022 | ZAR | 60.115 | | 3.997 | 334 | 0 | 334 | 0,05 |
| | 08.2022 | MXN | 1.990 | | 98 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 123 | IDR | 1.810.267 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 753 | NOK | 7.171 | 0 | (27) | (27) | (0,01) |
| BPS | 07.2022 | CAD | 351 | $ | 279 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 674 | | 710 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07.2022 | HUF | 22.494 | | 59 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 160.114 | € | 152.228 | 0 | (967) | (967) | (0,13) |
| | 07.2022 | | 782 | £ | 638 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 103 | MXN | 2.071 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 149.421 | $ | 157.447 | 947 | 0 | 947 | 0,14 |
| | 09.2022 | MXN | 2.071 | | 102 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11.2022 | $ | 22 | ZAR | 356 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | £ | 574 | $ | 700 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 209 | IDR | 3.086.508 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.319 | NOK | 12.906 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 1.105 | $ | 74 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | € | 186 | | 199 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 625 | BRL | 3.108 | 0 | (30) | (30) | (0,01) |
| DUB | 07.2022 | PLN | 49 | $ | 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | $ | 119 | ZAR | 1.919 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 11.2022 | | 21 | | 342 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| HUS | 07.2022 | AUD | 516 | $ | 373 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 07.2022 | CAD | 3.199 | | 2.534 | 54 | 0 | 54 | 0,01 |
| | 07.2022 | € | 152.051 | | 163.971 | 5.010 | 0 | 5.010 | 0,74 |
| | 07.2022 | MXN | 2.071 | | 100 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 355 | AUD | 516 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 534 | € | 506 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 516 | $ | 355 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 1.211 | CLP | 1.014.654 | 0 | (135) | (135) | (0,02) |
| JPM | 08.2022 | | 210 | IDR | 3.110.305 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 10.2022 | | 840 | COP | 3.503.969 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | BRL | 3.108 | $ | 603 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 133 | | 140 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 6 | | 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 5 | € | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 44 | £ | 36 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 598 | BRL | 3.108 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| RBC | 07.2022 | CAD | 285 | $ | 222 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 691 | MXN | 14.224 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | CAD | 211 | $ | 163 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 22.191 | | 1.462 | 110 | 0 | 110 | 0,02 |
| | 08.2022 | $ | 1.195 | CHF | 1.194 | 56 | 0 | 56 | 0,01 |
| | 11.2022 | ZAR | 71.073 | $ | 4.706 | 422 | 0 | 422 | 0,06 |
| TOR | 07.2022 | $ | 1.463 | CAD | 1.876 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 1.876 | $ | 1.463 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | HUF | 108.634 | | 310 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 454 | ZAR | 7.311 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 09.2022 | MXN | 20.664 | $ | 1.037 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 11.2022 | $ | 24 | ZAR | 380 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ 7.589 | $ (1.238) | $ 6.351 | 0,94 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 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 Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | € | 13.947 | $ | 14.973 | $ 392 | $ 0 | $ 392 | 0,06 |
| BPS | 07.2022 | | 174.728 | | 183.890 | 1.219 | 0 | 1.219 | 0,18 |
| | 07.2022 | $ | 1.517 | € | 1.420 | 0 | (32) | (32) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 163.197 | | 154.878 | 0 | (981) | (981) | (0,14) |
| CBK | 07.2022 | € | 6 | $ | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.257 | € | 1.171 | 0 | (33) | (33) | (0,01) |
| HUS | 07.2022 | € | 154.885 | $ | 162.939 | 1.014 | 0 | 1.014 | 0,15 |
| | 07.2022 | $ | 182.499 | € | 169.232 | 0 | (5.574) | (5.574) | (0,83) |
| | 08.2022 | | 163.228 | | 154.878 | 0 | (1.012) | (1.012) | (0,15) |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SCX | 07.2022 | $ 153.694 | € 143.477 | $ 0 | $ (3.696) | $ (3.696) | (0,54) |
| UAG | 07.2022 | 183.199 | 170.481 | 0 | (4.970) | (4.970) | (0,73) |
| | | | | $ 2.625 | $ (16.298) | $ (13.673) | (2,02) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | £ 14 | $ 17 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 12.353 | £ 9.770 | 0 | (488) | (488) | (0,07) |
| BPS | 07.2022 | £ 227 | $ 277 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 125 | £ 101 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | £ 1 | $ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 12.203 | £ 9.674 | 0 | (455) | (455) | (0,07) |
| CBK | 07.2022 | 52 | 41 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| HUS | 07.2022 | £ 127 | $ 156 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 15 | £ 12 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | £ 19 | $ 23 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | $ 12.253 | £ 9.719 | 0 | (450) | (450) | (0,07) |
| | | | | $ 5 | $ (1.398) | $ (1.393) | (0,21) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | $ 15.086 | NOK 142.392 | $ 0 | $ (674) | $ (674) | (0,10) |
| BRC | 07.2022 | NOK 138.337 | $ 14.111 | 109 | 0 | 109 | 0,02 |
| | 07.2022 | $ 15.087 | NOK 142.120 | 0 | (702) | (702) | (0,10) |
| | 08.2022 | 14.111 | 138.277 | 0 | (108) | (108) | (0,02) |
| CBK | 07.2022 | 14.782 | 139.297 | 0 | (682) | (682) | (0,10) |
| HUS | 07.2022 | 69 | 642 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | 3 | 33 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 109 | $ (2.170) | $ (2.061) | (0,30) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **$ (12.937)** | **(1,91)** |

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.07.2052 | $ 9.100 | $ (7.900) | (1,16) |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 | 6.600 | (5.937) | (0,88) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (13.837)** | **(2,04)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 663.730** | **97,82** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ 14.806** | **2,18** |
| **Nettovermögen** | | **$ 678.536** | **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.**

**(h) Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeits-datum | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Citigroup, Inc. | 2,014 % | 25.01.2026 | 18.01.2022 | $ 2.000 | $ 1.876 | 0,28 |
| Citigroup, Inc. | 3,290 | 17.03.2026 | 10.03.2022 | 3.200 | 3.098 | 0,46 |
| Deutsche Bank AG | 1,447 | 01.04.2025 | 30.03.2021 | 1.600 | 1.496 | 0,22 |
| Deutsche Bank AG | 2,129 | 24.11.2026 | 17.11.2020 | 500 | 445 | 0,07 |
| Oracle Corp. | 1,650 | 25.03.2026 | 22.03.2021 | 1.899 | 1.705 | 0,25 |
| | | | | $ 9.199 | $ 8.620 | 1,28 |

**Barmittel in Höhe von USD 11.664 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 12.077 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 667.528 | $ 0 | $ 667.528 |
| Investmentfonds | 25.307 | 0 | 0 | 25.307 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 683 | 0 | 683 |
| Finanzderivate[3] | (8) | (15.943) | 0 | (15.951) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (13.837) | 0 | (13.837) |
| **Summen** | **$ 25.299** | **$ 638.431** | **$ 0** | **$ 663.730** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 734.712 | $ 30 | $ 734.742 |
| Investmentfonds | 78.479 | 0 | 0 | 78.479 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 892 | 0 | 892 |
| Finanzderivate[3] | (188) | 3.284 | 0 | 3.096 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (15.770) | 0 | (15.770) |
| **Summen** | **$ 78.291** | **$ 723.118** | **$ 30** | **$ 801.439** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 29 | $ 0 | $ 29 |
| BPS | 189 | 0 | 189 |
| BRC | (1.170) | 1.030 | (140) |
| CBK | (744) | 800 | 56 |
| DUB | (36) | 0 | (36) |
| GLM | (1.970) | 2.096 | 126 |
| GST | (3) | 0 | (3) |
| HUS | (636) | 0 | (636) |
| JPM | 15 | (30) | (15) |
| MBC | 0 | 581 | 581 |
| MYC | (128) | (90) | (218) |
| RBC | 6 | 0 | 6 |
| SCX | (3.108) | 2.770 | (338) |
| TOR | (450) | 330 | (120) |
| UAG | (4.931) | 4.450 | (481) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 70,21 | 59,93 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 28,13 | 31,03 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 0,05 | 0,10 |
| Investmentfonds | 3,73 | 9,73 |
| Pensionsgeschäfte | 0,10 | 0,11 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,01) | (0,03) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,44) | (0,25) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (1,91) | 0,66 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (2,04) | (1,95) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | k. A. | (0,33) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 0,58 | 0,57 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 80,50 | 68,84 |
| Kommunalanleihen und Wechsel | 0,17 | 0,15 |
| US-Regierungsbehörden | 3,50 | 2,61 |
| US-Schatzobligationen | 9,38 | 6,35 |
| Non-Agency-MBS | 0,08 | 0,09 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 0,07 | 0,09 |
| Staatsemissionen | 3,53 | 2,11 |
| Stammaktien | 0,00 | 0,00 |
| Optionsscheine | 0,00 | 0,00 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,58 | 10,25 |
| Investmentfonds | 3,73 | 9,73 |
| Pensionsgeschäfte | 0,10 | 0,11 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,01) | (0,03) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf | 0,00 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,09) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,06) | 0,00 |
| Zinsswaps | (0,29) | (0,25) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,01) | (0,01) |
| Zinsswapoptionen | (0,30) | (0,05) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,01) | 0,01 |
| Devisenterminkontrakte | 0,94 | (0,24) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (2,53) | 0,95 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (2,04) | (1,95) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 2,18 | 0,67 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **AAdvantage Loyalty IP Ltd.** | | | | |
| 5,813 % fällig am 20.04.2028 | $ | 900 | $ 862 | 0,08 |
| **AmSurg Corp.** | | | | |
| TBD % fällig am 30.04.2027 µ | | 123 | 122 | 0,01 |
| TBD % fällig am 30.04.2027 | | 677 | 668 | 0,06 |
| 13,000 % fällig am 30.04.2028 | | 1.536 | 1.428 | 0,14 |
| **Caesars Resort Collection LLC** | | | | |
| 4,416 % fällig am 23.12.2024 | | 7.108 | 6.862 | 0,67 |
| 5,166 % fällig am 21.07.2025 | | 6.727 | 6.502 | 0,63 |
| **Carnival Corp.** | | | | |
| 3,750 % - 3,975 % fällig am 30.06.2025 | € | 3.430 | 3.326 | 0,32 |
| 6,127 % fällig am 18.10.2028 | $ | 771 | 694 | 0,07 |
| **Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,739 % fällig am 21.08.2026 | | 1.980 | 1.704 | 0,17 |
| **Emerald TopCo, Inc.** | | | | |
| 4,739 % - 5,166 % fällig am 24.07.2026 | | 73 | 68 | 0,01 |
| **iHeartCommunications, Inc.** | | | | |
| 4,666 % fällig am 01.05.2026 | | 6.420 | 5.978 | 0,58 |
| 4,916 % fällig am 01.05.2026 | | 2.229 | 2.077 | 0,20 |
| **INEOS Finance PLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.04.2024 | € | 7.126 | 7.131 | 0,69 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | |
| 4,920 % fällig am 01.02.2029 | $ | 930 | 853 | 0,08 |
| **Lealand Finance Company BV** | | | | |
| 4,666 % fällig am 28.06.2024 | | 8 | 5 | 0,00 |
| **Lealand Finance Company BV (2,666 % bar oder 3,000 % PIK)** | | | | |
| 2,666 % - 3,000 % fällig am 30.06.2025 (b) | | 23 | 12 | 0,00 |
| **Ortho-Clinical Diagnostics S.A.** | | | | |
| 4,553 % fällig am 30.06.2025 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Petco Health & Wellness Co., Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 03.03.2028 | | 4.967 | 4.689 | 0,46 |
| **PetSmart, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 11.02.2028 | | 3.871 | 3.649 | 0,35 |
| **PUG LLC** | | | | |
| 5,166 % fällig am 12.02.2027 | | 29 | 27 | 0,00 |
| **Sequa Mezzanine Holdings LLC** | | | | |
| 8,303 % fällig am 28.11.2023 | | 1.009 | 1.005 | 0,10 |
| **SkyMiles IP Ltd.** | | | | |
| 4,813 % fällig am 20.10.2027 | | 3.307 | 3.284 | 0,32 |
| **Sunshine Luxembourg SARL** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.10.2026 | | 1.729 | 1.606 | 0,16 |
| **Syniverse Holdings, Inc.** | | | | |
| 8,286 % fällig am 13.05.2027 | | 58 | 52 | 0,01 |
| **TransDigm, Inc.** | | | | |
| 3,916 % fällig am 30.05.2025 | | 5.461 | 5.203 | 0,50 |
| 3,916 % fällig am 09.12.2025 | | 8.712 | 8.295 | 0,81 |
| **Uber Technologies, Inc.** | | | | |
| 5,075 % fällig am 04.04.2025 | | 8.475 | 8.155 | 0,79 |
| **United Airlines, Inc.** | | | | |
| 5,392 % fällig am 21.04.2028 | | 1.585 | 1.476 | 0,14 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | | |
| 4,416 % fällig am 15.03.2024 | | 138 | 135 | 0,01 |
| **Westmoreland Coal Co. (15,000 % PIK)** | | | | |
| TBD % - 15,000 % fällig am 15.03.2029 (b) | | 13 | 8 | 0,00 |
| **Windstream Services LLC** | | | | |
| 7,916 % fällig am 21.09.2027 | | 3 | 3 | 0,00 |
| | | | 75.879 | 7,36 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **ADLER Group S.A.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 27.04.2027 | € | 8.300 | 4.217 | 0,41 |
| **Atrium Finance Issuer BV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.09.2027 | | 3.900 | 3.300 | 0,32 |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | |
| 2,528 % fällig am 18.11.2027 | $ | 1.389 | 1.133 | 0,11 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 1,875 % fällig am 09.01.2026 | € | 3.000 | $ 2.627 | 0,25 |
| 2,625 % fällig am 28.04.2025 | | 1.980 | 1.839 | 0,18 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (g)(i) | | 400 | 403 | 0,04 |
| **Banco de Credito del Peru S.A.** | | | | |
| 4,650 % fällig am 17.09.2024 | PEN | 600 | 146 | 0,01 |
| **Bank of Ireland Group PLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.09.2025 (g)(i) | € | 1.100 | 1.062 | 0,10 |
| 7,500 % fällig am 19.05.2025 (g)(i) | | 669 | 695 | 0,07 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (i) | $ | 3.452 | 3.487 | 0,34 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.03.2028 (g)(i) | | 3.200 | 2.462 | 0,24 |
| 6,125 % fällig am 15.12.2025 (g)(i) | | 2.011 | 1.870 | 0,18 |
| 6,375 % fällig am 15.12.2025 (g)(i) | £ | 650 | 728 | 0,07 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (g)(i) | | 1.800 | 2.155 | 0,21 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (g)(i) | $ | 800 | 788 | 0,08 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2022 (g)(i) | £ | 400 | 485 | 0,05 |
| **Bevco Lux SARL** | | | | |
| 1,000 % fällig am 16.01.2030 | € | 4.400 | 3.639 | 0,35 |
| **BGC Partners, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.12.2025 | $ | 1.200 | 1.171 | 0,11 |
| **Corsair International Ltd.** | | | | |
| 4,850 % fällig am 28.01.2027 | € | 1.000 | 987 | 0,10 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 4,194 % fällig am 01.04.2031 | $ | 5.000 | 4.429 | 0,43 |
| 5,250 % fällig am 11.02.2027 (g)(i) | | 1.800 | 1.395 | 0,14 |
| 6,375 % fällig am 21.08.2026 (g)(i) | | 1.000 | 829 | 0,08 |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (g)(i) | | 800 | 740 | 0,07 |
| 7,500 % fällig am 11.12.2023 (g)(i) | | 1.100 | 1.051 | 0,10 |
| **Cromwell Ereit Lux Finco SARL** | | | | |
| 2,125 % fällig am 19.11.2025 | € | 167 | 143 | 0,01 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 3,547 % fällig am 18.09.2031 | $ | 800 | 670 | 0,06 |
| **Doric Nimrod Air Alpha Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,250 % fällig am 30.05.2025 | | 63 | 62 | 0,01 |
| **Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.11.2024 | | 22 | 22 | 0,00 |
| **EPR Properties** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.12.2026 | | 8 | 7 | 0,00 |
| 4,950 % fällig am 15.04.2028 | | 34 | 31 | 0,00 |
| **Erste Group Bank AG** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.04.2024 (g)(i) | € | 200 | 204 | 0,02 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 03.03.2031 | CAD | 3.400 | 2.305 | 0,22 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 1,744 % fällig am 19.07.2024 | € | 100 | 97 | 0,01 |
| 2,700 % fällig am 10.08.2026 | $ | 2.600 | 2.219 | 0,22 |
| 2,979 % fällig am 03.08.2022 | | 500 | 500 | 0,05 |
| 3,021 % fällig am 06.03.2024 | € | 200 | 201 | 0,02 |
| 3,350 % fällig am 01.11.2022 | $ | 4.200 | 4.178 | 0,41 |
| 3,375 % fällig am 13.11.2025 | | 2.800 | 2.530 | 0,25 |
| 3,550 % fällig am 07.10.2022 | | 308 | 307 | 0,03 |
| 4,250 % fällig am 20.09.2022 | | 1.100 | 1.100 | 0,11 |
| 4,535 % fällig am 06.03.2025 | £ | 2.100 | 2.393 | 0,23 |
| 5,125 % fällig am 16.06.2025 | $ | 1.700 | 1.627 | 0,16 |
| **GLP Capital LP** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.01.2030 | | 100 | 88 | 0,01 |
| 5,300 % fällig am 15.01.2029 | | 3.888 | 3.722 | 0,36 |
| 5,750 % fällig am 01.06.2028 | | 500 | 489 | 0,05 |
| **Host Hotels & Resorts LP** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.09.2030 | | 731 | 625 | 0,06 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 2,848 % fällig am 04.06.2031 | | 5.900 | 4.990 | 0,48 |
| 4,950 % fällig am 31.03.2030 | | 1.320 | 1.305 | 0,13 |
| 5,250 % fällig am 16.09.2022 (g)(i) | € | 300 | 310 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 29.09.2023 (g)(i) | | 270 | 280 | 0,03 |
| **Huarong Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 24.02.2023 | $ | 1.600 | 1.564 | 0,15 |
| 3,875 % fällig am 13.11.2029 | | 1.340 | 1.070 | 0,10 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 5,750 % fällig am 16.11.2026 (g)(i) | | 1.100 | 1.007 | 0,10 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 7,750 % fällig am 11.01.2027 (g)(i) | € | 1.200 | 1.194 | 0,12 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 4,947 % fällig am 27.06.2025 (g)(i) | | 200 | 197 | 0,02 |
| 7,625 % fällig am 27.06.2023 (g)(i) | £ | 600 | 729 | 0,07 |
| **MPT Operating Partnership LP** | | | | |
| 3,692 % fällig am 05.06.2028 | £ | 100 | $ 105 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 01.08.2026 | $ | 260 | 246 | 0,02 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 4,302 % fällig am 08.03.2029 | | 2.100 | 2.012 | 0,20 |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 29.12.2025 (g)(i) | | 1.100 | 1.021 | 0,10 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.01.2023 | | 2.900 | 2.880 | 0,28 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | | |
| 2,924 % fällig am 28.09.2022 | | 1.600 | 1.595 | 0,15 |
| **Omega Healthcare Investors, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.10.2029 | | 62 | 53 | 0,01 |
| **OneMain Finance Corp.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.03.2023 | | 2.794 | 2.762 | 0,27 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2023 | | 587 | 585 | 0,06 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 24.06.2024 (g)(i) | £ | 4.169 | 4.886 | 0,47 |
| **Sitka Holdings LLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 06.07.2026 | $ | 3.131 | 3.031 | 0,29 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,269 % fällig am 15.12.2033 | € | 3.908 | 3.861 | 0,37 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 04.10.2023 (g)(i) | $ | 300 | 289 | 0,03 |
| 7,875 % fällig am 18.12.2023 (g)(i) | | 2.500 | 2.456 | 0,24 |
| **UBS AG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (i) | | 5.770 | 5.769 | 0,56 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 4,875 % fällig am 12.02.2027 (g)(i) | | 2.200 | 1.846 | 0,18 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | | 12.260 | 12.700 | 1,23 |
| **Unique Pub Finance Co. PLC** | | | | |
| 7,395 % fällig am 28.03.2024 | £ | 48 | 60 | 0,01 |
| **Uniti Group LP** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.02.2029 | $ | 1.875 | 1.379 | 0,13 |
| 7,875 % fällig am 15.02.2025 | | 7.504 | 7.264 | 0,70 |
| **VICI Properties LP** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.09.2026 | | 2.000 | 1.844 | 0,18 |
| 4,500 % fällig am 15.01.2028 | | 4.325 | 3.949 | 0,38 |
| 4,625 % fällig am 01.12.2029 | | 4.900 | 4.390 | 0,43 |
| | | | 142.787 | 13,86 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **Air Canada** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.08.2026 | | 1.800 | 1.526 | 0,15 |
| **Alaska Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,800 % fällig am 15.02.2029 | | 2.294 | 2.268 | 0,22 |
| **Altice France S.A.** | | | | |
| 8,125 % fällig am 01.02.2027 | | 3.400 | 3.135 | 0,30 |
| **American Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,375 % fällig am 01.11.2028 | | 65 | 58 | 0,01 |
| **American Airlines, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 20.04.2026 | | 8.398 | 7.745 | 0,75 |
| 5,750 % fällig am 20.04.2029 | | 700 | 600 | 0,06 |
| **Boeing Co.** | | | | |
| 5,705 % fällig am 01.05.2040 | | 1.014 | 948 | 0,09 |
| 5,805 % fällig am 01.05.2050 | | 664 | 611 | 0,06 |
| 5,930 % fällig am 01.05.2060 | | 787 | 718 | 0,07 |
| **Bombardier, Inc.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.03.2025 | | 4.750 | 4.306 | 0,42 |
| **British Airways Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.05.2034 | | 500 | 482 | 0,05 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 15.02.2031 | | 700 | 563 | 0,05 |
| 3,137 % fällig am 15.11.2035 | | 9 | 7 | 0,00 |
| 3,187 % fällig am 15.11.2036 | | 168 | 128 | 0,01 |
| 3,469 % fällig am 15.04.2034 | | 4.317 | 3.519 | 0,34 |
| 4,150 % fällig am 15.11.2030 | | 196 | 180 | 0,02 |
| 4,300 % fällig am 15.11.2032 | | 323 | 294 | 0,03 |
| 4,926 % fällig am 15.05.2037 | | 272 | 244 | 0,02 |
| **Carnival Corp.** | | | | |
| 10,500 % fällig am 01.02.2026 | | 900 | 898 | 0,09 |
| **Carvana Co.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.04.2027 | | 120 | 78 | 0,01 |
| 10,250 % fällig am 01.05.2030 | | 3.700 | 3.046 | 0,29 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **CDW LLC** | | | | |
| 2,670 % fällig am 01.12.2026 | $ | 6.460 | $ 5.768 | 0,56 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 4,800 % fällig am 01.03.2050 | | 140 | 111 | 0,01 |
| **Citrix Systems, Inc.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 01.03.2030 | | 56 | 55 | 0,01 |
| **CommScope, Inc.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 01.03.2027 | | 4.900 | 3.886 | 0,38 |
| **Community Health Systems, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.03.2027 | | 4.154 | 3.527 | 0,34 |
| 8,000 % fällig am 15.03.2026 | | 742 | 678 | 0,06 |
| **CoStar Group, Inc.** | | | | |
| 2,800 % fällig am 15.07.2030 | | 1.300 | 1.084 | 0,10 |
| **Delta Air Lines, Inc.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 01.05.2025 | | 682 | 691 | 0,07 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.12.2026 | | 1.720 | 1.351 | 0,13 |
| 5,750 % fällig am 01.12.2028 | | 2.520 | 1.871 | 0,18 |
| 5,875 % fällig am 15.07.2022 | | 10.800 | 10.772 | 1,04 |
| **Dufry One BV** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.10.2024 | € | 3.575 | 3.399 | 0,33 |
| 3,625 % fällig am 15.04.2026 | CHF | 4.753 | 4.401 | 0,43 |
| **Expedia Group, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.02.2030 | $ | 1.250 | 1.044 | 0,10 |
| 6,250 % fällig am 01.05.2025 | | 1.432 | 1.477 | 0,14 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK)** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.05.2027 (b) | € | 100 | 82 | 0,01 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.03.2030 | $ | 3.297 | 2.728 | 0,26 |
| **JetBlue Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.05.2034 | | 2.976 | 2.774 | 0,27 |
| **Las Vegas Sands Corp.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 18.08.2026 | | 100 | 87 | 0,01 |
| **Market Bidco Finco PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 04.11.2027 | € | 2.100 | 1.750 | 0,17 |
| **Marriott International, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.06.2030 | $ | 530 | 509 | 0,05 |
| **Melco Resorts Finance Ltd.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 17.07.2027 | | 900 | 605 | 0,06 |
| **Mileage Plus Holdings LLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 20.06.2027 | | 2.700 | 2.662 | 0,26 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | |
| 6,013 % fällig am 15.12.2030 | £ | 39 | 48 | 0,00 |
| **Motorola Solutions, Inc.** | | | | |
| 2,300 % fällig am 15.11.2030 | $ | 4.383 | 3.434 | 0,33 |
| **Netflix, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.06.2030 | € | 100 | 91 | 0,01 |
| 4,875 % fällig am 15.06.2030 | $ | 100 | 92 | 0,01 |
| 5,375 % fällig am 15.11.2029 | | 31 | 29 | 0,00 |
| **Nissan Motor Co. Ltd.** | | | | |
| 4,345 % fällig am 17.09.2027 | | 2.800 | 2.572 | 0,25 |
| 4,810 % fällig am 17.09.2030 | | 300 | 267 | 0,03 |
| **NMG Holding Co., Inc.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 01.04.2026 | | 400 | 370 | 0,04 |
| **Noble Finance Co. (11,000 % bar oder 15,000 % PIK)** | | | | |
| 11,000 % fällig am 15.02.2028 (b) | | 67 | 73 | 0,01 |
| **Petroleos de Venezuela S.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 16.05.2024 ^ | | 220 | 14 | 0,00 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 5,950 % fällig am 28.01.2031 | | 4.607 | 3.384 | 0,33 |
| 6,700 % fällig am 16.02.2032 | | 1.831 | 1.400 | 0,14 |
| 6,950 % fällig am 28.01.2060 | | 280 | 173 | 0,02 |
| 7,690 % fällig am 23.01.2050 | | 90 | 61 | 0,01 |
| **Prime Healthcare Services, Inc.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 01.11.2025 | | 6.355 | 5.443 | 0,53 |
| **Prosus NV** | | | | |
| 3,257 % fällig am 19.01.2027 | | 800 | 696 | 0,07 |
| **RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.** | | | | |
| 9,750 % fällig am 01.12.2026 | | 4.100 | 3.995 | 0,39 |
| **Rolls-Royce PLC** | | | | |
| 4,625 % fällig am 16.02.2026 | € | 3.000 | 2.954 | 0,29 |
| 5,750 % fällig am 15.10.2027 | £ | 1.700 | 1.948 | 0,19 |
| **Royal Caribbean Cruises Ltd.** | | | | |
| 9,125 % fällig am 15.06.2023 | $ | 300 | 297 | 0,03 |
| 10,875 % fällig am 01.06.2023 | | 339 | 341 | 0,03 |
| 11,500 % fällig am 01.06.2025 | | 1.325 | 1.365 | 0,13 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 2,550 % fällig am 08.03.2027 | $ | 1.700 | $ 1.241 | 0,12 |
| 3,100 % fällig am 08.03.2029 | | 400 | 284 | 0,03 |
| 3,800 % fällig am 08.01.2026 | | 2.100 | 1.686 | 0,16 |
| 4,875 % fällig am 18.06.2030 | | 200 | 146 | 0,01 |
| 5,125 % fällig am 08.08.2025 | | 600 | 504 | 0,05 |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028 | | 1.700 | 1.313 | 0,13 |
| **Seagate HDD Cayman** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.07.2031 | | 7.100 | 5.531 | 0,54 |
| 4,125 % fällig am 15.01.2031 | | 3.800 | 3.113 | 0,30 |
| **Spirit AeroSystems, Inc.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.06.2023 | | 4.600 | 4.319 | 0,42 |
| **Studio City Finance Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2029 | | 200 | 104 | 0,01 |
| **Surgery Center Holdings, Inc.** | | | | |
| 10,000 % fällig am 15.04.2027 | | 5.975 | 5.795 | 0,56 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 5,182 % fällig am 24.04.2028 | | 970 | 983 | 0,09 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.02.2026 | | 1.100 | 992 | 0,10 |
| **Topaz Solar Farms LLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.09.2039 | | 39 | 34 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 30.09.2039 | | 210 | 191 | 0,02 |
| **Transocean, Inc.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 01.11.2025 | | 138 | 102 | 0,01 |
| 7,500 % fällig am 15.01.2026 | | 96 | 69 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 01.02.2027 | | 113 | 76 | 0,01 |
| **U.S. Renal Care, Inc.** | | | | |
| 10,625 % fällig am 15.07.2027 | | 40 | 15 | 0,00 |
| **Uber Technologies, Inc.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.05.2025 | | 7.600 | 7.546 | 0,73 |
| 8,000 % fällig am 01.11.2026 | | 2.585 | 2.579 | 0,25 |
| **United Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,100 % fällig am 07.01.2030 | | 2.135 | 1.954 | 0,19 |
| 4,150 % fällig am 25.02.2033 | | 557 | 525 | 0,05 |
| 5,875 % fällig am 15.04.2029 | | 3.980 | 3.918 | 0,38 |
| **United Airlines, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.04.2026 | | 3.116 | 2.757 | 0,27 |
| 4,625 % fällig am 15.04.2029 | | 700 | 596 | 0,06 |
| **Valaris Ltd. (8,250 % bar oder 12,000 % PIK)** | | | | |
| 8,250 % fällig am 30.04.2028 (b) | | 19 | 19 | 0,00 |
| **Venture Global Calcasieu Pass LLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.08.2029 | | 300 | 263 | 0,02 |
| 4,125 % fällig am 15.08.2031 | | 300 | 257 | 0,02 |
| **Viking Cruises Ltd.** | | | | |
| 13,000 % fällig am 15.05.2025 | | 2.600 | 2.668 | 0,26 |
| **VMware, Inc.** | | | | |
| 4,700 % fällig am 15.05.2030 | | 4.900 | 4.729 | 0,46 |
| **VOC Escrow Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.02.2028 | | 2.600 | 2.093 | 0,20 |
| **Weir Group PLC** | | | | |
| 2,200 % fällig am 13.05.2026 | | 1.600 | 1.409 | 0,14 |
| **Western Midstream Operating LP** | | | | |
| 2,621 % fällig am 13.01.2023 | | 38 | 38 | 0,00 |
| **Windstream Escrow LLC** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.08.2028 | | 2.373 | 1.917 | 0,19 |
| **Wynn Las Vegas LLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.05.2027 | | 1.700 | 1.458 | 0,14 |
| 5,500 % fällig am 01.03.2025 | | 3.600 | 3.301 | 0,32 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2026 | | 1.000 | 694 | 0,07 |
| 5,625 % fällig am 26.08.2028 | | 2.700 | 1.671 | 0,16 |
| **Wynn Resorts Finance LLC** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.04.2025 | | 7.897 | 7.696 | 0,75 |
| | | | 186.299 | 18,08 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC** | | | | |
| 2,950 % fällig am 15.04.2025 | € | 11.000 | 3.450 | 0,33 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | | |
| 6,720 % fällig am 01.12.2022 ^ | $ | 1 | 1 | 0,00 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | | |
| 1,367 % fällig am 10.03.2023 | | 6.883 | 6.780 | 0,66 |
| 2,100 % fällig am 01.08.2027 | | 3.785 | 3.176 | 0,31 |
| 2,950 % fällig am 01.03.2026 ^ | | 1.797 | 1.635 | 0,16 |
| 3,150 % fällig am 01.01.2026 | | 4.474 | 4.102 | 0,40 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 3,250 % fällig am 15.06.2023 ^ | $ | 424 | $ 418 | 0,04 |
| 3,300 % fällig am 15.03.2027 ^ | | 773 | 693 | 0,07 |
| 3,300 % fällig am 01.12.2027 ^ | | 4.700 | 4.108 | 0,40 |
| 3,400 % fällig am 15.08.2024 ^ | | 2.173 | 2.090 | 0,20 |
| 3,500 % fällig am 15.06.2025 ^ | | 1.437 | 1.362 | 0,13 |
| 3,750 % fällig am 15.02.2024 ^ | | 1.490 | 1.457 | 0,14 |
| 3,750 % fällig am 01.07.2028 ^ | | 1.459 | 1.289 | 0,13 |
| 3,750 % fällig am 15.08.2042 | | 12 | 8 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 01.12.2046 ^ | | 2 | 1 | 0,00 |
| 4,300 % fällig am 15.03.2045 ^ | | 61 | 44 | 0,00 |
| 4,450 % fällig am 15.04.2042 ^ | | 66 | 50 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 01.07.2040 | | 110 | 85 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 15.12.2041 ^ | | 26 | 19 | 0,00 |
| 4,550 % fällig am 01.07.2030 | | 1.217 | 1.083 | 0,11 |
| 4,600 % fällig am 15.06.2043 ^ | | 10 | 8 | 0,00 |
| 4,750 % fällig am 15.02.2044 ^ | | 39 | 30 | 0,00 |
| 4,950 % fällig am 01.07.2050 | | 1.381 | 1.105 | 0,11 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.11.2022 | | 4.713 | 4.748 | 0,46 |
| **Sprint Corp.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.06.2024 | | 6.710 | 6.907 | 0,67 |
| | | | 44.649 | 4,33 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 373.735 | 36,27 |
| **WANDELANLEIHEN & WECHSEL** | | | | |
| **DISH Network Corp.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.03.2024 | | 600 | 530 | 0,05 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Ginnie Mae, TBA** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 | | 2.500 | 2.289 | 0,22 |
| 3,500 % fällig am 01.07.2052 | | 5.000 | 4.859 | 0,47 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2052 | | 2.700 | 2.689 | 0,26 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2052 | | 8.700 | 8.797 | 0,85 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.11.2047 | | 101 | 99 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 01.03.2049 | | 601 | 601 | 0,06 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 | | 40.500 | 36.434 | 3,54 |
| 3,000 % fällig am 01.08.2052 | | 22.100 | 20.567 | 2,00 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2052 | | 104.750 | 100.650 | 9,77 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2052 | | 111.700 | 109.992 | 10,67 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2052 | | 4.000 | 4.008 | 0,39 |
| | | | 290.985 | 28,24 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.05.2049 | | 4.900 | 4.571 | 0,45 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (f)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2030 | | 2.841 | 2.711 | 0,26 |
| 0,250 % fällig am 15.07.2029 | | 4.748 | 4.607 | 0,45 |
| 0,250 % fällig am 15.02.2050 | | 1.237 | 978 | 0,10 |
| 0,375 % fällig am 15.01.2027 | | 212 | 211 | 0,02 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2027 | | 59 | 59 | 0,01 |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 | | 1.117 | 1.126 | 0,11 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2042 | | 384 | 351 | 0,03 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2045 | | 982 | 881 | 0,09 |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 | | 2.262 | 2.285 | 0,22 |
| 0,875 % fällig am 15.02.2047 | | 1.557 | 1.441 | 0,14 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2046 | | 610 | 579 | 0,06 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2048 | | 1.641 | 1.570 | 0,15 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2049 | | 3.228 | 3.113 | 0,30 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 | | 124 | 127 | 0,01 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2040 | | 267 | 313 | 0,03 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2041 | | 132 | 154 | 0,01 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 2,375 % fällig am 31.03.2029 | | 15.600 | 14.935 | 1,45 |
| 2,875 % fällig am 15.05.2032 | | 6.600 | 6.527 | 0,63 |
| | | | 46.539 | 4,52 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **20 Times Square Trust** | | | | |
| 3,203 % fällig am 15.05.2035 | | 3.800 | 3.685 | 0,36 |
| **225 Liberty Street Trust** | | | | |
| 4,803 % fällig am 10.02.2036 | | 1.023 | 931 | 0,09 |
| **280 Park Avenue Mortgage Trust** | | | | |
| 2,071 % fällig am 15.09.2034 | | 3.300 | 3.241 | 0,32 |
| 2,271 % fällig am 15.09.2034 | | 5.800 | 5.641 | 0,55 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Ashford Hospitality Trust** | | | | |
| 2,775 % fällig am 15.06.2035 | $ | 100 | $ 96 | 0,01 |
| 3,175 % fällig am 15.06.2035 | | 4.100 | 3.902 | 0,38 |
| 4,075 % fällig am 15.06.2035 | | 100 | 94 | 0,01 |
| **Atrium Hotel Portfolio Trust** | | | | |
| 2,254 % fällig am 15.12.2036 | | 2.450 | 2.385 | 0,23 |
| 2,754 % fällig am 15.06.2035 | | 288 | 274 | 0,03 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 3,011 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 2.317 | 1.070 | 0,10 |
| **BX Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 15.11.2032 | | 950 | 918 | 0,09 |
| 2,774 % fällig am 15.11.2032 | | 2.000 | 1.910 | 0,19 |
| 3,094 % fällig am 15.05.2035 | | 955 | 912 | 0,09 |
| **Canada Square Funding PLC** | | | | |
| 1,379 % fällig am 17.01.2059 | £ | 12.788 | 15.204 | 1,48 |
| **ChaseFlex Trust** | | | | |
| 2,304 % fällig am 25.05.2037 | $ | 17 | 16 | 0,00 |
| **Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates** | | | | |
| 1,172 % fällig am 25.08.2035 | | 1.537 | 1.259 | 0,12 |
| **Citigroup Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 2,674 % fällig am 15.12.2036 | | 2.500 | 2.383 | 0,23 |
| 3,635 % fällig am 10.05.2035 | | 15.420 | 14.943 | 1,45 |
| **Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 2,324 % fällig am 15.09.2033 | | 2.300 | 2.189 | 0,21 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,084 % fällig am 25.03.2036 | | 45 | 45 | 0,00 |
| 2,124 % fällig am 25.12.2046 | | 2.294 | 1.962 | 0,19 |
| 3,219 % fällig am 25.08.2035 | | 1.276 | 1.156 | 0,11 |
| 6,250 % fällig am 25.04.2037 | | 1.543 | 864 | 0,08 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 | | 2.381 | 860 | 0,08 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Trust** | | | | |
| 3,224 % fällig am 15.07.2032 | | 15.277 | 14.340 | 1,39 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | |
| 1,775 % fällig am 16.12.2069 | £ | 382 | 462 | 0,05 |
| **GS Mortgage Securities Corp. Trust** | | | | |
| 3,424 % fällig am 15.07.2025 | $ | 12.240 | 11.445 | 1,11 |
| **GS Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 3,750 % fällig am 25.10.2057 | | 4.981 | 4.912 | 0,48 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,802 % fällig am 19.09.2037 | | 1.815 | 1.667 | 0,16 |
| **Harbour Energy PLC** | | | | |
| 1,305 % fällig am 28.01.2054 | £ | 5.284 | 6.342 | 0,62 |
| 1,405 % fällig am 28.01.2054 | | 3.247 | 3.844 | 0,37 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | | |
| 1,703 % fällig am 25.05.2053 | | 2.469 | 2.993 | 0,29 |
| **Hilton Orlando Trust** | | | | |
| 2,774 % fällig am 15.12.2034 | $ | 7.500 | 7.193 | 0,70 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | | |
| 2,434 % fällig am 25.10.2035 | | 100 | 97 | 0,01 |
| **InTown Hotel Portfolio Trust** | | | | |
| 2,425 % fällig am 15.01.2033 | | 480 | 478 | 0,05 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 3,524 % fällig am 15.02.2035 | | 3.050 | 2.914 | 0,28 |
| **Lanebrook Mortgage Transaction PLC** | | | | |
| 2,602 % fällig am 12.06.2057 | £ | 4.282 | 5.183 | 0,50 |
| **Morgan Stanley Capital Trust** | | | | |
| 2,974 % fällig am 15.07.2035 | $ | 7.056 | 6.723 | 0,65 |
| 3,274 % fällig am 15.07.2035 | | 3.014 | 2.858 | 0,28 |
| **Natixis Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 3,917 % fällig am 15.11.2032 | | 6.753 | 6.659 | 0,65 |
| **PHH Alternative Mortgage Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 | | 4.265 | 3.649 | 0,35 |
| **Precise Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,870 % fällig am 16.10.2056 | £ | 1.071 | 1.287 | 0,13 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 2,124 % fällig am 25.08.2037 | $ | 460 | 420 | 0,04 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | | |
| 6,609 % fällig am 25.02.2037 | | 10.845 | 3.373 | 0,33 |
| **Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust** | | | | |
| 6,250 % fällig am 25.08.2036 | | 1.184 | 1.058 | 0,10 |
| **RESIMAC Bastille Trust** | | | | |
| 1,733 % fällig am 05.09.2057 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **RMAC PLC** | | | | |
| 1,571 % fällig am 12.06.2046 | £ | 5.496 | 6.635 | 0,64 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,873 % fällig am 25.09.2034 | $ | 238 | $ 231 | 0,02 |
| **Taurus FR DAC** | | | | |
| 0,900 % fällig am 02.02.2031 | € | 1.695 | 1.753 | 0,17 |
| **TBW Mortgage-Backed Trust** | | | | |
| 5,965 % fällig am 25.07.2037 | $ | 120 | 45 | 0,00 |
| **Tharaldson Hotel Portfolio Trust** | | | | |
| 2,170 % fällig am 11.11.2034 | | 227 | 220 | 0,02 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,115 % fällig am 25.12.2042 | | 90 | 87 | 0,01 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2045 | £ | 1.498 | 1.817 | 0,18 |
| 1,547 % fällig am 20.02.2045 | | 2.120 | 2.568 | 0,25 |
| 1,605 % fällig am 20.10.2051 | | 3.850 | 4.661 | 0,45 |
| 1,827 % fällig am 20.02.2054 | | 2.239 | 2.720 | 0,26 |
| **Trinidad Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 1,404 % fällig am 24.01.2059 | | 14 | 17 | 0,00 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | |
| 1,632 % fällig am 12.09.2050 | | 2.336 | 2.822 | 0,27 |
| **Verus Securitization Trust** | | | | |
| 1,977 % fällig am 25.03.2060 | $ | 195 | 192 | 0,02 |
| 3,035 % fällig am 25.03.2060 | | 100 | 98 | 0,01 |
| 3,889 % fällig am 25.03.2060 | | 200 | 198 | 0,02 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,384 % fällig am 25.01.2045 | | 92 | 90 | 0,01 |
| 3,036 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 812 | 767 | 0,08 |
| | | | 178.858 | 17,36 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,064 % fällig am 25.05.2037 | | 8.496 | 1.732 | 0,17 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 3,574 % fällig am 25.06.2034 | | 1.784 | 1.720 | 0,17 |
| **Amortizing Residential Collateral Trust** | | | | |
| 2,324 % fällig am 25.10.2031 | | 200 | 192 | 0,02 |
| **Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,389 % fällig am 25.10.2035 | | 100 | 91 | 0,01 |
| **Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,089 % fällig am 25.05.2036 | | 6.856 | 6.406 | 0,62 |
| **Bayview Financial Asset Trust** | | | | |
| 3,124 % fällig am 25.03.2037 | | 493 | 494 | 0,05 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,614 % fällig am 25.06.2035 | | 4.273 | 4.166 | 0,40 |
| **College Avenue Student Loans LLC** | | | | |
| 2,824 % fällig am 26.12.2047 | | 25 | 24 | 0,00 |
| 4,130 % fällig am 26.12.2047 | | 25 | 24 | 0,00 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 2,824 % fällig am 25.10.2035 | | 1.288 | 1.258 | 0,12 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.06.2047 | | 2.082 | 1.931 | 0,19 |
| 1,834 % fällig am 25.05.2047 ^ | | 6.836 | 6.480 | 0,63 |
| **Denali Capital CLO Ltd.** | | | | |
| 2,094 % fällig am 15.04.2031 | | 1.798 | 1.763 | 0,17 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | | |
| 2,004 % fällig am 25.03.2036 | | 2.488 | 1.083 | 0,11 |
| **Harvest SBA Loan Trust** | | | | |
| 3,256 % fällig am 25.08.2044 | | 318 | 318 | 0,03 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.12.2036 | | 9.566 | 8.271 | 0,80 |
| 1,814 % fällig am 25.01.2037 | | 3.094 | 2.317 | 0,23 |
| **IXIS Real Estate Capital Trust** | | | | |
| 2,084 % fällig am 25.01.2037 | | 3.472 | 1.413 | 0,14 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 1,884 % fällig am 25.06.2037 | | 858 | 855 | 0,08 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 2,774 % fällig am 25.12.2037 | | 1.469 | 1.508 | 0,15 |
| 6,500 % fällig am 25.06.2046 | | 54 | 47 | 0,00 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,904 % fällig am 25.06.2036 | | 533 | 502 | 0,05 |
| 2,224 % fällig am 25.01.2036 | | 3.377 | 3.121 | 0,30 |
| **Man GLG Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,740 % fällig am 15.10.2030 | € | 3.000 | 3.097 | 0,30 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.08.2037 | $ | 400 | 375 | 0,04 |
| 1,904 % fällig am 25.05.2037 | | 4.687 | 2.775 | 0,27 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 1,824 % fällig am 25.05.2037 | $ | 1.027 | $ 615 | 0,06 |
| 1,924 % fällig am 25.06.2036 | | 1.938 | 1.692 | 0,16 |
| 2,539 % fällig am 25.03.2035 | | 323 | 320 | 0,03 |
| 3,049 % fällig am 25.01.2035 | | 1.330 | 1.155 | 0,11 |
| **Oak Hill European Credit Partners DAC** | | | | |
| 0,730 % fällig am 20.01.2032 | € | 2.798 | 2.875 | 0,28 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,049 % fällig am 25.11.2034 | $ | 939 | 907 | 0,09 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 3,199 % fällig am 25.02.2035 | | 9.354 | 9.208 | 0,89 |
| **Pretium Mortgage Credit Partners LLC** | | | | |
| 2,487 % fällig am 25.07.2051 | | 3.036 | 2.853 | 0,28 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | | |
| 2,704 % fällig am 25.03.2035 | | 2.000 | 1.904 | 0,19 |
| **SoFi Professional Loan Program LLC** | | | | |
| 2,630 % fällig am 25.07.2040 | | 558 | 553 | 0,05 |
| **Starwood Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 2,528 % fällig am 15.07.2038 | | 8.161 | 8.099 | 0,79 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 2,344 % fällig am 25.01.2036 | | 575 | 559 | 0,05 |
| 2,624 % fällig am 25.09.2034 | | 579 | 552 | 0,05 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,854 % fällig am 25.05.2047 | | 230 | 222 | 0,02 |
| 2,599 % fällig am 25.05.2035 | | 3.900 | 3.730 | 0,36 |
| **Terwin Mortgage Trust** | | | | |
| 3,004 % fällig am 25.03.2035 | | 406 | 379 | 0,04 |
| | | | 87.586 | 8,50 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 09.07.2030 | | 2.796 | 603 | 0,06 |
| 1,000 % fällig am 09.07.2029 | | 120 | 28 | 0,00 |
| 1,125 % fällig am 09.07.2035 | | 1.732 | 363 | 0,04 |
| 2,500 % fällig am 09.07.2041 | | 3.129 | 814 | 0,08 |
| 15,500 % fällig am 17.10.2026 | ARS | 1.188 | 1 | 0,00 |
| 47,331 % fällig am 04.10.2022 | | 460 | 0 | 0,00 |
| **Argentina Treasury Bond BONCER** | | | | |
| 1,400 % fällig am 25.03.2023 | | 167.395 | 614 | 0,06 |
| **Australia Government International Bond** | | | | |
| 1,750 % fällig am 21.06.2051 | AUD | 2.500 | 1.094 | 0,11 |
| **Autonomous City of Buenos Aires Argentina** | | | | |
| 53,715 % fällig am 29.03.2024 (a) | ARS | 610 | 2 | 0,00 |
| **Colombia Government International Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 26.02.2024 | $ | 2.459 | 2.395 | 0,23 |
| **Israel Government International Bond** | | | | |
| 4,500 % fällig am 03.04.2120 | | 200 | 182 | 0,02 |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,350 % fällig am 12.08.2040 | PEN | 1.489 | 294 | 0,03 |
| 5,400 % fällig am 12.08.2034 | | 12 | 3 | 0,00 |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | | 5.046 | 1.214 | 0,12 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 4.688 | 1.091 | 0,11 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 | | 1.294 | 321 | 0,03 |
| 6,950 % fällig am 12.08.2031 | | 135 | 34 | 0,00 |
| 8,200 % fällig am 12.08.2026 | | 2.424 | 667 | 0,07 |
| **Provincia de Buenos Aires** | | | | |
| 49,102 % fällig am 12.04.2025 | ARS | 6.240 | 21 | 0,00 |
| **Romania Government International Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 14.04.2033 | € | 4.100 | 2.791 | 0,27 |
| 3,750 % fällig am 07.02.2034 | | 2.400 | 1.886 | 0,18 |
| **Russia Government International Bond** | | | | |
| 4,250 % fällig am 23.06.2027 ^ | $ | 5.400 | 1.485 | 0,14 |
| 7,150 % fällig am 12.11.2025 ^ | RUB | 19.414 | 32 | 0,00 |
| 7,950 % fällig am 07.10.2026 ^ | | 13.158 | 22 | 0,00 |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 8,000 % fällig am 31.01.2030 | ZAR | 5.500 | 292 | 0,03 |
| 8,250 % fällig am 31.03.2032 | | 7.600 | 389 | 0,04 |
| 8,750 % fällig am 28.02.2048 | | 2.000 | 94 | 0,01 |
| 8,875 % fällig am 28.02.2035 | | 5.500 | 281 | 0,03 |
| 10,500 % fällig am 21.12.2026 | | 204.800 | 13.238 | 1,28 |
| **Turkey Government International Bond** | | | | |
| 4,250 % fällig am 13.03.2025 | $ | 1.200 | 1.033 | 0,10 |
| 4,625 % fällig am 31.03.2025 | € | 100 | 97 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 13.03.2030 | $ | 1.000 | 717 | 0,07 |
| 5,750 % fällig am 11.05.2047 | | 741 | 458 | 0,04 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| Venezuela Government International Bond | | | |
| 8,250 % fällig am 13.10.2024 ^ | $ 2.000 | $ 170 | 0,02 |
| 9,000 % fällig am 07.05.2023 ^ | 1.600 | 136 | 0,01 |
| | | 32.862 | 3,19 |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (c) | 173.174 | 185 | 0,02 |
| iHeartMedia, Inc. 'A' (c) | 41.444 | 327 | 0,03 |
| iHeartMedia, Inc. 'B' (c) | 32.182 | 229 | 0,02 |
| | | 741 | 0,07 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Neiman Marcus Group Ltd. LLC (c)(k) | 5.145 | 889 | 0,09 |
| **ENERGIE** | | | |
| Noble Corp. (c)(k) | 25.168 | 638 | 0,06 |
| Valaris Ltd. (c) | 1.580 | 67 | 0,01 |
| | | 705 | 0,07 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **FINANZWERTE** | | | |
| Intelsat Emergence S .A. (c)(k) | 45.479 | $ 1.273 | 0,12 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Westmoreland Mining Holdings LLC (c)(k) | 231 | 0 | 0,00 |
| | | 3.608 | 0,35 |
| **RECHTE** | | | |
| Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 5. Dezember 2025 | 9.740 | 48 | 0,00 |
| **OPTIONSSCHEINE** | | | |
| Intelsat Emergence S.A. - Exp - 17/02/2027 | 661 | 2 | 0,00 |
| Windstream Holdings II, LLC - Exp. 21. September 2055 | 361 | 8 | 0,00 |
| | | 10 | 0,00 |
| **REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS** | | | |
| CBL & Associates Properties, Inc. | 174 | 4 | 0,00 |
| Uniti Group, Inc. | 284 | 3 | 0,00 |
| | | 7 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | |
| 51,049 % fällig am 30.09.2022 (d)(e) | ARS 115.100 | $ 386 | 0,04 |
| **U.S. TREASURY BILLS** | | | |
| 0,716 % fällig am 26.07.2022 (d)(e) | $ 76.500 | 76.446 | 7,42 |
| 0,797 % fällig am 14.07.2022 (d)(e) | 11.500 | 11.496 | 1,11 |
| 0,904 % fällig am 28.07.2022 (d)(e)(l) | 26.100 | 26.079 | 2,53 |
| 1,089 % fällig am 23.08.2022 (d)(e)(l) | 12.300 | 12.273 | 1,19 |
| | | 126.294 | 12,25 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 126.680 | 12,29 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | **$1.217.327** | **118,13** |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h) | 7.447.559 | 74.088 | 7,19 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$74.088** | **7,19** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 4.712 | U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | $ (4.806) | $ 4.712 | $ 4.712 | 0,46 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (4.806)** | **$ 4.712** | **$ 4.712** | **0,46** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bobl September Futures | Long | 09.2022 | 30 | $ (2) | 0,00 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Long | 09.2022 | 80 | (264) | (0,03) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 73 | 328 | 0,03 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 81 | 50 | 0,01 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 760 | 734 | 0,07 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Long | 09.2022 | 23 | (41) | 0,00 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 26 | 40 | 0,00 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2022 | 82 | 228 | 0,02 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09.2022 | 2 | 10 | 0,00 |
| | | | | $ 1.083 | 0,10 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CME Kaufoptionen mit Ausübungskurs von @ EUR 98,000 auf 3-Month SOFR December Futures | $ 98,000 | 15.12.2023 | 50 | $ (40) | $ (40) | 0,00 |
| Call - CME Verkaufoptionen mit Ausübungskurs von @ EUR 96,500 auf 3-Month SOFR December Futures | 96,500 | 15.12.2023 | 50 | (47) | (62) | (0,01) |
| | | | | $ (87) | $ (102) | (0,01) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ 981** | **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 | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Airbus Group Finance BV | 1,000 % | 20.12.2025 | € 7.600 | $ 88 | 0,01 |
| Airbus Group Finance BV | 1,000 | 20.06.2026 | 3.100 | (95) | (0,01) |
| Airbus Group Finance BV | 1,000 | 20.06.2028 | 200 | (9) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.06.2025 | $ 700 | 19 | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.12.2025 | 2.500 | (35) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.06.2026 | 4.700 | (82) | (0,01) |
| Barclays Bank PLC | 1,000 | 20.12.2022 | € 1.200 | (5) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.12.2022 | $ 1.600 | (1) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.06.2023 | 2.900 | (23) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.12.2026 | 2.500 | (125) | (0,01) |
| Bombardier, Inc. | 5,000 | 20.06.2024 | 200 | (1) | 0,00 |
| Bombardier, Inc. | 5,000 | 20.06.2025 | 100 | (1) | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.06.2028 | € 2.700 | (89) | (0,01) |
| Devon Energy Corp. | 1,000 | 20.12.2026 | $ 1.500 | (35) | 0,00 |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20.12.2024 | 2.600 | (149) | (0,01) |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.06.2025 | 100 | 0 | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.06.2026 | 100 | (1) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.06.2027 | 200 | (5) | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2023 | 400 | 30 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2026 | 6.500 | (162) | (0,02) |
| General Motors Co. | 5,000 | 20.12.2026 | 1.700 | (157) | (0,01) |
| Lennar Corp. | 5,000 | 20.12.2026 | 600 | (59) | (0,01) |
| MGM Resorts International | 5,000 | 20.06.2026 | 300 | (38) | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.12.2025 | € 2.600 | 37 | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.12.2026 | 800 | (70) | (0,01) |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.06.2027 | 1.500 | (93) | (0,01) |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20.06.2026 | $ 3.000 | (79) | (0,01) |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20.12.2026 | 400 | (13) | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20.06.2027 | 4.500 | (54) | (0,01) |
| | | | | $ (1.207) | (0,12) |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-31 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 752 | $ (35) | 0,00 |
| CDX.EM-32 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2024 | 558 | (26) | 0,00 |
| CDX.EM-34 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2025 | 1.300 | (120) | (0,01) |
| CDX.EM-36 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 19.200 | (1.677) | (0,16) |
| CDX.HY-36 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2026 | 7.029 | (687) | (0,07) |
| CDX.HY-37 5-Year Index | 5,000 | 20.12.2026 | 2.277 | (153) | (0,02) |
| CDX.HY-38 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2027 | 42.768 | (1.960) | (0,19) |
| CDX.IG-38 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 2.600 | (37) | 0,00 |
| iTraxx Asia Ex-Japan 37 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 3.500 | (47) | (0,01) |
| iTraxx Crossover 37 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2027 | € 500 | (27) | 0,00 |
| iTraxx Europe Main 34 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2025 | 6.800 | (165) | (0,02) |
| iTraxx Europe Main 36 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 4.300 | (29) | 0,00 |
| iTraxx Europe Main 37 10-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 13.400 | (200) | (0,02) |
| | | | | $ (5.163) | (0,50) |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 % | 16.03.2042 | £ 1.400 | $ 430 | 0,04 |
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2052 | 17.200 | 6.255 | 0,61 |
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 1,060 | 21.02.2052 | 300 | (87) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 1,096 | 14.02.2052 | 600 | (168) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 1,101 | 21.02.2052 | 300 | (83) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 1,175 | 28.02.2052 | 600 | (155) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 15.03.2029 | ¥ 8.473.000 | 912 | 0,09 |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,176 | 27.04.2027 | 550.000 | (7) | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,400 | 15.06.2032 | 2.140.000 | 148 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,500 | 15.03.2042 | 1.140.000 | 222 | 0,02 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,711 | 27.04.2042 | 140.000 | 31 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 | 15.06.2027 | $ 3.600 | 155 | 0,02 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 | 15.06.2029 | 4.070 | 222 | 0,02 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,250 | 15.06.2032 | 19.510 | (956) | (0,09) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,250 | 15.06.2032 | 3.180 | (307) | (0,03) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,650 | 08.02.2032 | 1.700 | (148) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,730 | 24.02.2032 | 1.600 | (130) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2025 | 38.000 | 134 | 0,01 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2032 | 2.700 | (134) | (0,01) |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 % | 15.06.2052 | $ 12.400 | $ 1.241 | 0,12 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2052 | 15.700 | 313 | 0,03 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,765 | 16.03.2032 | 600 | (47) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,783 | 22.04.2027 | 2.100 | (83) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,788 | 03.05.2027 | 2.300 | (92) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,250 | 17.06.2027 | 5.600 | (115) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,385 | 08.06.2032 | 1.400 | 34 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,436 | 08.06.2032 | 6.800 | 139 | 0,01 |
| Erhalt[3] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,450 | 04.10.2027 | 5.430 | 94 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,451 | 08.06.2032 | 8.700 | 168 | 0,02 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,605 | 28.06.2027 | 3.900 | (13) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,830 | 02.01.2023 | BRL 5.100 | (17) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,836 | 02.01.2023 | 4.600 | (15) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,855 | 02.01.2023 | 1.500 | (5) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,140 | 02.01.2025 | 100 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,160 | 02.01.2025 | 100 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,220 | 04.01.2027 | 200 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,245 | 04.01.2027 | 100 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,260 | 04.01.2027 | 100 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,350 | 02.01.2025 | 100 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,715 | 04.01.2027 | 200 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,870 | 04.01.2027 | 500 | (2) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,000 | 02.01.2025 | 300 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,015 | 04.01.2027 | 57.400 | (146) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,080 | 02.01.2025 | 500 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,140 | 02.01.2025 | 300 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,145 | 02.01.2025 | 300 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,160 | 02.01.2025 | 500 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,670 | 02.01.2023 | 400 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,690 | 02.01.2023 | 300 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,740 | 02.01.2023 | 700 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,750 | 02.01.2023 | 300 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,760 | 02.01.2023 | 800 | 1 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,900 | 02.01.2023 | 1.500 | 1 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,930 | 02.01.2023 | 200 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,939 | 02.01.2023 | 800 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,946 | 02.01.2023 | 2.000 | 1 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,960 | 02.01.2023 | 1.500 | 1 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,970 | 02.01.2023 | 2.600 | 1 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,500 | 16.06.2026 | $ 88.900 | 6.571 | 0,64 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,500 | 16.06.2028 | 10.869 | (969) | (0,09) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,750 | 16.06.2031 | 76.933 | (6.902) | (0,67) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,928 | 06.05.2026 | 2.200 | 175 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,940 | 08.06.2026 | 2.900 | 229 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,000 | 16.12.2030 | 20.713 | 3.760 | 0,37 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,030 | 17.06.2026 | 3.600 | 276 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,235 | 12.05.2028 | 1.100 | 110 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 17.06.2030 | 4.400 | 344 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 16.12.2050 | 12.600 | 3.032 | 0,29 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 16.06.2051 | 8.700 | 1.529 | 0,15 |
| Zahlung[3] | 3-Month USD-LIBOR | 1,270 | 04.11.2023 | 59.400 | (263) | (0,03) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,317 | 16.12.2050 | 400 | (120) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,360 | 15.02.2027 | 6.700 | 467 | 0,05 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,360 | 20.07.2031 | 1.400 | 188 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,370 | 19.07.2031 | 900 | 120 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,380 | 04.01.2027 | 3.600 | (232) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,418 | 20.01.2027 | 1.300 | (83) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,425 | 18.01.2027 | 2.500 | (157) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,438 | 22.01.2051 | 9.000 | (2.545) | (0,25) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,450 | 17.02.2027 | 6.300 | 413 | 0,04 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,450 | 16.07.2031 | 2.000 | 257 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 15.12.2028 | 7.919 | (892) | (0,09) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 18.12.2029 | 1.200 | 82 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 05.10.2031 | 1.500 | (185) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 17.06.2050 | 7.700 | 3.298 | 0,32 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,518 | 20.01.2029 | 800 | (67) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,535 | 15.10.2031 | 1.500 | (182) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,535 | 22.10.2031 | 1.000 | (121) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,545 | 26.10.2031 | 1.000 | (121) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,570 | 12.01.2027 | 1.400 | (79) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,580 | 16.02.2027 | 2.800 | (159) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,580 | 13.01.2051 | 9.300 | (2.422) | (0,23) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,600 | 15.02.2027 | 26.800 | (1.474) | (0,14) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,625 | 06.01.2030 | 300 | 32 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,630 | 26.01.2029 | 1.300 | (100) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,655 | 24.01.2032 | 1.300 | (143) | (0,01) |
| Zahlung[3] | 3-Month USD-LIBOR | 1,700 | 06.03.2024 | 6.400 | (102) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,700 | 17.02.2027 | 25.000 | (1.253) | (0,12) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,735 | 12.01.2032 | 1.100 | (113) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 | 15.01.2030 | 4.600 | 433 | 0,04 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,768 | 02.02.2032 | 1.000 | (99) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,785 | 12.08.2051 | 1.100 | 264 | 0,03 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,815 % | 24.01.2052 | $ 300 | $ (63) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,867 | 26.01.2052 | 300 | (60) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,910 | 17.10.2049 | 400 | 90 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,988 | 09.02.2032 | 1.100 | 86 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 10.12.2029 | 21.000 | 1.703 | 0,17 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 12.02.2030 | 2.500 | 209 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 10.03.2030 | 1.200 | 81 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,008 | 09.02.2032 | 1.900 | 150 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 12.03.2050 | 15.700 | 2.131 | 0,21 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,543 | 05.02.2024 | 1.000 | 4 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,550 | 05.02.2024 | 1.000 | 3 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,559 | 05.02.2024 | 1.000 | 3 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,571 | 05.02.2024 | 500 | 2 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,580 | 05.02.2024 | 1.500 | 4 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,605 | 05.02.2024 | 1.500 | 3 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,607 | 05.02.2024 | 500 | 1 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 19.12.2023 | 19.100 | (248) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2024 | 24.000 | 560 | 0,05 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2026 | 12.700 | 348 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 4,848 | 11.01.2026 | ZAR 18.700 | (99) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 4,850 | 07.01.2026 | 5.200 | (29) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 4,915 | 01.02.2026 | 12.600 | (67) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 5,970 | 10.03.2026 | 300 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 3,000 | 21.03.2027 | AUD 12.400 | (517) | (0,05) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | € 13.700 | 1.342 | 0,13 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 18.03.2050 | 2.500 | 855 | 0,08 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,294 | 30.06.2026 | 100 | 8 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,329 | 30.12.2025 | 200 | 14 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,363 | 30.06.2025 | 300 | 18 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,395 | 30.12.2024 | 200 | 10 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,425 | 28.06.2024 | 300 | 11 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,453 | 29.12.2023 | 400 | 11 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 17.06.2050 | 600 | 227 | 0,02 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 11.05.2027 | 14.200 | (655) | (0,06) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,700 | 11.04.2027 | 4.800 | (211) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 13.05.2027 | 9.800 | (317) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.05.2027 | 4.700 | (153) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 4,470 | 27.02.2023 | MXN 46.600 | (73) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 4,500 | 03.03.2023 | 297.900 | (468) | (0,05) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 4,520 | 27.02.2023 | 93.200 | (145) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 4,550 | 27.02.2023 | 394.100 | (617) | (0,06) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 4,560 | 27.02.2023 | 45.700 | (71) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 4,565 | 27.02.2023 | 46.600 | (72) | (0,01) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,320 | 30.03.2023 | 924.260 | 331 | 0,03 |
| Zahlung | UKRPI | 4,000 | 15.09.2031 | £ 900 | (84) | (0,01) |
| Zahlung | UKRPI | 4,020 | 15.10.2031 | 1.200 | (103) | (0,01) |
| Zahlung | UKRPI | 4,055 | 15.09.2031 | 800 | (73) | (0,01) |
| Zahlung | UKRPI | 4,066 | 15.09.2031 | 1.700 | (123) | (0,01) |
| Zahlung | UKRPI | 4,140 | 15.10.2031 | 2.300 | (158) | (0,02) |
| | | | | | $ 14.379 | 1,40 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 8.009** | **0,78** |

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

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

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

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

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

**VERKAUFSOPTIONEN**

**CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,400 % | 17.08.2022 | 7.900 | $ (22) | $ (26) | (0,01) |
| BRC | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 5.400 | (24) | (12) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,600 | 17.08.2022 | 1.500 | (4) | (3) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 2.200 | (3) | (1) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 4.200 | (8) | (5) | 0,00 |
| GST | Call - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Kauf | 0,700 | 17.08.2022 | 2.500 | (3) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,300 | 17.08.2022 | 7.400 | (17) | (12) | 0,00 |

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYC | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,250 % | 20.07.2022 | 2.400 | $ (4) | $ (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,350 | 17.08.2022 | 5.000 | (11) | (7) | 0,00 |
| | | | | | | $ (96) | $ (67) | (0,01) |

## ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,150 % | 01.12.2023 | 6.000 | $ (19) | $ (24) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,650 | 01.12.2023 | 6.000 | (19) | (20) | 0,00 |
| BPS | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 11.04.2023 | 1.800 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 11.04.2023 | 1.800 | (6) | (7) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 28.04.2023 | 9.600 | (17) | (7) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 28.04.2023 | 9.600 | (17) | (33) | (0,01) |
| CBK | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,690 | 02.04.2024 | 2.100 | (16) | (15) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,690 | 02.04.2024 | 2.100 | (16) | (14) | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 01.09.2022 | 2.000 | (17) | (12) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 01.09.2022 | 2.000 | (17) | (20) | 0,00 |
| DUB | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,920 | 13.10.2023 | 4.800 | (29) | (33) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,920 | 13.10.2023 | 4.800 | (29) | (27) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,790 | 08.04.2024 | 3.300 | (25) | (26) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,790 | 08.04.2024 | 3.300 | (25) | (20) | 0,00 |
| | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,350 | 08.08.2022 | 2.400 | (9) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,550 | 08.08.2022 | 2.400 | (9) | (48) | (0,01) |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 02.09.2022 | 1.400 | (7) | (6) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 02.09.2022 | 1.400 | (7) | (10) | 0,00 |
| GLM | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,870 | 02.11.2022 | 224.100 | (446) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,270 | 02.11.2022 | 224.100 | (446) | (5.136) | (0,50) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,920 | 13.10.2023 | 4.800 | (30) | (33) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,920 | 13.10.2023 | 4.800 | (30) | (27) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,018 | 20.10.2023 | 3.900 | (25) | (29) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,018 | 20.10.2023 | 3.900 | (25) | (20) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,140 | 23.10.2023 | 3.900 | (27) | (32) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,140 | 23.10.2023 | 3.900 | (27) | (19) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,190 | 23.10.2023 | 3.900 | (27) | (33) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,190 | 23.10.2023 | 3.900 | (27) | (18) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,225 | 23.10.2023 | 3.900 | (27) | (34) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,225 | 23.10.2023 | 3.900 | (27) | (17) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,973 | 25.10.2023 | 3.900 | (27) | (29) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,973 | 25.10.2023 | 3.900 | (27) | (21) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,841 | 27.10.2023 | 3.800 | (26) | (25) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,841 | 27.10.2023 | 3.800 | (26) | (23) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,088 | 03.11.2023 | 3.800 | (28) | (31) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,088 | 03.11.2023 | 3.800 | (28) | (19) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,910 | 10.11.2023 | 3.700 | (25) | (27) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,910 | 10.11.2023 | 3.700 | (25) | (21) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 17.11.2023 | 7.200 | (26) | (30) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 17.11.2023 | 7.200 | (26) | (22) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,150 | 20.11.2023 | 7.200 | (25) | (28) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,650 | 20.11.2023 | 7.200 | (25) | (24) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 07.12.2023 | 6.100 | (19) | (27) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 07.12.2023 | 6.100 | (19) | (19) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,697 | 02.04.2024 | 12.300 | (96) | (89) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,697 | 02.04.2024 | 12.300 | (96) | (80) | (0,01) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,721 | 08.04.2024 | 4.100 | (31) | (30) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,721 | 08.04.2024 | 4.100 | (31) | (26) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 05.04.2023 | 9.900 | (18) | (6) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 05.04.2023 | 9.900 | (18) | (37) | (0,01) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 11.04.2023 | 13.200 | (25) | (8) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 11.04.2023 | 13.200 | (25) | (49) | (0,01) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 24.04.2023 | 9.900 | (11) | (8) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 24.04.2023 | 9.900 | (28) | (33) | (0,01) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 26.04.2023 | 9.200 | (16) | (7) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 26.04.2023 | 9.200 | (16) | (31) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 15.05.2023 | 8.600 | (15) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 15.05.2023 | 8.600 | (15) | (34) | (0,01) |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 06.09.2022 | 1.400 | (9) | (8) | 0,00 |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 06.09.2022 | 1.400 | (9) | (12) | 0,00 |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 | 07.09.2022 | 1.400 | (9) | (9) | 0,00 |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,100 | 07.09.2022 | 1.400 | (9) | (10) | 0,00 |
| MYC | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,993 | 11.10.2023 | 4.400 | (30) | (32) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,993 | 11.10.2023 | 4.400 | (30) | (24) | 0,00 |
| | | | | | | | $ (2.339) | $ (6.607) | (0,64) |

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | $ 93,563 | 07.09.2022 | 2.000 | $ (15) | $ (19) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | 94,438 | 07.09.2022 | 2.000 | (12) | (12) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | 94,703 | 07.09.2022 | 1.800 | (12) | (9) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 98,297 | 07.07.2022 | 1.500 | (9) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 99,141 | 07.07.2022 | 4.800 | (33) | (30) | (0,01) |
| SAL | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | 94,688 | 07.09.2022 | 1.400 | (8) | (7) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 100,289 | 07.07.2022 | 1.000 | (5) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 99,563 | 07.07.2022 | 1.000 | (5) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,406 | 07.09.2022 | 1.000 | (3) | (7) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,656 | 07.09.2022 | 1.000 | (4) | (8) | 0,00 |
| | | | | | $ (106) | $ (95) | (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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2023 | $ 100 | $ (6) | $ 7 | $ 1 | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 100 | (12) | (5) | (17) | 0,00 |
| BPS | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 500 | (24) | (18) | (42) | (0,01) |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 100 | (2) | 2 | 0 | 0,00 |
| BRC | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 900 | (41) | (21) | (62) | (0,01) |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 200 | (13) | (9) | (22) | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 540 | (70) | (20) | (90) | (0,01) |
| CBK | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 400 | (14) | (19) | (33) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 100 | (2) | 2 | 0 | 0,00 |
| DUB | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 100 | (4) | (4) | (8) | 0,00 |
| GST | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 800 | (32) | (34) | (66) | (0,01) |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2025 | 200 | (11) | 1 | (10) | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 700 | (79) | (38) | (117) | (0,01) |
| HUS | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 300 | (10) | 9 | (1) | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 600 | (18) | 13 | (5) | 0,00 |
| MYC | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 1.500 | (73) | (52) | (125) | (0,01) |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 300 | (2) | 2 | 0 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2025 | 200 | (3) | 1 | (2) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 1.400 | (62) | (49) | (111) | (0,01) |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 100 | (16) | 2 | (14) | 0,00 |
| | | | | | $ (494) | $ (230) | $ (724) | (0,07) |

## 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.13 Index | 0,500 % | 16.12.2072 | $ 62.300 | $ 92 | $ (1.201) | $ (1.109) | (0,11) |
| MEI | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 15.300 | (74) | (93) | (167) | (0,01) |
| MYC | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 25.375 | (78) | (13) | (91) | (0,01) |
| | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18.11.2054 | 25.375 | (193) | 24 | (169) | (0,02) |
| | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 300 | (2) | (1) | (3) | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.13 Index | 0,500 | 16.12.2072 | 25.500 | 86 | (539) | (453) | (0,04) |
| | | | | | $ (169) | $ (1.823) | $ (1.992) | (0,19) |

(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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYC | Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,900 % | 04.10.2027 | $ 15.500 | $ 1 | $ (139) | $ (138) | (0,01) |

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nenn-betrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 1,044 % | $ 300 | 20.09.2022 | $ 0 | $ (13) | $ (13) | 0,00 |
| MYC | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 1,044 | 100 | 20.09.2022 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | | | | | | | $ 0 | $ (19) | $ (19) | 0,00 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | PEN | 11.049 | $ | 2.737 | $ 0 | $ (164) | $ (164) | (0,02) |
| | 07.2022 | $ | 1.616 | PEN | 6.110 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 685 | ZAR | 11.015 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 11.147 | $ | 726 | 47 | 0 | 47 | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 2.706 | | 2.873 | 36 | 0 | 36 | 0,00 |
| | 08.2022 | MXN | 4.736 | | 233 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN | 3.062 | | 777 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 2.137 | CAD | 2.763 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 5.317 | € | 5.029 | 0 | (44) | (44) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 15.477 | £ | 12.640 | 0 | (114) | (114) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 1.583 | IDR | 23.317.102 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 8.729 | ¥ | 1.157.900 | 0 | (183) | (183) | (0,02) |
| | 08.2022 | | 952 | NOK | 9.065 | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 80 | RUB | 12.500 | 140 | 0 | 140 | 0,01 |
| | 11.2022 | ZAR | 11.184 | $ | 704 | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | BRL | 46.687 | | 9.055 | 127 | 0 | 127 | 0,01 |
| | 07.2022 | MXN | 208.836 | | 10.391 | 41 | 0 | 41 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 11.321 | MXN | 236.798 | 416 | 0 | 416 | 0,04 |
| | 08.2022 | | 8.984 | BRL | 46.687 | 0 | (133) | (133) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 226 | IDR | 3.337.457 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | ZAR | 43.704 | $ | 2.737 | 81 | 0 | 81 | 0,01 |
| | 09.2022 | $ | 10.238 | MXN | 208.836 | 0 | (23) | (23) | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 24.108 | $ | 1.504 | 51 | 0 | 51 | 0,00 |
| BRC | 08.2022 | $ | 620 | € | 585 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 248 | IDR | 3.671.954 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.667 | NOK | 16.314 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 8.555 | $ | 533 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | PEN | 14 | | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 435 | PEN | 1.733 | 22 | (2) | 20 | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 2.914 | $ | 2.052 | 47 | 0 | 47 | 0,00 |
| | 08.2022 | £ | 683 | | 833 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN | 1.804 | | 477 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 3.528 | AUD | 5.057 | 0 | (50) | (50) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 777 | CLP | 683.994 | 0 | (52) | (52) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 1.092 | £ | 903 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 87 | PEN | 331 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 11.2022 | | 398 | | 1.580 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 12.2022 | | 1.368 | | 5.738 | 120 | 0 | 120 | 0,01 |
| | 04.2023 | PEN | 9 | $ | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | $ | 12 | PEN | 43 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 57.794 | $ | 61.368 | 773 | 0 | 773 | 0,07 |
| | 08.2022 | £ | 71.621 | | 88.348 | 1.303 | 0 | 1.303 | 0,13 |
| | 08.2022 | TWD | 64.038 | | 2.156 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 0 | RUB | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10.2022 | | 288 | | 27.810 | 152 | 0 | 152 | 0,01 |
| | 12.2022 | ZAR | 15.391 | $ | 980 | 55 | 0 | 55 | 0,01 |
| | 02.2023 | | 5.036 | | 302 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | MXN | 27.962 | | 1.352 | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 10.564 | BRL | 52.485 | 0 | (529) | (529) | (0,05) |
| | 07.2022 | | 87 | PEN | 327 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 1.175 | $ | 73 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 444 | PEN | 1.669 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 10.2022 | | 725 | RUB | 68.639 | 384 | 0 | 384 | 0,04 |
| | 11.2022 | ZAR | 11.843 | $ | 738 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 05.2023 | | 8.851 | | 530 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| HUS | 08.2022 | CNH | 540 | | 80 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | £ | 896 | | 1.084 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 08.2022 | MXN | 42.799 | | 2.087 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 834 | CLP | 699.158 | 0 | (93) | (93) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 702 | IDR | 10.293.780 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 05.2023 | CNH | 377 | $ | 56 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | $ | 524 | € | 499 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 291 | £ | 240 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 23 | SGD | 32 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 4.029 | $ | 4.283 | 58 | 0 | 58 | 0,01 |
| | 08.2022 | TWD | 49.462 | | 1.679 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 811 | IDR | 11.966.771 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| RBC | 09.2022 | MXN | 2.619 | $ | 127 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SCX | 07.2022 | $ | 34 | PEN | 128 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CHF | 4.638 | $ | 4.642 | 0 | (216) | (216) | (0,02) |
| | 08.2022 | CNH | 665 | | 99 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 1.120 | £ | 889 | 0 | (39) | (39) | 0,00 |
| | 09.2022 | ZAR | 14.035 | $ | 908 | 57 | 0 | 57 | 0,01 |
| UAG | 07.2022 | BRL | 5.798 | | 1.211 | 102 | 0 | 102 | 0,01 |
| | 07.2022 | MXN | 27.260 | | 1.312 | 0 | (37) | (37) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 21.464 | | 1.077 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 35.937 | | 2.266 | 100 | 0 | 100 | 0,01 |
| | | | | | | $ 4.261 | $ (1.914) | $ 2.347 | 0,23 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | $ | 190 | CHF | 182 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CHF | 4 | $ | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 3 | CHF | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | | 190 | | 182 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | CHF | 175 | $ | 185 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 186 | CHF | 178 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 185 | | 175 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ 1 | $ (1) | $ 0 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend und Class Z EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | $ | 264 | € | 248 | $ 0 | $ (5) | $ (5) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | € | 227.666 | $ | 239.436 | 1.423 | 0 | 1.423 | 0,14 |
| | 07.2022 | $ | 2.188 | € | 2.063 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 235.148 | | 223.160 | 0 | (1.414) | (1.414) | (0,14) |
| CBK | 07.2022 | | 2.875 | | 2.678 | 0 | (75) | (75) | (0,01) |
| HUS | 07.2022 | € | 223.652 | $ | 235.281 | 1.464 | 0 | 1.464 | 0,14 |
| | 07.2022 | $ | 246.081 | € | 228.193 | 0 | (7.516) | (7.516) | (0,73) |
| | 08.2022 | | 235.191 | | 223.160 | 0 | (1.458) | (1.458) | (0,14) |
| SCX | 07.2022 | | 207.364 | | 193.580 | 0 | (4.986) | (4.986) | (0,49) |
| UAG | 07.2022 | | 246.987 | | 229.840 | 0 | (6.700) | (6.700) | (0,65) |
| | | | | | | $ 2.887 | $ (22.185) | $ (19.298) | (1,88) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | £ | 1.100 | $ | 1.391 | $ 56 | $ 0 | $ 56 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 34.940 | £ | 27.634 | 0 | (1.380) | (1.380) | (0,13) |
| BPS | 07.2022 | £ | 2.127 | $ | 2.596 | 14 | (1) | 13 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.208 | £ | 959 | 0 | (44) | (44) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | | 34.940 | | 27.698 | 0 | (1.302) | (1.302) | (0,13) |
| SCX | 07.2022 | | 34.821 | | 27.698 | 0 | (1.182) | (1.182) | (0,12) |
| | | | | | | $ 70 | $ (3.909) | $ (3.839) | (0,37) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend und Class E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | 07.2022 | SGD | 4.918 | $ | 3.540 | $ 6 | $ 0 | $ 6 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 3.514 | SGD | 4.882 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| HUS | 07.2022 | SGD | 439 | $ | 317 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 4 | SGD | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | SGD | 12 | $ | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 17 | SGD | 24 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MEI | 07.2022 | SGD | 2.434 | $ | 1.752 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 3.862 | SGD | 5.292 | 0 | (60) | (60) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 1.752 | | 2.434 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | | 40 | | 55 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 3.975 | | 5.433 | 0 | (72) | (72) | (0,01) |
| UAG | 07.2022 | SGD | 49 | $ | 36 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 4.115 | SGD | 5.635 | 0 | (66) | (66) | (0,01 |
| | | | | | | $ 11 | $ (207) | $ (196) | (0,02) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **$ (30.628)** | **(2,97)** |

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | | |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.08.2052 (j) | $ | 700 | $ | (701) | (0,07) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | | $ | (701) | (0,07) |
| **Summe Anlagen** | | | $ | 1.273.788 | 123,61 |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | | $ | (243.268) | (23,61) |
| **Nettovermögen** | | | $ | 1.030.520 | 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**

**µ** **Bei diesem Betrag handelt es sich ganz oder teilweise um ungedeckte Darlehenszusagen. Der Zinssatz für den ungedeckten Teil wird zum Zeitpunkt der Finanzierung festgelegt.**

**^** **Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a)** **Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

**(b)** **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

**(c)** **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

**(d)** **Nullkuponwertpapier.**

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

**(f)** **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

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

**(h)** **Mit dem Fonds verbunden.**

**(i)** **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(j)** **Zum 30. Juni 2022 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.**

**(k)** **Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kauf-datum | | Kosten | | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Intelsat Emergence S.A | 05.09.2018 - | 23.02.2022 | $ 3.227 | $ | 1.273 | 0,12 |
| Neiman Marcus Group Ltd. LLC | | 25.09.2020 | 166 | | 889 | 0,09 |
| Noble Corp. | 05.02.2021 - | 25.02.2021 | 296 | | 638 | 0,06 |
| Westmoreland Mining Holdings LLC | | 26.03.2019 | 1 | | 0 | 0,00 |
| | | | $ 3.690 | $ | 2.800 | 0,27 |

**(l)** **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1,168 und Barmittel in Höhe von USD 30.105 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von USD 30.971 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 1.224 | $ 1.211.527 | $ 4.576 | $ 1.217.327 |
| Investmentfonds | 74.088 | 0 | 0 | 74.088 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 4.712 | 0 | 4.712 |
| Finanzderivate[3] | 72 | (21.710) | 0 | (21.638) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (701) | 0 | (701) |
| **Summen** | **$ 75.384** | **$ 1.193.828** | **$ 4.576** | **$ 1.273.788** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 2.079 | $ 1.433.257 | $ 11.636 | $ 1.446.972 |
| Investmentfonds | 132.416 | 0 | 0 | 132.416 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 7.961 | 0 | 7.961 |
| Finanzderivate[3] | (23) | 11.048 | 0 | 11.025 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (213) | 0 | (213) |
| **Summen** | **$ 134.472** | **$ 1.452.053** | **$ 11.636** | **$ 1.598.161** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (1.844) | $ 1.740 | $ (104) |
| BPS | 401 | (290 ) | 111 |
| BRC | (1.499) | 1.340 | (159) |
| CBK | (61) | 0 | (61) |
| DUB | 2.100 | (2.080 ) | 20 |
| GLM | (6.383) | 6.671 | 288 |
| GST | (1.314) | 1.295 | (19) |
| HUS | (7.646) | 0 | (7.646) |
| MBC | 0 | 6.900 | 6.900 |
| MEI | (226) | 0 | (226) |
| MYC | (1.176) | 872 | (304) |
| MYI | 57 | 0 | 57 |
| RBC | (1) | 0 | (1) |
| SAL | (23) | 233 | 210 |
| SCX | (6.438) | 6.000 | (438) |
| UAG | (6.575) | 5.962 | (613) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 35,76 | 40,62 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 79,51 | 59,78 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 2,86 | 5,43 |
| Investmentfonds | 7,19 | 9,68 |
| Pensionsgeschäfte | 0,46 | 0,58 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,09 | (0,04 ) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,78 | 0,01 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (2,97 ) | 0,83 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (0,07 ) | (0,02 ) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 7,36 | 7,43 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 36,27 | 35,19 |
| Wandelanleihen & Wechsel | 0,05 | 0,04 |
| US-Regierungsbehörden | 28,24 | 18,26 |
| US-Schatzobligationen | 4,52 | 3,63 |
| Non-Agency-MBS | 17,36 | 11,58 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 8,50 | 5,94 |
| Staatsemissionen | 3,19 | 3,14 |
| Stammaktien | 0,35 | 0,26 |
| Bezugsrechte | 0,00 | k. A. |
| Optionsscheine | 0,00 | 0,00 |
| Real Estate Investment Trusts | 0,00 | 0,00 |
| Kurzfristige Instrumente | 12,29 | 20,36 |
| Investmentfonds | 7,19 | 9,68 |
| Pensionsgeschäfte | 0,46 | 0,58 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,10 | (0,04 ) |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | (0,01 ) | k. A. |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,12 ) | 0,04 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,50 ) | 0,01 |
| Zinsswaps | 1,40 | (0,04 ) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoptionen | k. A. | 0,00 |
| Optionen auf Wertpapiere | k. A. | 0,01 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,01 ) | 0,00 |
| Devisenoptionen | k. A. | 0,00 |
| Zinsswapoptionen | (0,64 ) | (0,08 ) |
| Optionen auf Wertpapiere | (0,01 ) | (0,02 ) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,07 ) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,19 ) | 0,06 |
| Zinsswaps | (0,01 ) | 0,01 |
| Total Return Swaps auf Indizes | 0,00 | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | 0,23 | 0,04 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (2,27 ) | 0,81 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (0,07 ) | (0,02 ) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (23,61 ) | (16,87 ) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **AAdvantage Loyalty IP Ltd.** | | | | |
| 5,813 % fällig am 20.04.2028 | $ | 1.100 | $ 1.054 | 0,03 |
| **Caesars Resort Collection LLC** | | | | |
| 4,416 % fällig am 23.12.2024 | | 9.451 | 9.124 | 0,30 |
| **CenturyLink, Inc.** | | | | |
| 3,916 % fällig am 15.03.2027 | | 4.421 | 4.072 | 0,13 |
| **CommScope, Inc.** | | | | |
| 4,916 % fällig am 06.04.2026 | | 1.965 | 1.775 | 0,06 |
| **Cornerstone Building Brands, Inc.** | | | | |
| 4,574 % fällig am 12.04.2028 | | 1.344 | 1.122 | 0,04 |
| **CSC Holdings LLC** | | | | |
| 3,824 % fällig am 15.04.2027 | | 290 | 270 | 0,01 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | |
| 3,374 % fällig am 22.06.2026 | | 1.046 | 1.004 | 0,03 |
| **IRB Holding Corp.** | | | | |
| 4,238 % fällig am 15.12.2027 | | 4.889 | 4.665 | 0,15 |
| 4,416 % fällig am 05.02.2025 | | 3.043 | 2.894 | 0,10 |
| **Kronos Acquisition Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,416 % fällig am 22.12.2026 | | 2.561 | 2.339 | 0,08 |
| **MPH Acquisition Holdings LLC** | | | | |
| 5,825 % fällig am 01.09.2028 | | 3.871 | 3.578 | 0,12 |
| **RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,416 % fällig am 16.11.2025 | | 1.215 | 1.136 | 0,04 |
| **SkyMiles IP Ltd.** | | | | |
| 4,813 % fällig am 20.10.2027 | | 1.000 | 993 | 0,03 |
| **U.S. Foods, Inc.** | | | | |
| 4,325 % fällig am 22.11.2028 | | 2.985 | 2.848 | 0,09 |
| **United Airlines, Inc.** | | | | |
| 5,392 % fällig am 21.04.2028 | | 2.175 | 2.025 | 0,07 |
| **Zayo Group Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,666 % fällig am 09.03.2027 | | 5.627 | 5.052 | 0,17 |
| | | | 43.951 | 1,45 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | |
| 4,375 % fällig am 22.09.2025 (f)(h) | € | 2.600 | 2.415 | 0,08 |
| **Acef Holding S.C.A.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 26.04.2030 | | 1.000 | 788 | 0,03 |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 2,450 % fällig am 29.10.2026 | $ | 2.800 | 2.440 | 0,08 |
| 3,300 % fällig am 23.01.2023 | | 500 | 498 | 0,02 |
| 4,125 % fällig am 03.07.2023 | | 1.500 | 1.486 | 0,05 |
| **AGFC Capital Trust** | | | | |
| 2,794 % fällig am 15.01.2067 | | 500 | 273 | 0,01 |
| **Aircastle Ltd.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 26.01.2028 | | 3.000 | 2.483 | 0,08 |
| **Altarea S.C.A.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 17.01.2028 | € | 5.300 | 4.416 | 0,15 |
| **AMCO - Asset Management Co. SpA** | | | | |
| 1,500 % fällig am 17.07.2023 | | 1.300 | 1.364 | 0,05 |
| 2,250 % fällig am 17.07.2027 | | 2.900 | 2.905 | 0,10 |
| **American Assets Trust LP** | | | | |
| 3,375 % fällig am 01.02.2031 | $ | 2.050 | 1.756 | 0,06 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.06.2023 | | 1.000 | 990 | 0,03 |
| 3,650 % fällig am 15.03.2027 | | 1.000 | 951 | 0,03 |
| 4,050 % fällig am 15.03.2032 | | 800 | 730 | 0,02 |
| 4,400 % fällig am 15.02.2026 | | 850 | 846 | 0,03 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 16.07.2026 (c) | € | 800 | 680 | 0,02 |
| 0,375 % fällig am 15.04.2027 | | 1.400 | 1.143 | 0,04 |
| 1,500 % fällig am 28.05.2026 | | 3.300 | 2.997 | 0,10 |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | $ | 6.100 | 5.654 | 0,19 |
| **Ascendas Real Estate Investment Trust** | | | | |
| 0,750 % fällig am 23.06.2028 | € | 1.100 | 925 | 0,03 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 11.09.2025 | | 1.200 | 1.150 | 0,04 |
| 3,625 % fällig am 17.10.2022 | | 463 | 481 | 0,02 |
| **Atrium Finance Issuer BV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.09.2027 | | 2.200 | 1.862 | 0,06 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.05.2023 | $ | 1.000 | 992 | 0,03 |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | |
| 2,528 % fällig am 18.11.2027 | $ | 1.806 | $ 1.474 | 0,05 |
| **Balder Finland Oyj** | | | | |
| 1,000 % fällig am 18.01.2027 | € | 1.900 | 1.447 | 0,05 |
| 1,000 % fällig am 20.01.2029 | | 500 | 330 | 0,01 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 5,375 % fällig am 18.01.2028 | | 3.800 | 2.361 | 0,08 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (f)(h) | | 1.800 | 1.812 | 0,06 |
| **Banco de Credito del Peru S.A.** | | | | |
| 4,650 % fällig am 17.09.2024 | PEN | 7.000 | 1.706 | 0,06 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 14.04.2026 | £ | 5.400 | 5.906 | 0,20 |
| 4,175 % fällig am 24.03.2028 | $ | 2.800 | 2.674 | 0,09 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 3,384 % fällig am 02.04.2026 | | 6.800 | 6.600 | 0,22 |
| 3,419 % fällig am 20.12.2028 | | 1.479 | 1.379 | 0,05 |
| 3,550 % fällig am 05.03.2024 | | 1.600 | 1.595 | 0,05 |
| 3,584 % fällig am 27.04.2031 | £ | 3.400 | 3.927 | 0,13 |
| 3,864 % fällig am 23.07.2024 | $ | 1.800 | 1.793 | 0,06 |
| **Banque Federative du Credit Mutuel S.A.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 05.12.2025 | £ | 1.200 | 1.344 | 0,04 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (h) | $ | 318 | 321 | 0,01 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 2,894 % fällig am 24.11.2032 | | 3.500 | 2.817 | 0,09 |
| 3,125 % fällig am 17.01.2024 | £ | 100 | 120 | 0,00 |
| 3,250 % fällig am 17.01.2033 | | 200 | 207 | 0,01 |
| 3,330 % fällig am 24.11.2042 | $ | 3.000 | 2.235 | 0,07 |
| 4,375 % fällig am 12.01.2026 | | 1.700 | 1.685 | 0,06 |
| 4,972 % fällig am 16.05.2029 | | 800 | 787 | 0,03 |
| 7,125 % fällig am 15.06.2025 (f)(h) | £ | 1.800 | 2.103 | 0,07 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (f)(h) | | 2.200 | 2.634 | 0,09 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (f)(h) | $ | 1.800 | 1.773 | 0,06 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2022 (f)(h) | £ | 500 | 606 | 0,02 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2022 (f)(h) | | 600 | 727 | 0,02 |
| 8,000 % fällig am 15.06.2024 (f)(h) | $ | 200 | 197 | 0,01 |
| **Bevco Lux SARL** | | | | |
| 1,500 % fällig am 16.09.2027 | € | 2.500 | 2.365 | 0,08 |
| **Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL** | | | | |
| 1,250 % fällig am 26.04.2027 | | 2.300 | 2.003 | 0,07 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 14.12.2027 | £ | 1.900 | 2.043 | 0,07 |
| 1,904 % fällig am 30.09.2028 | $ | 3.400 | 2.908 | 0,10 |
| 2,000 % fällig am 13.09.2036 | £ | 1.700 | 1.475 | 0,05 |
| 2,871 % fällig am 19.04.2032 | $ | 14.400 | 11.916 | 0,39 |
| 4,625 % fällig am 25.02.2031 (f)(h) | | 700 | 518 | 0,02 |
| **BNZ International Funding Ltd.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 03.11.2022 | | 1.100 | 1.100 | 0,04 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 13.01.2042 (h) | € | 1.800 | 1.617 | 0,05 |
| **Brookfield Finance, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.04.2024 | $ | 50 | 50 | 0,00 |
| **Castellum Helsinki Finance Holding Abp** | | | | |
| 0,875 % fällig am 17.09.2029 | € | 3.800 | 2.707 | 0,09 |
| **CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund** | | | | |
| 0,500 % fällig am 27.01.2028 | | 1.600 | 1.384 | 0,05 |
| 0,900 % fällig am 12.10.2029 | | 1.900 | 1.574 | 0,05 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 23.10.2026 | £ | 2.500 | 2.756 | 0,09 |
| 2,700 % fällig am 27.10.2022 | $ | 4.000 | 4.004 | 0,13 |
| 3,010 % fällig am 01.09.2023 | | 1.600 | 1.599 | 0,05 |
| 3,290 % fällig am 17.03.2026 (j) | | 3.700 | 3.582 | 0,12 |
| 3,785 % fällig am 17.03.2033 (j) | | 6.500 | 5.862 | 0,19 |
| 4,140 % fällig am 24.05.2025 | | 2.200 | 2.193 | 0,07 |
| **Citycon Treasury BV** | | | | |
| 1,625 % fällig am 12.03.2028 | € | 1.700 | 1.310 | 0,04 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 3,100 % fällig am 29.06.2028 (f)(h) | | 3.800 | 2.995 | 0,10 |
| 3,875 % fällig am 26.09.2023 | $ | 750 | 750 | 0,02 |
| **Corebridge Financial, Inc.** | | | | |
| 3,650 % fällig am 05.04.2027 | | 2.000 | 1.882 | 0,06 |
| 3,850 % fällig am 05.04.2029 | | 2.200 | 2.035 | 0,07 |
| **Covivio Hotels SACA** | | | | |
| 1,000 % fällig am 27.07.2029 | € | 800 | 666 | 0,02 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 27.01.2031 | € | 2.000 | $ 1.390 | 0,05 |
| 1,625 % fällig am 23.04.2027 | | 3.500 | 2.927 | 0,10 |
| 1,750 % fällig am 14.01.2030 | | 3.000 | 2.223 | 0,07 |
| 2,750 % fällig am 12.05.2026 | | 2.181 | 2.032 | 0,07 |
| 2,750 % fällig am 22.01.2028 | £ | 700 | 657 | 0,02 |
| 4,875 % fällig am 16.07.2025 (f) | € | 2.200 | 1.339 | 0,04 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,250 % fällig am 01.09.2028 | | 3.000 | 2.515 | 0,08 |
| 0,646 % fällig am 01.09.2023 | | 5.000 | 5.240 | 0,17 |
| 3,700 % fällig am 21.02.2025 | $ | 4.500 | 4.399 | 0,15 |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (h) | | 4.100 | 4.111 | 0,14 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 1,000 % fällig am 24.06.2027 | € | 500 | 457 | 0,02 |
| 2,125 % fällig am 12.09.2025 | £ | 200 | 229 | 0,01 |
| 2,125 % fällig am 15.11.2029 | | 2.400 | 2.416 | 0,08 |
| 3,091 % fällig am 14.05.2032 | $ | 3.500 | 2.789 | 0,09 |
| 3,750 % fällig am 26.03.2025 | | 150 | 145 | 0,00 |
| 3,869 % fällig am 12.01.2029 | | 2.200 | 1.979 | 0,07 |
| 4,194 % fällig am 01.04.2031 | | 800 | 709 | 0,02 |
| 4,550 % fällig am 17.04.2026 | | 1.000 | 979 | 0,03 |
| 5,250 % fällig am 11.02.2027 (f)(h) | | 3.100 | 2.402 | 0,08 |
| 6,250 % fällig am 18.12.2024 (f)(h) | | 200 | 183 | 0,01 |
| 6,375 % fällig am 21.08.2026 (f)(h) | | 2.600 | 2.155 | 0,07 |
| 7,250 % fällig am 12.09.2025 (f)(h) | | 1.600 | 1.390 | 0,05 |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (f)(h) | | 400 | 370 | 0,01 |
| 7,500 % fällig am 11.12.2023 (f)(h) | | 2.700 | 2.579 | 0,09 |
| **Cromwell Ereit Lux Finco SARL** | | | | |
| 2,125 % fällig am 19.11.2025 | € | 2.000 | 1.711 | 0,06 |
| **CTP NV** | | | | |
| 0,625 % fällig am 27.09.2026 | | 2.700 | 2.256 | 0,07 |
| 1,500 % fällig am 27.09.2031 | | 2.500 | 1.585 | 0,05 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,750 % fällig am 17.02.2027 | | 800 | 740 | 0,02 |
| 1,375 % fällig am 03.09.2026 | | 3.900 | 3.793 | 0,13 |
| 1,625 % fällig am 20.01.2027 | | 7.000 | 6.562 | 0,22 |
| 1,750 % fällig am 19.11.2030 | | 1.200 | 1.036 | 0,03 |
| 2,601 % fällig am 16.11.2022 | $ | 800 | 800 | 0,03 |
| 2,625 % fällig am 16.12.2024 | £ | 5.500 | 6.364 | 0,21 |
| 3,300 % fällig am 16.11.2022 | $ | 2.700 | 2.700 | 0,09 |
| 3,547 % fällig am 18.09.2031 | | 4.100 | 3.436 | 0,11 |
| 3,729 % fällig am 14.01.2032 (j) | | 2.200 | 1.656 | 0,05 |
| 3,961 % fällig am 26.11.2025 | | 5.000 | 4.836 | 0,16 |
| 4,100 % fällig am 13.01.2026 | | 1.500 | 1.474 | 0,05 |
| 4,625 % fällig am 30.10.2027 (f)(h) | € | 1.000 | 807 | 0,03 |
| **DNB Bank ASA** | | | | |
| 2,625 % fällig am 10.06.2026 | £ | 3.400 | 4.010 | 0,13 |
| **DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH** | | | | |
| 2,500 % fällig am 25.01.2027 | € | 4.200 | 3.645 | 0,12 |
| **EQT AB** | | | | |
| 2,875 % fällig am 06.04.2032 | | 4.600 | 4.064 | 0,13 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 29.04.2030 | $ | 1.600 | 1.538 | 0,05 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 1,744 % fällig am 19.07.2024 | € | 5.400 | 5.229 | 0,17 |
| 2,700 % fällig am 10.08.2026 | $ | 3.300 | 2.816 | 0,09 |
| 2,900 % fällig am 16.02.2028 | | 900 | 727 | 0,02 |
| 3,021 % fällig am 06.03.2024 | € | 100 | 100 | 0,00 |
| 3,250 % fällig am 15.09.2025 | | 200 | 192 | 0,01 |
| 3,375 % fällig am 13.11.2025 | $ | 1.300 | 1.175 | 0,04 |
| 3,550 % fällig am 07.10.2022 | | 2.100 | 2.093 | 0,07 |
| 4,950 % fällig am 28.05.2027 | | 1.500 | 1.397 | 0,05 |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 29.07.2026 | € | 1.300 | 1.094 | 0,04 |
| 3,000 % fällig am 29.03.2025 | | 3.100 | 2.858 | 0,09 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 0,010 % fällig am 30.04.2024 | | 4.400 | 4.526 | 0,15 |
| 0,523 % fällig am 08.03.2023 | $ | 1.500 | 1.471 | 0,05 |
| 0,673 % fällig am 08.03.2024 | | 1.500 | 1.466 | 0,05 |
| 2,184 % fällig am 24.07.2023 | | 600 | 599 | 0,02 |
| 3,000 % fällig am 15.03.2024 | | 3.500 | 3.456 | 0,11 |
| 3,102 % fällig am 24.02.2033 | | 2.800 | 2.394 | 0,08 |
| 3,198 % fällig am 29.11.2023 | | 1.400 | 1.405 | 0,05 |
| 3,200 % fällig am 23.02.2023 | | 1.100 | 1.101 | 0,04 |
| 3,615 % fällig am 15.03.2028 | | 6.200 | 5.872 | 0,19 |
| 3,691 % fällig am 05.06.2028 | | 100 | 95 | 0,00 |
| **Great Rolling Stock Co. PLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 27.07.2035 | £ | 62 | 86 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Hamburg Commercial Bank AG** | | | | |
| 0,500 % fällig am 22.09.2026 | € | 2.500 | $ 2.354 | 0,08 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 1,750 % fällig am 24.07.2027 | £ | 1.100 | 1.201 | 0,04 |
| 2,871 % fällig am 22.11.2032 | $ | 4.300 | 3.523 | 0,12 |
| 2,999 % fällig am 10.03.2026 | | 3.600 | 3.431 | 0,11 |
| 3,000 % fällig am 22.07.2028 | £ | 2.300 | 2.602 | 0,09 |
| 3,900 % fällig am 25.05.2026 | $ | 900 | 881 | 0,03 |
| 3,973 % fällig am 22.05.2030 | | 4.200 | 3.862 | 0,13 |
| 4,300 % fällig am 08.03.2026 | | 400 | 397 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 16.09.2022 (f)(h) | € | 1.300 | 1.343 | 0,04 |
| 5,750 % fällig am 20.12.2027 | £ | 100 | 122 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 29.03.2040 | | 200 | 231 | 0,01 |
| **Huarong Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 24.02.2030 | $ | 800 | 603 | 0,02 |
| 3,625 % fällig am 30.09.2030 | | 1.500 | 1.155 | 0,04 |
| 3,875 % fällig am 13.11.2029 | | 2.000 | 1.598 | 0,05 |
| 4,250 % fällig am 07.11.2027 | | 200 | 175 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 29.05.2029 | | 1.400 | 1.167 | 0,04 |
| 4,750 % fällig am 27.04.2027 | | 1.000 | 904 | 0,03 |
| **Hyundai Capital Services, Inc.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.09.2023 | | 4.700 | 4.525 | 0,15 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 1,726 % fällig am 01.04.2027 | | 3.000 | 2.684 | 0,09 |
| 2,727 % fällig am 01.04.2032 | | 1.800 | 1.500 | 0,05 |
| 4,017 % fällig am 28.03.2028 | | 1.000 | 953 | 0,03 |
| 4,100 % fällig am 02.10.2023 | | 4.000 | 4.013 | 0,13 |
| 4,875 % fällig am 16.05.2029 (f)(h) | | 3.600 | 2.950 | 0,10 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 7,750 % fällig am 11.01.2027 (f)(h) | € | 2.200 | 2.189 | 0,07 |
| **JAB Holdings BV** | | | | |
| 2,200 % fällig am 23.11.2030 | $ | 4.900 | 3.870 | 0,13 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 1,963 % fällig am 23.03.2030 | € | 4.100 | 3.921 | 0,13 |
| 2,414 % fällig am 24.10.2023 | $ | 1.500 | 1.500 | 0,05 |
| 2,947 % fällig am 24.02.2028 | | 7.400 | 6.862 | 0,23 |
| **Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.11.2025 | € | 2.900 | 2.816 | 0,09 |
| **Kutxabank S.A.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 14.10.2027 | | 2.300 | 2.121 | 0,07 |
| **Lazard Group LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 19.09.2028 | $ | 4.000 | 3.839 | 0,13 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 2,875 % fällig am 24.10.2024 | | 2.200 | 2.109 | 0,07 |
| **Legal & General Group PLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 24.03.2031 (f)(h) | £ | 600 | 617 | 0,02 |
| **Lincoln Financing SARL** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.04.2024 | € | 4.400 | 4.465 | 0,15 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 16.10.2024 | £ | 900 | 1.051 | 0,03 |
| 3,750 % fällig am 11.01.2027 | $ | 5.000 | 4.831 | 0,16 |
| 3,750 % fällig am 18.03.2028 | | 5.000 | 4.762 | 0,16 |
| 4,375 % fällig am 22.03.2028 | | 400 | 389 | 0,01 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 0,625 % fällig am 17.11.2025 | € | 1.800 | 1.681 | 0,06 |
| 1,500 % fällig am 13.07.2026 | | 1.000 | 939 | 0,03 |
| 3,250 % fällig am 13.11.2028 | | 2.000 | 1.890 | 0,06 |
| **Mid-America Apartments LP** | | | | |
| 3,600 % fällig am 01.06.2027 | $ | 600 | 577 | 0,02 |
| **Midcap Financial Issuer Trust** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.01.2030 | | 200 | 156 | 0,01 |
| **Mitsubishi HC Capital, Inc.** | | | | |
| 2,652 % fällig am 19.09.2022 | | 2.500 | 2.500 | 0,08 |
| 3,960 % fällig am 19.09.2023 | | 1.600 | 1.602 | 0,05 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | |
| 0,339 % fällig am 19.07.2024 | € | 1.600 | 1.609 | 0,05 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | |
| 1,234 % fällig am 22.05.2027 | $ | 6.500 | 5.690 | 0,19 |
| 3,261 % fällig am 22.05.2030 | | 3.000 | 2.692 | 0,09 |
| 3,477 % fällig am 12.04.2026 | | 6.100 | 5.870 | 0,19 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 2,584 % fällig am 24.10.2023 | | 300 | 300 | 0,01 |
| 2,630 % fällig am 18.02.2026 | | 2.000 | 1.911 | 0,06 |
| **MPT Operating Partnership LP** | | | | |
| 3,375 % fällig am 24.04.2030 | £ | 2.500 | 2.436 | 0,08 |
| **Mutuelle Assurance Des Commercants et Industriels de France et Des Cadres et Sal** | | | | |
| 0,625 % fällig am 21.06.2027 | € | 2.800 | 2.505 | 0,08 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 1,000 % fällig am 24.01.2023 | £ | 2.900 | $ 3.487 | 0,12 |
| 3,766 % fällig am 08.03.2024 | $ | 1.100 | 1.097 | 0,04 |
| 4,302 % fällig am 08.03.2029 | | 2.000 | 1.916 | 0,06 |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 2,000 % fällig am 04.03.2025 | € | 4.300 | 4.443 | 0,15 |
| 3,747 % fällig am 25.06.2024 | $ | 400 | 400 | 0,01 |
| 3,875 % fällig am 12.09.2023 | | 3.100 | 3.092 | 0,10 |
| 4,519 % fällig am 25.06.2024 | | 200 | 200 | 0,01 |
| 4,800 % fällig am 05.04.2026 | | 700 | 699 | 0,02 |
| 4,892 % fällig am 18.05.2029 | | 700 | 679 | 0,02 |
| 8,000 % fällig am 10.08.2025 (f)(h) | | 300 | 298 | 0,01 |
| **NatWest Markets PLC** | | | | |
| 1,000 % fällig am 28.05.2024 | € | 3.300 | 8 3.37 | 0,11 |
| **NE Property BV** | | | | |
| 1,875 % fällig am 09.10.2026 | | 3.100 | 2.725 | 0,09 |
| 2,000 % fällig am 20.01.2030 | | 3.100 | 2.306 | 0,08 |
| **Nexi SpA** | | | | |
| 1,750 % fällig am 31.10.2024 | | 800 | 774 | 0,03 |
| **Nissan Motor Acceptance Co. LLC** | | | | |
| 1,125 % fällig am 16.09.2024 | $ | 1.000 | 920 | 0,03 |
| 1,850 % fällig am 16.09.2026 | | 1.700 | 1.434 | 0,05 |
| 2,450 % fällig am 15.09.2028 | | 800 | 646 | 0,02 |
| 2,600 % fällig am 28.09.2022 | | 800 | 796 | 0,03 |
| 2,650 % fällig am 13.07.2022 | | 1.200 | 1.200 | 0,04 |
| **Nova Kreditna Banka Maribor d.d.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 27.01.2025 | € | 4.200 | 4.148 | 0,14 |
| **Nova Ljubljanska Banka d.d.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 05.02.2030 | | 2.400 | 2.208 | 0,07 |
| 3,650 % fällig am 19.11.2029 | | 1.400 | 1.303 | 0,04 |
| **OneMain Finance Corp.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.03.2023 | $ | 50 | 49 | 0,00 |
| 6,125 % fällig am 15.03.2024 | | 2.150 | 2.059 | 0,07 |
| **Peugeot Invest** | | | | |
| 1,875 % fällig am 30.10.2026 | € | 3.800 | 3.666 | 0,12 |
| **Piper Sandler Cos.** | | | | |
| 5,200 % fällig am 15.10.2023 | $ | 1.600 | 1.578 | 0,05 |
| **Places for People Treasury PLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 17.08.2026 | £ | 100 | 120 | 0,00 |
| **Protective Life Global Funding** | | | | |
| 3,104 % fällig am 15.04.2024 | $ | 5.000 | 4.944 | 0,16 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 17.06.2024 | | 3.200 | 3.048 | 0,10 |
| **Realty Income Corp.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.08.2027 | | 3.000 | 2.929 | 0,10 |
| **Sagax AB** | | | | |
| 1,125 % fällig am 30.01.2027 | € | 1.700 | 1.497 | 0,05 |
| 2,250 % fällig am 13.03.2025 | | 2.900 | 2.884 | 0,10 |
| **Sagax Euro MTN NL BV** | | | | |
| 0,750 % fällig am 26.01.2028 | | 600 | 483 | 0,02 |
| 1,000 % fällig am 17.05.2029 | | 2.400 | 1.852 | 0,06 |
| **Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB** | | | | |
| 1,750 % fällig am 14.01.2025 | | 1.300 | 998 | 0,03 |
| **Santander Holdings USA, Inc.** | | | | |
| 3,244 % fällig am 05.10.2026 | $ | 100 | 94 | 0,00 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 0,664 % fällig am 27.03.2024 | € | 2.600 | 2.722 | 0,09 |
| 3,625 % fällig am 14.01.2026 | £ | 300 | 356 | 0,01 |
| 3,823 % fällig am 03.11.2028 | $ | 300 | 279 | 0,01 |
| 4,796 % fällig am 15.11.2024 | | 5.000 | 5.003 | 0,17 |
| **SBA Communications Corp.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.02.2027 | | 1.400 | 1.281 | 0,04 |
| **SBB Treasury Oyj** | | | | |
| 0,129 % fällig am 08.02.2024 | € | 3.700 | 3.188 | 0,11 |
| **Sirius Real Estate Ltd.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 22.06.2026 | | 1.100 | 995 | 0,03 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 3,337 % fällig am 21.01.2033 | $ | 4.000 | 3.277 | 0,11 |
| 4,677 % fällig am 15.06.2027 | | 4.600 | 4.575 | 0,15 |
| 7,375 % fällig am 04.10.2023 (f)(h) | | 2.900 | 2.795 | 0,09 |
| 7,875 % fällig am 18.12.2023 (f)(h) | | 200 | 196 | 0,01 |
| **Sofina S.A.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 23.09.2028 | € | 2.500 | 2.058 | 0,07 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 1,214 % fällig am 23.03.2025 | $ | 1.500 | 1.415 | 0,05 |
| 2,819 % fällig am 30.01.2026 | | 11.100 | 10.523 | 0,35 |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | |
| 6,500 % (f) | € | 683 | $ 695 | 0,02 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | |
| 2,130 % fällig am 08.07.2030 | $ | 3.100 | 2.554 | 0,08 |
| 2,222 % fällig am 17.09.2031 | | 3.500 | 2.833 | 0,09 |
| **Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.** | | | | |
| 2,550 % fällig am 10.03.2025 | | 2.400 | 2.309 | 0,08 |
| **Sun Communities Operating LP** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.04.2032 | | 2.500 | 2.276 | 0,08 |
| **TP ICAP Finance PLC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 18.11.2028 | £ | 1.000 | 1.001 | 0,03 |
| 5,250 % fällig am 26.01.2024 | | 358 | 431 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 29.05.2026 | | 1.400 | 1.663 | 0,05 |
| **UBS AG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (h) | $ | 100 | 100 | 0,00 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (h) | | 7.000 | 7.021 | 0,23 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 2,859 % fällig am 15.08.2023 | | 2.800 | 2.799 | 0,09 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 5,459 % fällig am 30.06.2035 | | 2.800 | 2.265 | 0,07 |
| 6,625 % fällig am 03.06.2023 (f)(h) | € | 700 | 696 | 0,02 |
| 7,500 % fällig am 03.06.2026 (f)(h) | | 1.800 | 1.742 | 0,06 |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | $ | 3.150 | 3.263 | 0,11 |
| **VICI Properties LP** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.02.2025 | | 1.200 | 1.124 | 0,04 |
| 4,375 % fällig am 15.05.2025 | | 1.300 | 1.272 | 0,04 |
| 4,750 % fällig am 15.02.2028 | | 5.800 | 5.547 | 0,18 |
| **Virgin Money UK PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 25.09.2026 | £ | 300 | 352 | 0,01 |
| **Volkswagen Financial Services NV** | | | | |
| 1,125 % fällig am 18.09.2023 | | 3.100 | 3.640 | 0,12 |
| 1,625 % fällig am 30.11.2022 | | 1.200 | 1.449 | 0,05 |
| 1,625 % fällig am 10.02.2024 | | 1.100 | 1.288 | 0,04 |
| 1,875 % fällig am 03.12.2024 | | 2.000 | 2.306 | 0,08 |
| **Vonovia SE** | | | | |
| 1,375 % fällig am 28.01.2026 | € | 400 | 388 | 0,01 |
| 1,875 % fällig am 28.06.2028 | | 2.500 | 2.295 | 0,08 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 2,469 % fällig am 31.10.2023 | $ | 2.600 | 2.602 | 0,09 |
| 3,526 % fällig am 24.03.2028 | | 8.500 | 8.058 | 0,27 |
| | | | 575.715 | 19,05 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **Abertis Infraestructuras S.A.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 26.03.2028 | € | 300 | 271 | 0,01 |
| 1,625 % fällig am 15.07.2029 | | 1.000 | 892 | 0,03 |
| **Aeroporti di Roma SpA** | | | | |
| 1,750 % fällig am 30.07.2031 | | 2.700 | 2.164 | 0,07 |
| 5,441 % fällig am 20.02.2023 | £ | 800 | 982 | 0,03 |
| **Air Canada** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.08.2026 | $ | 1.200 | 1.018 | 0,03 |
| **Alaska Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,800 % fällig am 15.02.2029 | | 1.853 | 1.832 | 0,06 |
| **Altice France Holding S.A.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.02.2028 (k) | € | 1.100 | 784 | 0,03 |
| **Altice France S.A.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.02.2025 | | 1.600 | 1.451 | 0,05 |
| 4,250 % fällig am 15.10.2029 | | 2.000 | 1.567 | 0,05 |
| 5,500 % fällig am 15.10.2029 | $ | 2.100 | 1.611 | 0,05 |
| **AMC Networks, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.08.2025 | | 100 | 93 | 0,00 |
| **American Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,150 % fällig am 15.08.2033 | | 624 | 554 | 0,02 |
| 3,250 % fällig am 15.04.2030 | | 19 | 16 | 0,00 |
| 3,375 % fällig am 01.11.2028 | | 1.107 | 994 | 0,03 |
| 3,650 % fällig am 15.08.2030 | | 758 | 708 | 0,02 |
| 3,700 % fällig am 01.04.2028 | | 240 | 208 | 0,01 |
| **American Airlines, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 20.04.2026 | | 4.900 | 4.519 | 0,15 |
| 5,750 % fällig am 20.04.2029 | | 500 | 429 | 0,01 |
| **American Medical Systems Europe BV** | | | | |
| 1,375 % fällig am 08.03.2028 | € | 3.800 | 3.635 | 0,12 |
| **Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.06.2030 | $ | 600 | 563 | 0,02 |
| **Aptiv PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 01.03.2032 | | 1.000 | 851 | 0,03 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Atlantia SpA** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 12.02.2028 | € | 7.400 | $ | 6.042 | 0,20 |
| **Bacardi Ltd.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 03.07.2023 | | 2.400 | | 2.528 | 0,08 |
| **Becton Dickinson and Co.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 13.08.2023 (c) | | 2.600 | | 2.672 | 0,09 |
| 0,034 % fällig am 13.08.2025 | | 1.000 | | 969 | 0,03 |
| **Bellis Acquisition Co. PLC** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 16.02.2026 | £ | 6.200 | | 5.873 | 0,19 |
| **BK LC Lux Finco SARL** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 30.04.2029 | € | 1.200 | | 999 | 0,03 |
| **Boeing Co.** | | | | | |
| 2,196 % fällig am 04.02.2026 | $ | 8.600 | | 7.765 | 0,26 |
| 2,750 % fällig am 01.02.2026 | | 4.100 | | 3.814 | 0,13 |
| **Boston Scientific Corp.** | | | | | |
| 2,650 % fällig am 01.06.2030 | | 11.600 | | 10.133 | 0,34 |
| 3,450 % fällig am 01.03.2024 | | 525 | | 525 | 0,02 |
| **British Airways Pass-Through Trust** | | | | | |
| 3,300 % fällig am 15.06.2034 | | 92 | | 82 | 0,00 |
| 4,250 % fällig am 15.05.2034 | | 333 | | 322 | 0,01 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | | |
| 3,469 % fällig am 15.04.2034 | | 200 | | 163 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 15.04.2029 | | 4.000 | | 3.710 | 0,12 |
| **Caesars Entertainment, Inc.** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 01.07.2025 | | 500 | | 484 | 0,02 |
| **Cargo Aircraft Management, Inc.** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.02.2028 | | 600 | | 548 | 0,02 |
| **Central Japan Railway Co.** | | | | | |
| 3,400 % fällig am 06.09.2023 | | 400 | | 399 | 0,01 |
| **Chanel Ceres PLC** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 31.07.2026 | € | 1.300 | | 1.246 | 0,04 |
| 1,000 % fällig am 31.07.2031 | | 2.100 | | 1.816 | 0,06 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | | |
| 3,900 % fällig am 01.06.2052 | $ | 2.200 | | 1.532 | 0,05 |
| 4,400 % fällig am 01.12.2061 | | 8.200 | | 5.914 | 0,20 |
| **Cheniere Corpus Christi Holdings LLC** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 31.03.2025 | | 20 | | 21 | 0,00 |
| **Cigna Corp.** | | | | | |
| 1,934 % fällig am 15.07.2023 | | 300 | | 300 | 0,01 |
| **Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar oder 4,000 % PIK)** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.12.2026 (a) | | 545 | | 403 | 0,01 |
| **Coty, Inc.** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.04.2026 | € | 3.500 | | 3.246 | 0,11 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2029 | $ | 1.350 | | 1.162 | 0,04 |
| 5,000 % fällig am 15.04.2026 | | 5.600 | | 5.141 | 0,17 |
| **D.R. Horton, Inc.** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.09.2022 | | 300 | | 300 | 0,01 |
| **DAE Funding LLC** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 15.02.2024 | | 700 | | 663 | 0,02 |
| 3,375 % fällig am 20.03.2028 | | 7.600 | | 6.695 | 0,22 |
| **Dell International LLC** | | | | | |
| 5,450 % fällig am 15.06.2023 | | 613 | | 619 | 0,02 |
| 5,850 % fällig am 15.07.2025 | | 700 | | 723 | 0,02 |
| **Delta Air Lines, Inc.** | | | | | |
| 7,000 % fällig am 01.05.2025 | | 800 | | 811 | 0,03 |
| **Discovery Communications LLC** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 20.09.2024 | £ | 100 | | 119 | 0,00 |
| **East Japan Railway Co.** | | | | | |
| 0,773 % fällig am 15.09.2034 | € | 1.000 | | 790 | 0,03 |
| 1,104 % fällig am 15.09.2039 | | 800 | | 588 | 0,02 |
| 1,162 % fällig am 15.09.2028 | £ | 600 | | 645 | 0,02 |
| **eBay, Inc.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.01.2023 | $ | 600 | | 599 | 0,02 |
| **Elevance Health, Inc.** | | | | | |
| 2,950 % fällig am 01.12.2022 | | 200 | | 200 | 0,01 |
| **Energean Israel Finance Ltd.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 30.03.2024 | | 1.200 | | 1.133 | 0,04 |
| **Energy Transfer LP** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.10.2022 | | 200 | | 200 | 0,01 |
| 5,300 % fällig am 01.04.2044 | | 500 | | 435 | 0,01 |
| **EQT Corp.** | | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.02.2025 | | 1.800 | | 1.855 | 0,06 |
| **Exela Intermediate LLC** | | | | | |
| 11,500 % fällig am 15.07.2026 | | 218 | | 73 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Expedia Group, Inc.** | | | | | |
| 2,950 % fällig am 15.03.2031 | $ | 2.000 | $ | 1.593 | 0,05 |
| 6,250 % fällig am 01.05.2025 | | 527 | | 543 | 0,02 |
| **FactSet Research Systems, Inc.** | | | | | |
| 3,450 % fällig am 01.03.2032 | | 1.400 | | 1.229 | 0,04 |
| **Frontier Communications Holdings LLC** | | | | | |
| 8,750 % fällig am 15.05.2030 | | 3.300 | | 3.343 | 0,11 |
| **GE Capital UK Funding Unlimited Co.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 18.01.2033 | £ | 300 | | 404 | 0,01 |
| **Greene King Finance PLC** | | | | | |
| 3,088 % fällig am 15.12.2034 | | 100 | | 100 | 0,00 |
| 5,318 % fällig am 15.09.2031 | | 354 | | 445 | 0,01 |
| **Grifols Escrow Issuer S.A.** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.10.2028 | € | 2.700 | | 2.338 | 0,08 |
| **GSK Consumer Healthcare Capital U.S. LLC** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 24.03.2027 | $ | 1.000 | | 958 | 0,03 |
| 3,375 % fällig am 24.03.2029 | | 2.100 | | 1.967 | 0,07 |
| **GSK Consumer Healthcare Capital UK PLC** | | | | | |
| 3,125 % fällig am 24.03.2025 | | 2.000 | | 1.950 | 0,06 |
| **HCA, Inc.** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.06.2029 | | 2.700 | | 2.464 | 0,08 |
| **Hilton Domestic Operating Co., Inc.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.02.2032 | | 2.400 | | 1.912 | 0,06 |
| 3,750 % fällig am 01.05.2029 | | 6.500 | | 5.522 | 0,18 |
| **Hyatt Hotels Corp.** | | | | | |
| 1,800 % fällig am 01.10.2024 | | 900 | | 851 | 0,03 |
| 2,563 % fällig am 01.10.2023 | | 1.400 | | 1.398 | 0,05 |
| **Imperial Brands Finance Netherlands BV** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 18.03.2033 | € | 2.100 | | 1.596 | 0,05 |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 21.07.2025 | $ | 200 | | 198 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 28.09.2026 | £ | 600 | | 749 | 0,03 |
| **INEOS Styrolution Group GmbH** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 16.01.2027 | € | 4.500 | | 3.652 | 0,12 |
| **Informa PLC** | | | | | |
| 1,250 % fällig am 22.04.2028 | | 3.000 | | 2.750 | 0,09 |
| 1,500 % fällig am 05.07.2023 | | 400 | | 412 | 0,01 |
| **InterContinental Hotels Group PLC** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 24.08.2026 | £ | 200 | | 221 | 0,01 |
| 2,125 % fällig am 15.05.2027 | € | 700 | | 675 | 0,02 |
| 3,375 % fällig am 08.10.2028 | £ | 1.300 | | 1.441 | 0,05 |
| **John Lewis PLC** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 18.12.2034 | | 1.300 | | 1.201 | 0,04 |
| 6,125 % fällig am 21.01.2025 | | 350 | | 439 | 0,01 |
| **Kansas City Southern** | | | | | |
| 3,125 % fällig am 01.06.2026 | $ | 200 | | 193 | 0,01 |
| **Komatsu Finance America, Inc.** | | | | | |
| 2,437 % fällig am 11.09.2022 | | 1.000 | | 999 | 0,03 |
| **Lendlease Europe Finance PLC** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 02.12.2033 | £ | 1.900 | | 1.807 | 0,06 |
| **Magallanes, Inc.** | | | | | |
| 3,528 % fällig am 15.03.2024 | $ | 4.000 | | 3.919 | 0,13 |
| 4,279 % fällig am 15.03.2032 | | 2.700 | | 2.416 | 0,08 |
| **Marks & Spencer PLC** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 19.05.2026 | £ | 2.000 | | 2.138 | 0,07 |
| **Marriott International, Inc.** | | | | | |
| 2,850 % fällig am 15.04.2031 | $ | 1.000 | | 830 | 0,03 |
| 3,500 % fällig am 15.10.2032 | | 1.100 | | 950 | 0,03 |
| **Melco Resorts Finance Ltd.** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 21.07.2028 | | 200 | | 129 | 0,00 |
| **MGM China Holdings Ltd.** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 18.06.2025 | | 200 | | 154 | 0,01 |
| 5,875 % fällig am 15.05.2026 | | 200 | | 151 | 0,01 |
| **Mileage Plus Holdings LLC** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 20.06.2027 | | 2.300 | | 2.267 | 0,08 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | | |
| 2,279 % fällig am 15.12.2030 | | 135 | | 125 | 0,00 |
| 6,013 % fällig am 15.12.2030 | £ | 1.483 | | 1.838 | 0,06 |
| 6,469 % fällig am 15.09.2032 | | 400 | | 504 | 0,02 |
| **Mondelez International, Inc.** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 17.03.2024 | $ | 2.500 | | 2.438 | 0,08 |
| **MPH Acquisition Holdings LLC** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.09.2028 | | 2.900 | | 2.589 | 0,09 |
| **National Express Group PLC** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 20.11.2028 | £ | 1.000 | | 1.083 | 0,04 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Nidec Corp.** | | | | | |
| 0,046 % fällig am 30.03.2026 | € | 1.500 | $ | 1.420 | 0,05 |
| **Nissan Motor Co. Ltd.** | | | | | |
| 1,940 % fällig am 15.09.2023 | | 600 | | 624 | 0,02 |
| 2,652 % fällig am 17.03.2026 | | 400 | | 391 | 0,01 |
| 4,345 % fällig am 17.09.2027 | $ | 4.700 | | 4.318 | 0,14 |
| 4,810 % fällig am 17.09.2030 | | 5.400 | | 4.802 | 0,16 |
| **Organon & Co.** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 30.04.2028 | | 3.400 | | 3.022 | 0,10 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | | | |
| 3,950 % fällig am 10.03.2025 | | 800 | | 789 | 0,03 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | | |
| 5,950 % fällig am 28.01.2031 | | 200 | | 147 | 0,01 |
| 6,700 % fällig am 16.02.2032 | | 1.693 | | 1.294 | 0,04 |
| **Prosus NV** | | | | | |
| 1,207 % fällig am 19.01.2026 | € | 1.000 | | 912 | 0,03 |
| 2,085 % fällig am 19.01.2030 | | 1.300 | | 1.041 | 0,03 |
| **RAC Bond Co. PLC** | | | | | |
| 4,565 % fällig am 06.05.2046 | £ | 100 | | 121 | 0,00 |
| **Rolls-Royce PLC** | | | | | |
| 4,625 % fällig am 16.02.2026 | € | 1.000 | | 985 | 0,03 |
| 5,750 % fällig am 15.10.2027 | £ | 700 | | 802 | 0,03 |
| **Ryder System, Inc.** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.09.2022 | $ | 500 | | 500 | 0,02 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2027 | | 500 | | 502 | 0,02 |
| 5,625 % fällig am 01.03.2025 | | 1.400 | | 1.430 | 0,05 |
| 5,750 % fällig am 15.05.2024 | | 200 | | 204 | 0,01 |
| 5,875 % fällig am 30.06.2026 | | 2.500 | | 2.587 | 0,09 |
| **Safran S.A.** | | | | | |
| 0,125 % fällig am 16.03.2026 | € | 3.200 | | 3.028 | 0,10 |
| **Sage Group PLC** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 25.02.2031 | £ | 1.700 | | 1.688 | 0,06 |
| **Sands China Ltd.** | | | | | |
| 2,550 % fällig am 08.03.2027 | $ | 200 | | 146 | 0,01 |
| 3,100 % fällig am 08.03.2029 | | 1.200 | | 851 | 0,03 |
| **Sasol Financing USA LLC** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 27.03.2024 | | 8.200 | | 8.041 | 0,27 |
| **Scripps Escrow, Inc.** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.01.2029 | | 1.000 | | 840 | 0,03 |
| **Sixt SE** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 09.12.2024 | € | 1.300 | | 1.330 | 0,04 |
| **Southern Co.** | | | | | |
| 3,700 % fällig am 30.04.2030 | $ | 800 | | 743 | 0,02 |
| **Spirit AeroSystems, Inc.** | | | | | |
| 4,600 % fällig am 15.06.2028 | | 1.100 | | 814 | 0,03 |
| **Standard Industries, Inc.** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 21.11.2026 | € | 2.200 | | 1.806 | 0,06 |
| **Studio City Finance Ltd.** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2029 | $ | 1.400 | | 725 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 15.07.2025 | | 200 | | 127 | 0,00 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 16.04.2026 | € | 1.800 | | 1.860 | 0,06 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.11.2031 | $ | 2.500 | | 2.031 | 0,07 |
| 3,875 % fällig am 15.04.2030 | | 2.100 | | 1.962 | 0,07 |
| **Targa Resources Corp.** | | | | | |
| 4,200 % fällig am 01.02.2033 | | 800 | | 726 | 0,02 |
| **TDF Infrastructure SASU** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 01.12.2029 | € | 2.500 | | 2.164 | 0,07 |
| **Tesco Corporate Treasury Services PLC** | | | | | |
| 0,375 % fällig am 27.07.2029 | | 900 | | 729 | 0,02 |
| 0,875 % fällig am 29.05.2026 | | 2.000 | | 1.903 | 0,06 |
| **Toyota Tsusho Corp.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 13.09.2023 | $ | 1.000 | | 999 | 0,03 |
| **U.S. Airways Pass-Through Trust** | | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.05.2027 | | 191 | | 174 | 0,01 |
| **Ubisoft Entertainment S.A.** | | | | | |
| 0,878 % fällig am 24.11.2027 | € | 1.000 | | 864 | 0,03 |
| **Unigel Luxembourg S.A.** | | | | | |
| 8,750 % fällig am 01.10.2026 | $ | 200 | | 198 | 0,01 |
| **United Airlines Pass-Through Trust** | | | | | |
| 2,700 % fällig am 01.11.2033 | | 1.092 | | 934 | 0,03 |
| 5,875 % fällig am 15.04.2029 | | 2.032 | | 2.001 | 0,07 |
| **United Airlines, Inc.** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.04.2026 | | 800 | | 708 | 0,02 |
| 4,625 % fällig am 15.04.2029 | | 500 | | 426 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Venture Global Calcasieu Pass LLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.11.2033 | $ | 5.000 | $ 4.140 | 0,14 |
| **ViaSat, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.09.2025 | | 300 | 243 | 0,01 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.01.2030 | £ | 3.300 | 3.239 | 0,11 |
| **Vmed O2 UK Financing PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.07.2031 | | 700 | 674 | 0,02 |
| **VMware, Inc.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 21.08.2027 | $ | 900 | 865 | 0,03 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | | |
| 3,350 % fällig am 13.05.2025 | | 1.500 | 1.451 | 0,05 |
| **Werfenlife S.A.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 28.10.2026 | € | 1.500 | 1.421 | 0,05 |
| **Western Digital Corp.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.02.2026 | $ | 700 | 670 | 0,02 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.10.2027 | | 200 | 130 | 0,00 |
| 5,625 % fällig am 26.08.2028 | | 1.100 | 681 | 0,02 |
| **Wynn Resorts Finance LLC** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.04.2025 | | 300 | 292 | 0,01 |
| **Ziggo BV** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2030 | | 4.700 | 3.998 | 0,13 |
| | | | 255.793 | 8,47 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **AES Corp.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 15.01.2031 | | 9.000 | 7.247 | 0,24 |
| **Alabama Power Co.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 15.07.2048 | | 1.400 | 1.284 | 0,04 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 02.03.2025 (f) | € | 1.600 | 1.466 | 0,05 |
| 3,650 % fällig am 15.09.2059 | $ | 185 | 139 | 0,01 |
| **Boston Gas Co.** | | | | |
| 3,757 % fällig am 16.03.2032 | | 1.900 | 1.773 | 0,06 |
| **British Telecommunications PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 04.12.2023 | | 200 | 201 | 0,01 |
| **DTE Electric Co.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 01.03.2031 | | 1.200 | 1.066 | 0,04 |
| **Electricite de France S.A.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 03.09.2027 (f) | € | 800 | 639 | 0,02 |
| **Georgia Power Co.** | | | | |
| 2,100 % fällig am 30.07.2023 | $ | 5.580 | 5.502 | 0,18 |
| 4,700 % fällig am 15.05.2032 | | 2.000 | 2.008 | 0,07 |
| **London Power Networks PLC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 01.03.2029 | £ | 1.500 | 1.713 | 0,06 |
| **Lumen Technologies, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.02.2027 | $ | 300 | 254 | 0,01 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 01.11.2029 | | 800 | 708 | 0,02 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | | |
| 1,367 % fällig am 10.03.2023 | | 2.200 | 2.167 | 0,07 |
| 1,700 % fällig am 15.11.2023 | | 400 | 386 | 0,01 |
| 2,100 % fällig am 01.08.2027 | | 1.900 | 1.594 | 0,05 |
| 3,150 % fällig am 01.01.2026 | | 1.300 | 1.192 | 0,04 |
| 3,450 % fällig am 01.07.2025 | | 200 | 188 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 15.06.2025 | | 600 | 569 | 0,02 |
| 3,950 % fällig am 01.12.2047 | | 200 | 139 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 01.12.2046 | | 300 | 211 | 0,01 |
| 4,550 % fällig am 01.07.2030 | | 8.300 | 7.383 | 0,24 |
| 5,450 % fällig am 15.06.2027 | | 3.000 | 2.906 | 0,10 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 6,250 % fällig am 14.12.2026 | £ | 1.323 | 1.562 | 0,05 |
| **Public Service Enterprise Group, Inc.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 15.11.2022 | $ | 800 | 799 | 0,03 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | | |
| 8,200 % fällig am 06.04.2028 | | 448 | 466 | 0,02 |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | | 307 | 319 | 0,01 |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027 | | 126 | 135 | 0,00 |
| **Southern California Edison Co.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 01.02.2032 | | 7.900 | 6.682 | 0,22 |
| **Southern California Gas Co.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 15.04.2027 | | 5.200 | 4.926 | 0,16 |
| **Southwest Gas Corp.** | | | | |
| 4,050 % fällig am 15.03.2032 | | 1.800 | 1.635 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Sprint Corp.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 01.03.2026 | $ | 800 | $ 845 | 0,03 |
| **Systems Energy Resources, Inc.** | | | | |
| 2,140 % fällig am 09.12.2025 | | 700 | 651 | 0,02 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 18.09.2030 | | 4.600 | 3.681 | 0,12 |
| 3,875 % fällig am 01.03.2052 | | 1.900 | 1.596 | 0,05 |
| | | | 64.032 | 2,12 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 895.540 | 29,64 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.06.2046 | | 440 | 387 | 0,01 |
| 3,487 % fällig am 01.06.2036 | | 1.300 | 1.095 | 0,03 |
| **Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021** | | | | |
| 2,587 % fällig am 01.06.2029 | | 4.000 | 3.557 | 0,12 |
| **Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2007** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.06.2047 (c) | | 4.700 | 381 | 0,01 |
| **Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2020** | | | | |
| 3,151 % fällig am 01.06.2032 | | 200 | 173 | 0,01 |
| 3,401 % fällig am 01.06.2034 | | 1.150 | 976 | 0,03 |
| 3,501 % fällig am 01.06.2035 | | 1.700 | 1.430 | 0,05 |
| | | | 7.999 | 0,26 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Ginnie Mae** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.07.2045 | | 18.707 | 18.514 | 0,61 |
| **Ginnie Mae, TBA** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 | | 7.100 | 6.500 | 0,22 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.12.2047 - 01.07.2048 | | 13.381 | 13.089 | 0,43 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.07.2052 | | 82.000 | 71.186 | 2,36 |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 | | 19.600 | 17.632 | 0,58 |
| 3,000 % fällig am 01.07.2052 | | 57.100 | 53.197 | 1,76 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2052 | | 31.400 | 30.171 | 1,00 |
| | | | 210.289 | 6,96 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | | |
| 1,875 % fällig am 15.02.2041 | | 15.600 | 12.242 | 0,41 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 | | 40 | 45 | 0,00 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 0,250 % fällig am 30.09.2025 | | 24.400 | 22.296 | 0,74 |
| 0,375 % fällig am 30.11.2025 | | 15.600 | 14.252 | 0,47 |
| 1,250 % fällig am 31.08.2024 | | 37.300 | 35.941 | 1,19 |
| 1,750 % fällig am 30.06.2024 | | 21.600 | 21.085 | 0,70 |
| 1,875 % fällig am 31.08.2022 | | 34.500 | 34.517 | 1,14 |
| 1,875 % fällig am 31.08.2024 | | 650 | 635 | 0,02 |
| 2,000 % fällig am 31.10.2022 | | 3.200 | 3.199 | 0,10 |
| 2,000 % fällig am 30.11.2022 | | 26.940 | 26.898 | 0,89 |
| 2,125 % fällig am 31.03.2024 | | 610 | 601 | 0,02 |
| 2,125 % fällig am 30.09.2024 | | 87.000 | 85.401 | 2,83 |
| 2,125 % fällig am 30.11.2024 | | 520 | 509 | 0,02 |
| 2,250 % fällig am 15.11.2024 | | 3.340 | 3.284 | 0,11 |
| 2,375 % fällig am 31.01.2023 | | 65.900 | 65.820 | 2,18 |
| 2,375 % fällig am 15.08.2024 | | 550 | 543 | 0,02 |
| 2,500 % fällig am 31.01.2024 | | 870 | 864 | 0,03 |
| 2,875 % fällig am 30.11.2023 | | 750 | 749 | 0,02 |
| | | | 328.881 | 10,89 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,855 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 314 | 260 | 0,01 |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 2,204 % fällig am 25.11.2045 | | 1.571 | 1.433 | 0,05 |
| **Atlas Funding PLC** | | | | |
| 1,388 % fällig am 25.07.2058 | £ | 885 | 1.064 | 0,04 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 1,932 % fällig am 20.02.2047 | $ | 732 | 755 | 0,03 |
| 1,992 % fällig am 20.07.2036 | | 1.396 | 1.355 | 0,05 |
| 6,412 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 9 | 8 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Barley Hill PLC** | | | | |
| 1,892 % fällig am 27.08.2058 | £ | 4.312 | $ 5.176 | 0,17 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 1,166 % fällig am 26.11.2036 | $ | 351 | 350 | 0,01 |
| 1,804 % fällig am 25.03.2037 | | 60 | 56 | 0,00 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,400 % fällig am 25.02.2036 | | 12 | 11 | 0,00 |
| 2,665 % fällig am 25.01.2035 | | 17 | 16 | 0,00 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 2,922 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 86 | 40 | 0,00 |
| **Brass PLC** | | | | |
| 0,871 % fällig am 16.11.2066 | £ | 1.727 | 2.095 | 0,07 |
| 1,080 % fällig am 16.10.2059 | | 144 | 175 | 0,01 |
| 2,111 % fällig am 16.11.2066 | $ | 779 | 779 | 0,03 |
| **Business Mortgage Finance PLC** | | | | |
| 1,662 % fällig am 15.08.2040 | £ | 0 | 0 | 0,00 |
| **Canada Square Funding PLC** | | | | |
| 1,550 % fällig am 17.10.2051 | | 3.912 | 4.747 | 0,16 |
| **Charter Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,540 % fällig am 16.01.2057 | | 184 | 223 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 3,790 % fällig am 25.09.2035 | $ | 5 | 5 | 0,00 |
| **Clavis Securities PLC** | | | | |
| 1,759 % fällig am 15.12.2032 | £ | 249 | 290 | 0,01 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,476 % fällig am 25.12.2035 | $ | 52 | 45 | 0,00 |
| 1,904 % fällig am 25.04.2047 | | 340 | 298 | 0,01 |
| 1,944 % fällig am 25.09.2047 | | 40 | 36 | 0,00 |
| 2,044 % fällig am 25.07.2046 | | 13 | 12 | 0,00 |
| 2,252 % fällig am 20.12.2035 | | 1.039 | 953 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 25.04.2035 | | 1.087 | 833 | 0,03 |
| 5,750 % fällig am 25.05.2036 | | 75 | 39 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 134 | 88 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 | | 439 | 259 | 0,01 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,750 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 13 | 7 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 529 | 301 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.08.2037 | | 675 | 431 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | | 282 | 174 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 7 | 3 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | | |
| 1,506 % fällig am 30.11.2037 | | 32 | 32 | 0,00 |
| **Domi BV** | | | | |
| 0,569 % fällig am 15.06.2051 | € | 894 | 933 | 0,03 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,802 % fällig am 19.10.2036 | $ | 429 | 376 | 0,01 |
| **Dutch Property Finance BV** | | | | |
| 0,235 % fällig am 28.07.2054 | € | 387 | 401 | 0,01 |
| **EMF-UK PLC** | | | | |
| 2,570 % fällig am 13.03.2046 | £ | 49 | 60 | 0,00 |
| **Eurohome UK Mortgages PLC** | | | | |
| 1,739 % fällig am 15.06.2044 | | 121 | 143 | 0,01 |
| **European Loan Conduit DAC** | | | | |
| 1,000 % fällig am 17.02.2030 | € | 3.582 | 3.697 | 0,12 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 2,540 % fällig am 13.06.2045 | £ | 285 | 341 | 0,01 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | |
| 1,565 % fällig am 16.03.2070 | | 1.013 | 1.222 | 0,04 |
| 1,775 % fällig am 16.12.2069 | | 1.451 | 1.754 | 0,06 |
| 1,795 % fällig am 16.09.2069 | | 1.060 | 1.286 | 0,04 |
| **Friary PLC** | | | | |
| 1,358 % fällig am 21.11.2067 | | 600 | 729 | 0,02 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 1,048 % fällig am 18.06.2038 | | 66 | 79 | 0,00 |
| 1,753 % fällig am 18.06.2039 | | 108 | 129 | 0,00 |
| **GSMPS Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,974 % fällig am 25.03.2035 | $ | 102 | 98 | 0,00 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 | | 1.284 | 1.025 | 0,03 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,802 % fällig am 19.01.2038 | | 41 | 37 | 0,00 |
| 1,817 % fällig am 19.12.2036 | | 4.145 | 3.645 | 0,12 |
| 2,476 % fällig am 19.10.2035 | | 483 | 299 | 0,01 |
| **Harmony French Home Loans** | | | | |
| 0,301 % fällig am 27.05.2062 | € | 7.500 | 7.818 | 0,26 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | | |
| 1,703 % fällig am 25.05.2053 | £ | 2.339 | $ 2.836 | 0,09 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,044 % fällig am 25.07.2036 | $ | 2.032 | 1.928 | 0,06 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,984 % fällig am 25.06.2037 | | 4.322 | 2.563 | 0,09 |
| **Jubilee Place BV** | | | | |
| 0,552 % fällig am 17.10.2057 | € | 2.272 | 2.346 | 0,08 |
| **Landmark Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 1,439 % fällig am 17.04.2044 | £ | 184 | 206 | 0,01 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 2,024 % fällig am 25.08.2046 | $ | 206 | 190 | 0,01 |
| 2,074 % fällig am 25.08.2046 | | 401 | 391 | 0,01 |
| **London Wall Mortgage Capital PLC** | | | | |
| 1,570 % fällig am 15.11.2049 | £ | 104 | 126 | 0,00 |
| **Ludgate Funding PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.12.2060 | € | 23 | 23 | 0,00 |
| 1,608 % fällig am 01.12.2060 | £ | 161 | 185 | 0,01 |
| **Mansard Mortgages PLC** | | | | |
| 0,752 % fällig am 15.04.2047 | | 44 | 51 | 0,00 |
| 1,529 % fällig am 15.12.2049 | | 184 | 219 | 0,01 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | | |
| 3,874 % fällig am 25.11.2034 | $ | 974 | 961 | 0,03 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,421 % fällig am 25.12.2037 | | 1.116 | 794 | 0,03 |
| 6,354 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 10.770 | 2.466 | 0,08 |
| **Mortgage Equity Conversion Asset Trust** | | | | |
| 3,280 % fällig am 25.05.2042 | | 457 | 447 | 0,02 |
| **Mortimer BTL PLC** | | | | |
| 2,090 % fällig am 20.06.2051 | £ | 2.187 | 2.658 | 0,09 |
| **NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates** | | | | |
| 6,500 % fällig am 25.02.2035 ^ | $ | 565 | 523 | 0,02 |
| **New Century Alternative Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,680 % fällig am 25.10.2036 | | 510 | 125 | 0,00 |
| **Newgate Funding PLC** | | | | |
| 0,319 % fällig am 15.12.2050 | € | 90 | 93 | 0,00 |
| 1,749 % fällig am 15.12.2050 | £ | 251 | 289 | 0,01 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 0,371 % fällig am 25.09.2046 | $ | 2.188 | 811 | 0,03 |
| **OBX Trust** | | | | |
| 2,274 % fällig am 25.06.2057 | | 171 | 167 | 0,01 |
| **Paragon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,651 % fällig am 15.05.2045 | £ | 1.265 | 1.528 | 0,05 |
| **Pepper Residential Securities Trust** | | | | |
| 2,193 % fällig am 16.09.2059 | AUD | 360 | 247 | 0,01 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 5,750 % fällig am 25.06.2036 | $ | 23 | 20 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 | | 1.049 | 938 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 | | 155 | 134 | 0,01 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | | |
| 6,500 % fällig am 25.06.2037 | | 2.895 | 832 | 0,03 |
| **RESIMAC Bastille Trust** | | | | |
| 1,682 % fällig am 05.12.2059 | | 109 | 109 | 0,00 |
| **Ribbon Finance PLC** | | | | |
| 1,360 % fällig am 20.04.2028 | £ | 189 | 228 | 0,01 |
| **RMAC PLC** | | | | |
| 1,571 % fällig am 12.06.2046 | | 174 | 210 | 0,01 |
| 1,841 % fällig am 12.06.2046 | | 239 | 290 | 0,01 |
| **RMAC Securities PLC** | | | | |
| 1,021 % fällig am 12.06.2044 | | 49 | 57 | 0,00 |
| **Shamrock Residential DAC** | | | | |
| 0,338 % fällig am 24.12.2059 | € | 2.543 | 2.641 | 0,09 |
| 0,338 % fällig am 24.01.2061 | | 3.859 | 3.979 | 0,13 |
| **Silverstone Master Issuer PLC** | | | | |
| 1,216 % fällig am 21.01.2070 | £ | 2.046 | 2.484 | 0,08 |
| **Stratton BTL Mortgage Funding** | | | | |
| 1,217 % fällig am 20.01.2054 | | 10.910 | 13.085 | 0,43 |
| **Stratton Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2060 | | 4.388 | 5.287 | 0,18 |
| 1,674 % fällig am 25.09.2051 | | 10.563 | 12.759 | 0,42 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 1,844 % fällig am 25.09.2047 | $ | 761 | 651 | 0,02 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2045 | £ | 1.573 | 1.908 | 0,06 |
| 1,547 % fällig am 20.02.2045 | | 333 | 403 | 0,01 |
| 1,605 % fällig am 20.10.2051 | | 5.002 | 6.056 | 0,20 |
| 1,827 % fällig am 20.02.2054 | | 1.040 | 1.263 | 0,04 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Trinidad Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 1,404 % fällig am 24.01.2059 | £ | 57 | $ 69 | 0,00 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | |
| 1,602 % fällig am 12.03.2055 | | 9.373 | 11.077 | 0,37 |
| 1,632 % fällig am 12.09.2050 | | 267 | 323 | 0,01 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 3,325 % fällig am 25.02.2037 | $ | 77 | 73 | 0,00 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,224 % fällig am 25.07.2036 | | 107 | 60 | 0,00 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 3,615 % fällig am 25.07.2034 | | 12 | 12 | 0,00 |
| | | | 133.542 | 4,42 |

## FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,884 % fällig am 25.09.2036 | | 724 | 710 | 0,02 |
| 2,569 % fällig am 25.09.2035 | | 1.500 | 1.323 | 0,04 |
| **Accunia European CLO DAC** | | | | |
| 0,950 % fällig am 15.07.2030 | € | 2.601 | 2.685 | 0,09 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,904 % fällig am 25.07.2036 | $ | 105 | 83 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.07.2036 | | 1.057 | 420 | 0,01 |
| 2,239 % fällig am 25.12.2035 | | 2.800 | 2.682 | 0,09 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,329 % fällig am 25.11.2035 | | 1.515 | 1.492 | 0,05 |
| 2,494 % fällig am 25.01.2036 | | 3.400 | 3.266 | 0,11 |
| 2,644 % fällig am 25.09.2034 | | 1.612 | 1.596 | 0,05 |
| **Apidos CLO** | | | | |
| 1,974 % fällig am 17.07.2030 | | 1.500 | 1.479 | 0,05 |
| 2,073 % fällig am 20.04.2031 | | 1.000 | 983 | 0,03 |
| **Aqueduct European CLO DAC** | | | | |
| 0,640 % fällig am 20.07.2030 | € | 9.195 | 9.473 | 0,31 |
| **Ares European CLO DAC** | | | | |
| 0,850 % fällig am 20.04.2032 | | 2.500 | 2.546 | 0,08 |
| 1,120 % fällig am 21.10.2033 | | 8.000 | 8.215 | 0,27 |
| **Argent Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,104 % fällig am 25.05.2035 | $ | 82 | 74 | 0,00 |
| **Argent Securities Trust** | | | | |
| 1,844 % fällig am 25.05.2036 | | 169 | 46 | 0,00 |
| 1,924 % fällig am 25.07.2036 | | 114 | 101 | 0,00 |
| **Atlas Senior Loan Fund Ltd.** | | | | |
| 2,134 % fällig am 15.01.2031 | | 3.045 | 3.000 | 0,10 |
| **Atrium Corp.** | | | | |
| 1,966 % fällig am 22.04.2027 | | 847 | 835 | 0,03 |
| **Aurium CLO DAC** | | | | |
| 0,730 % fällig am 16.01.2031 | € | 4.700 | 4.828 | 0,16 |
| 1,050 % fällig am 23.03.2032 | | 5.000 | 5.128 | 0,17 |
| **Bain Capital Euro DAC** | | | | |
| 1,100 % fällig am 24.01.2033 | | 2.000 | 2.051 | 0,07 |
| **Barings CLO Ltd.** | | | | |
| 1,863 % fällig am 20.01.2028 | $ | 1.692 | 1.673 | 0,06 |
| **Bayview Financial Acquisition Trust** | | | | |
| 6,596 % fällig am 28.12.2036 | | 713 | 730 | 0,02 |
| **BBVA Consumer Auto** | | | | |
| 0,270 % fällig am 20.07.2031 | € | 1.148 | 1.184 | 0,04 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,854 % fällig am 25.02.2037 | $ | 3.000 | 2.850 | 0,09 |
| 2,254 % fällig am 25.02.2036 | | 1.350 | 1.346 | 0,05 |
| 2,269 % fällig am 25.12.2035 | | 92 | 92 | 0,00 |
| 2,479 % fällig am 25.07.2034 | | 1.549 | 1.470 | 0,05 |
| 2,644 % fällig am 25.10.2035 | | 402 | 389 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.08.2037 | | 872 | 803 | 0,03 |
| **Benefit Street Partners CLO Ltd.** | | | | |
| 2,163 % fällig am 20.01.2031 | | 5.500 | 5.394 | 0,18 |
| **Black Diamond CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 03.10.2029 | € | 249 | 260 | 0,01 |
| 0,980 % fällig am 15.05.2032 | | 4.600 | 4.700 | 0,16 |
| **Blackrock European CLO DAC** | | | | |
| 0,620 % fällig am 15.10.2031 | | 5.400 | 5.459 | 0,18 |
| **BNPP AM Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,820 % fällig am 22.07.2032 | | 6.300 | 6.393 | 0,21 |
| **Brookside Mill CLO Ltd.** | | | | |
| 1,864 % fällig am 17.01.2028 | $ | 100 | 100 | 0,00 |
| **Cairn CLO DAC** | | | | |
| 0,600 % fällig am 30.04.2031 | € | 8.196 | 8.456 | 0,28 |
| 0,650 % fällig am 20.10.2028 | | 106 | 110 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 0,670 % fällig am 31.01.2030 | € | 631 | $ 649 | 0,02 |
| 0,790 % fällig am 25.07.2029 | | 116 | 120 | 0,00 |
| **Carbone CLO Ltd.** | | | | |
| 2,203 % fällig am 20.01.2031 | $ | 6.931 | 6.799 | 0,23 |
| **Carlyle Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 15.08.2030 | € | 2.893 | 2.965 | 0,10 |
| **Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.** | | | | |
| 2,144 % fällig am 15.10.2030 | $ | 1.691 | 1.669 | 0,06 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.11.2031 | € | 800 | 822 | 0,03 |
| **CBAM CLO Ltd.** | | | | |
| 2,313 % fällig am 20.07.2030 | $ | 2.300 | 2.275 | 0,08 |
| **Cedar Funding CLO Ltd.** | | | | |
| 2,043 % fällig am 20.04.2031 | | 1.100 | 1.075 | 0,04 |
| 2,063 % fällig am 20.01.2031 | | 5.050 | 4.946 | 0,16 |
| **CIFC Funding Ltd.** | | | | |
| 1,863 % fällig am 20.01.2028 | | 856 | 846 | 0,03 |
| 2,044 % fällig am 18.04.2031 | | 700 | 688 | 0,02 |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,124 % fällig am 25.10.2037 | | 5.500 | 5.150 | 0,17 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,684 % fällig am 25.07.2045 | | 415 | 312 | 0,01 |
| 1,774 % fällig am 25.12.2036 | | 105 | 44 | 0,00 |
| 1,794 % fällig am 25.07.2045 | | 7.731 | 5.874 | 0,19 |
| 7,250 % fällig am 25.05.2036 | | 933 | 548 | 0,02 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,569 % fällig am 25.10.2034 | | 61 | 60 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 1,884 % fällig am 25.03.2037 | | 3.230 | 2.937 | 0,10 |
| **Contego CLO BV** | | | | |
| 0,770 % fällig am 15.10.2030 | € | 1.600 | 1.637 | 0,05 |
| **Contego CLO DAC** | | | | |
| 0,640 % fällig am 23.01.2030 | | 3.996 | 4.107 | 0,14 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.06.2035 | $ | 3.559 | 3.315 | 0,11 |
| 1,804 % fällig am 25.11.2047 ^ | | 1.241 | 1.359 | 0,05 |
| 1,824 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 3.038 | 2.733 | 0,09 |
| 1,834 % fällig am 25.05.2047 ^ | | 78 | 73 | 0,00 |
| 1,844 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 428 | 439 | 0,01 |
| 2,284 % fällig am 25.08.2035 | | 416 | 409 | 0,01 |
| 2,344 % fällig am 25.05.2036 | | 3.726 | 3.674 | 0,12 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC** | | | | |
| 2,539 % fällig am 25.01.2034 | | 518 | 488 | 0,02 |
| 3,009 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 168 | 142 | 0,01 |
| **CVC Cordatus Loan Fund DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 21.07.2030 | € | 4.110 | 4.241 | 0,14 |
| 0,760 % fällig am 15.04.2032 | | 3.500 | 3.586 | 0,12 |
| 0,780 % fällig am 15.08.2032 | | 5.500 | 5.632 | 0,19 |
| **Dryden CLO Ltd.** | | | | |
| 2,421 % fällig am 15.05.2031 | $ | 2.350 | 2.310 | 0,08 |
| **Dryden Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.04.2033 | € | 4.500 | 4.564 | 0,15 |
| 0,850 % fällig am 15.07.2031 | | 596 | 616 | 0,02 |
| 0,860 % fällig am 15.05.2034 | | 11.700 | 11.834 | 0,39 |
| **Dryden Senior Loan Fund** | | | | |
| 1,944 % fällig am 15.04.2029 | $ | 5.054 | 5.004 | 0,17 |
| **Elevation CLO Ltd.** | | | | |
| 2,274 % fällig am 15.10.2029 | | 1.919 | 1.900 | 0,06 |
| **Ellington Loan Acquisition Trust** | | | | |
| 2,724 % fällig am 25.05.2037 | | 3.659 | 3.544 | 0,12 |
| **Euro-Galaxy CLO DAC** | | | | |
| 0,710 % fällig am 11.04.2031 | € | 1.200 | 1.221 | 0,04 |
| **Fieldstone Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 1,964 % fällig am 25.04.2047 | $ | 2.159 | 1.656 | 0,06 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 1,724 % fällig am 25.08.2036 | | 219 | 81 | 0,00 |
| 1,759 % fällig am 25.10.2036 | | 159 | 144 | 0,01 |
| 2,494 % fällig am 25.05.2034 | | 1.754 | 1.687 | 0,06 |
| **GE-WMC Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.08.2036 | | 5.348 | 2.624 | 0,09 |
| **Greenwood Park CLO Ltd.** | | | | |
| 2,074 % fällig am 15.04.2031 | | 1.250 | 1.225 | 0,04 |
| **Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.** | | | | |
| 2,504 % fällig am 15.09.2037 | | 5.000 | 4.932 | 0,16 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | | |
| 5,772 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 488 | 170 | 0,01 |
| 5,985 % fällig am 25.06.2036 | | 1.382 | 435 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **GSAMP Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.11.2036 | $ | 2.002 | $ 1.069 | 0,04 |
| 2,144 % fällig am 25.02.2046 | | 608 | 569 | 0,02 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,640 % fällig am 15.10.2031 | € | 9.600 | 9.804 | 0,32 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | | |
| 2,404 % fällig am 25.01.2036 | $ | 2.200 | 1.929 | 0,06 |
| **ICG U.S. CLO Ltd.** | | | | |
| 2,216 % fällig am 22.07.2031 | | 5.200 | 5.112 | 0,17 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 1,904 % fällig am 25.07.2036 | | 1 | 1 | 0,00 |
| **Jubilee CLO DAC** | | | | |
| 0,391 % fällig am 12.07.2028 | € | 688 | 720 | 0,02 |
| 0,519 % fällig am 15.12.2029 | | 2.376 | 2.457 | 0,08 |
| **KKR CLO Ltd.** | | | | |
| 2,224 % fällig am 15.01.2031 | $ | 3.800 | 3.749 | 0,12 |
| **LCM LP** | | | | |
| 2,103 % fällig am 20.10.2027 | | 396 | 394 | 0,01 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 2,586 % fällig am 25.03.2037 | | 2.199 | 2.191 | 0,07 |
| **LoanCore Issuer Ltd.** | | | | |
| 2,329 % fällig am 17.01.2037 | | 500 | 486 | 0,02 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,064 % fällig am 25.02.2036 | | 425 | 413 | 0,01 |
| 2,539 % fällig am 25.08.2035 | | 4.270 | 3.812 | 0,13 |
| **Madison Park Funding Ltd.** | | | | |
| 1,794 % fällig am 15.04.2029 | | 7.922 | 7.817 | 0,26 |
| **Magnetite Ltd.** | | | | |
| 1,844 % fällig am 15.01.2028 | | 4.725 | 4.671 | 0,16 |
| 2,024 % fällig am 15.04.2031 | | 3.700 | 3.654 | 0,12 |
| **Man GLG Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,680 % fällig am 15.10.2030 | € | 2.988 | 3.060 | 0,10 |
| 0,700 % fällig am 15.05.2031 | | 500 | 514 | 0,02 |
| 0,870 % fällig am 15.01.2030 | | 642 | 665 | 0,02 |
| **Marathon CLO Ltd.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 21.11.2027 | $ | 80 | 80 | 0,00 |
| **Midocean Credit CLO** | | | | |
| 2,164 % fällig am 19.07.2028 | | 976 | 969 | 0,03 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 1,694 % fällig am 25.10.2036 | | 1.484 | 753 | 0,03 |
| 1,754 % fällig am 25.11.2036 | | 1.720 | 843 | 0,03 |
| 1,764 % fällig am 25.05.2037 | | 1.494 | 1.322 | 0,04 |
| 1,854 % fällig am 25.10.2036 | | 1.199 | 680 | 0,02 |
| 1,854 % fällig am 25.11.2036 | | 5.481 | 3.496 | 0,12 |
| 1,874 % fällig am 25.07.2036 | | 462 | 393 | 0,01 |
| 1,924 % fällig am 25.09.2036 | | 15.547 | 6.310 | 0,21 |
| 2,124 % fällig am 25.04.2036 | | 113 | 105 | 0,00 |
| 2,164 % fällig am 25.12.2034 | | 1.362 | 1.236 | 0,04 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,134 % fällig am 25.02.2036 | | 1.800 | 1.682 | 0,06 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 6,226 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 283 | 98 | 0,00 |
| **Mountain View CLO Ltd.** | | | | |
| 1,841 % fällig am 13.10.2027 | | 536 | 534 | 0,02 |
| **Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd.** | | | | |
| 2,103 % fällig am 20.04.2031 | | 1.100 | 1.073 | 0,04 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,024 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 3.283 | 1.073 | 0,04 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.09.2037 | | 26 | 25 | 0,00 |
| 1,944 % fällig am 25.05.2036 | | 54 | 53 | 0,00 |
| **Oak Hill European Credit Partners DAC** | | | | |
| 0,730 % fällig am 20.01.2032 | € | 796 | 820 | 0,03 |
| **Octagon Investment Partners Ltd.** | | | | |
| 2,004 % fällig am 16.04.2031 | $ | 5.900 | 5.796 | 0,19 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.01.2037 | | 54 | 34 | 0,00 |
| 1,764 % fällig am 25.02.2037 | | 662 | 459 | 0,02 |
| 1,764 % fällig am 25.03.2037 | | 794 | 725 | 0,02 |
| 1,844 % fällig am 25.04.2037 | | 630 | 471 | 0,02 |
| 1,844 % fällig am 25.05.2037 | | 692 | 466 | 0,02 |
| **OZLM Ltd.** | | | | |
| 2,064 % fällig am 15.04.2031 | | 2.400 | 2.348 | 0,08 |
| 2,124 % fällig am 17.04.2031 | | 985 | 964 | 0,03 |
| 2,213 % fällig am 20.01.2031 | | 1.800 | 1.766 | 0,06 |
| **OZLME DAC** | | | | |
| 0,820 % fällig am 27.07.2032 | € | 2.200 | 2.240 | 0,07 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.10.2031 | | 10.000 | 10.241 | 0,34 |
| **Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 1,954 % fällig am 25.07.2036 | $ | 768 | $ 738 | 0,02 |
| **RAAC Trust** | | | | |
| 2,384 % fällig am 25.10.2046 | | 107 | 101 | 0,00 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 1,964 % fällig am 25.11.2036 | | 51 | 48 | 0,00 |
| 2,209 % fällig am 25.03.2036 | | 1.401 | 1.379 | 0,05 |
| **Sculptor European CLO DAC** | | | | |
| 0,790 % fällig am 14.01.2032 | € | 5.000 | 5.047 | 0,17 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.10.2036 | $ | 10.059 | 3.827 | 0,13 |
| 2,284 % fällig am 25.08.2035 | | 59 | 45 | 0,00 |
| **Segovia European CLO DAC** | | | | |
| 0,880 % fällig am 20.07.2032 | € | 4.200 | 4.268 | 0,14 |
| **SG Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 1,834 % fällig am 25.10.2036 | $ | 3.600 | 2.773 | 0,09 |
| **Sierra Madre Funding Ltd.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 07.09.2039 | | 2.353 | 1.805 | 0,06 |
| **Sound Point CLO Ltd.** | | | | |
| 2,194 % fällig am 18.04.2031 | | 7.400 | 7.293 | 0,24 |
| 2,314 % fällig am 26.07.2031 | | 1.000 | 978 | 0,03 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 1,824 % fällig am 25.06.2037 | | 2.394 | 1.771 | 0,06 |
| 1,884 % fällig am 25.02.2037 | | 1.043 | 324 | 0,01 |
| 2,124 % fällig am 25.10.2036 | | 1.604 | 1.541 | 0,05 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 2,599 % fällig am 25.01.2035 | | 1.685 | 1.576 | 0,05 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,779 % fällig am 25.09.2036 | | 5.088 | 3.669 | 0,12 |
| 2,562 % fällig am 25.04.2035 | | 44 | 43 | 0,00 |
| **TIAA CLO Ltd.** | | | | |
| 2,263 % fällig am 20.07.2031 | | 6.500 | 6.381 | 0,21 |
| **TICP CLO Ltd.** | | | | |
| 1,903 % fällig am 20.04.2028 | | 1.274 | 1.260 | 0,04 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | |
| 0,810 % fällig am 15.02.2034 | € | 7.800 | 7.881 | 0,26 |
| 0,920 % fällig am 15.07.2030 | | 404 | 417 | 0,01 |
| **Voya CLO Ltd.** | | | | |
| 2,138 % fällig am 14.07.2031 | $ | 3.865 | 3.784 | 0,13 |
| 2,254 % fällig am 15.10.2030 | | 6.473 | 6.393 | 0,21 |
| **WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust** | | | | |
| 1,849 % fällig am 25.05.2037 | | 528 | 493 | 0,02 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.04.2037 | | 4.701 | 3.465 | 0,12 |
| 3,349 % fällig am 25.11.2035 | | 100 | 100 | 0,00 |
| **Wind River CLO Ltd.** | | | | |
| 2,184 % fällig am 15.01.2031 | | 4.300 | 4.227 | 0,14 |
| | | | 379.755 | 12,57 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 09.07.2030 | | 1.422 | 313 | 0,01 |
| 1,000 % fällig am 09.07.2029 | | 150 | 35 | 0,00 |
| 1,125 % fällig am 09.07.2035 | | 2.504 | 530 | 0,02 |
| **Emirate of Abu Dhabi Government International Bond** | | | | |
| 2,500 % fällig am 11.10.2022 | | 700 | 700 | 0,02 |
| **Israel Government International Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 03.07.2030 | | 1.900 | 1.764 | 0,06 |
| 3,800 % fällig am 13.05.2060 | | 4.100 | 3.427 | 0,11 |
| **Japan Finance Organization for Municipalities** | | | | |
| 0,050 % fällig am 12.02.2027 | € | 1.500 | 1.443 | 0,05 |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | PEN | 54.432 | 13.093 | 0,43 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 11.700 | 2.724 | 0,09 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 | | 32.446 | 8.053 | 0,27 |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 3,875 % fällig am 23.04.2023 | $ | 1.000 | 1.005 | 0,03 |
| **Romania Government International Bond** | | | | |
| 1,750 % fällig am 13.07.2030 | € | 3.000 | 2.242 | 0,08 |
| **Russia Government International Bond** | | | | |
| 5,100 % fällig am 28.03.2035 ^ | $ | 400 | 106 | 0,00 |
| **Saudi Arabia Government International Bond** | | | | |
| 2,875 % fällig am 04.03.2023 | | 600 | 599 | 0,02 |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 4,850 % fällig am 30.09.2029 | | 4.500 | 3.855 | 0,13 |
| **Turkey Government International Bond** | | | | |
| 5,750 % fällig am 22.03.2024 | | 1.000 | 932 | 0,03 |
| 6,350 % fällig am 10.08.2024 | $ | 4.500 | $ 4.171 | 0,14 |
| | | | 44.992 | 1,49 |

| | | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|---|
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **ENERGIE** | | | | |
| **Constellation Oil Services Holding S,A, (b)(j)** | | 617.385 | 67 | 0,00 |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | | |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 10,250 % | | 2.850 | 507 | 0,02 |

| | | PARI (000S) | | |
|---|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | | |
| **Constellation Brands, Inc.** | | | | |
| 2,437 % fällig am 15.07.2022 | $ | 2.000 | 1.998 | 0,07 |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | | |
| 51,049 % fällig am 30.09.2022 (c)(d) | ARS | 171.100 | 573 | 0,02 |
| **JAPAN TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,126) % fällig am 19.07.2022 (c)(d) | ¥ | 15.000.000 | 110.420 | 3,65 |
| (0,098) % fällig am 11.07.2022 (c)(d) | | 12.323.000 | 90.711 | 3,00 |
| (0,094) % fällig am 12.09.2022 (c)(d) | | 13.120.000 | 96.603 | 3,20 |
| | | | 297.734 | 9,85 |
| **U.S. TREASURY BILLS** | | | | |
| 0,874 % fällig am 21.07.2022 (c)(d) | $ | 66.600 | 66.563 | 2,20 |
| 0,904 % fällig am 28.07.2022 (c)(d) | | 101.500 | 101.418 | 3,36 |
| 1,089 % fällig am 23.08.2022 (c)(d)(l) | | 13.500 | 13.471 | 0,45 |
| 1,310 % fällig am 11.08.2022 (c)(d) | | 11.000 | 10.984 | 0,36 |
| | | | 192.436 | 6,37 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 492.741 | 16,31 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **$ 2.538.264** | **84,01** |

| | | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (g)** | | 1.197.507 | 10.167 | 0,34 |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (g)** | | 385.356 | 3.291 | 0,11 |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)** | | 22.665.669 | 225.478 | 7,46 |
| | | | 238.936 | 7,91 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g)** | | 614.500 | 60.803 | 2,01 |
| **Summe Investmentfonds** | | | **$299.739** | **9,92** |

**PENSIONSGESCHÄFTE**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 1,540 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 169.600 | U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2043 | $ (174.970 ) | $ 169.600 | $ 169.607 | 5,62 |
| FICC | 0,400 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 5.860 | U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | (5.977 ) | 5.860 | 5.860 | 0,19 |
| NOM | 1,480 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 87.300 | U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.08.2048 | (89.939 ) | 87.300 | 87.304 | 2,89 |
| | 1,480 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 21.500 | U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.11.2025 | (21.988 ) | 21.500 | 21.501 | 0,71 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (292.874 )** | **$ 284.260** | **$ 284.272** | **9,41** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09.2022 | 39 | $ 61 | 0,00 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Long | 09.2022 | 820 | (2.975) | (0,10) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 123 | 437 | 0,02 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 16 | (227) | (0,01) |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 6.845 | (7.253) | (0,24) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 2.875 | (2.497) | (0,08) |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2022 | 446 | 407 | 0,01 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2022 | 979 | 3.788 | 0,13 |
| | | | | $ (8.259) | (0,27) |

**VERKAUFSOPTIONEN**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CME Kaufoptionen mit Ausübungskurs von @ EUR 98,000 auf 3-Month SOFR December Futures | $ 98,000 | 15.12.2023 | 133 | $ (103) | $ (107) | 0,00 |
| Call - CME Verkaufoptionen mit Ausübungskurs von @ EUR 96,500 auf 3-Month SOFR December Futures | 96,500 | 15.12.2023 | 133 | (130) | (165) | (0,01) |
| | | | | $ (233) | $ (272) | (0,01) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ (8.531)** | **(0,28)** |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 3.200 | $ 11 | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.06.2026 | 1.900 | (39) | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.12.2024 | € 4.000 | 11 | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.06.2027 | $ 500 | (12) | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2026 | 1.700 | (41) | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.06.2024 | € 2.500 | (80) | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.12.2024 | 700 | (37) | 0,00 |
| Stellantis NV | 5,000 | 20.12.2026 | 1.300 | (139) | (0,01) |
| | | | | $ (326) | (0,01) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[2]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-34 5-Year Index | (5,000) % | 20.06.2025 | $ 20.930 | $ (1.207) | (0,04) |
| iTraxx Europe Main 32 5-Year Index | (1,000) | 20.12.2024 | € 200 | 5 | 0,00 |
| | | | | $ (1.202) | (0,04) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-35 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2026 | $ 100 | $ (9) | 0,00 |
| CDX.EM-36 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 17.400 | (1.441) | (0,05) |
| CDX.EM-37 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 9.700 | (446) | (0,01) |
| CDX.HY-37 5-Year Index | 5,000 | 20.12.2026 | 396 | (36) | 0,00 |
| CDX.HY-38 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2027 | 14.157 | (859) | (0,03) |
| CDX.IG-38 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 1.800 | (10) | 0,00 |
| iTraxx Crossover 37 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2027 | € 12.400 | (568) | (0,02) |
| | | | | $ (3.369) | (0,11) |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 % | 07.02.2023 | £ 59.100 | $ (793) | (0,03) |
| Erhalt[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 | 21.09.2027 | 81.800 | 2.814 | 0,09 |
| Zahlung[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2032 | 59.800 | (4.684) | (0,15) |
| Erhalt[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2052 | 39.600 | 6.869 | 0,23 |
| Erhalt[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 21.12.2052 | $ 49.700 | (1.437) | (0,05) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,853 | 18.05.2032 | 49.800 | (3.570) | (0,12) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,206 | 04.01.2027 | BRL 20.600 | (250) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,055 | 04.01.2027 | 18.600 | (137) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,065 | 04.01.2027 | 250.900 | (1.829) | (0,06) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,086 | 04.01.2027 | 114.100 | (841) | (0,03) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,098 | 04.01.2027 | 132.600 | (970) | (0,03) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,115 | 04.01.2027 | 114.000 | (140) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,814 | 04.01.2027 | 154.300 | (546) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,868 | 04.01.2027 | 137.400 | (450) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,000 | 16.06.2026 | CAD 108.800 | (5.917) | (0,20) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,220 | 03.03.2025 | 4.900 | (222) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,235 | 04.03.2025 | 7.200 | (333) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,275 | 03.03.2025 | 4.500 | (198) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,276 | 03.03.2025 | 2.700 | (119) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,290 | 03.03.2025 | 1.300 | (57) | 0,00 |
| Zahlung[4] | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,000 | 14.11.2023 | 44.700 | (569) | (0,02) |
| Zahlung[4] | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,060 | 28.10.2023 | 319.800 | (3.941) | (0,13) |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,750 | 15.12.2026 | KRW 135.049.300 | (7.371) | (0,24) |
| Erhalt | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,750 | 15.12.2031 | 69.068.100 | 6.288 | 0,21 |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 2,000 | 15.12.2026 | 79.676.500 | (4.135) | (0,14) |
| Erhalt | 3-Month KRW-KORIBOR | 2,000 | 15.12.2031 | 42.012.300 | 3.615 | 0,12 |
| Zahlung[4] | 3-Month NZD-BBR | 3,000 | 01.11.2023 | NZD 120.200 | (945) | (0,03) |
| Zahlung[4] | 3-Month NZD-BBR | 3,000 | 15.12.2023 | 139.900 | (1.085) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,500 | 16.06.2026 | $ 83.700 | (5.945) | (0,20) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 17.06.2030 | 5.000 | 504 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 18.12.2029 | 1.210 | 82 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 10.12.2029 | 5.100 | 364 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 12.02.2030 | 9.900 | 827 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 10.03.2030 | 4.900 | 332 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 20.06.2028 | 14.860 | (317) | (0,01) |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2027 | € 19.560 | 943 | 0,03 |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | 9.000 | 881 | 0,03 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,660 | 24.03.2023 | MXN 345.970 | (457) | (0,01) |
| Zahlung | UKRPI | 3,579 | 15.10.2033 | £ 4.900 | (556) | (0,02) |
| Zahlung | UKRPI | 3,596 | 15.05.2034 | 6.500 | (821) | (0,03) |
| | | | | | $ (25.116) | (0,83) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (30.013)** | **(0,99)** |

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

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

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

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

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

### OPTIONSKAUF

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Kosten | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,023 % | 29.06.2023 | 14.900 | $ 793 | $ 2.191 | 0,07 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,021 | 25.10.2023 | 6.200 | 354 | 1.136 | 0,04 |
| CBK | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,073 | 07.07.2022 | 5.300 | 53 | 2 | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,121 | 07.07.2022 | 5.300 | 55 | 1 | 0,00 |
| FAR | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,021 | 15.09.2023 | 10.500 | 551 | 1.807 | 0,06 |
| GLM | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,128 | 07.07.2022 | 5.300 | 55 | 1 | 0,00 |
| MYC | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,021 | 15.09.2023 | 11.000 | 598 | 1.936 | 0,06 |
| | | | | | | | $ 2.459 | $ 7.074 | 0,23 |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 % | 20.07.2022 | 28.400 | $ (43) | $ (21) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 19.100 | (54) | (63) | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 7.400 | (13) | (3) | 0,00 |
| BRC | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 9.400 | (86) | (105) | (0,01) |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 18.600 | (84) | (40) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,600 | 17.08.2022 | 1.600 | (4) | (3) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 5.900 | (9) | (4) | 0,00 |
| GST | Call - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Kauf | 0,700 | 17.08.2022 | 5.400 | (6) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,300 | 17.08.2022 | 13.200 | (30) | (21) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,350 | 17.08.2022 | 12.100 | (28) | (16) | 0,00 |
| | | | | | | $ (357) | $ (277) | (0,01) |

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 0,021 % | 29.06.2023 | 73.000 | $ (793) | $ (3.467) | (0,12) |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 0,020 | 25.10.2023 | 31.000 | (355) | (1.602) | (0,05) |
| BPS | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 31.03.2023 | 160.800 | (268) | (91) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 31.03.2023 | 160.800 | (354) | (587) | (0,02) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 28.04.2023 | 11.300 | (20) | (9) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 28.04.2023 | 11.300 | (20) | (39) | 0,00 |
| FAR | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 0,020 | 15.09.2023 | 52.500 | (551) | (2.743) | (0,09) |
| GLM | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,870 | 02.11.2022 | 338.700 | (673) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,270 | 02.11.2022 | 338.700 | (673) | (7.762) | (0,26) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,018 | 20.10.2023 | 4.600 | (30) | (35) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,018 | 20.10.2023 | 4.600 | (30) | (24) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,140 | 23.10.2023 | 4.600 | (32) | (38) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,140 | 23.10.2023 | 4.600 | (32) | (22) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,190 | 23.10.2023 | 4.600 | (32) | (39) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,190 | 23.10.2023 | 4.600 | (32) | (21) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,225 | 23.10.2023 | 4.600 | (32) | (40) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,225 | 23.10.2023 | 4.600 | (32) | (21) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,973 | 25.10.2023 | 4.600 | (32) | (34) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,973 | 25.10.2023 | 4.600 | (32) | (25) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,841 | 27.10.2023 | 4.700 | (32) | (31) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,841 | 27.10.2023 | 4.700 | (32) | (28) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 17.11.2023 | 24.600 | (89) | (103) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 17.11.2023 | 24.600 | (89) | (75) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,150 | 20.11.2023 | 36.100 | (126) | (138) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,650 | 20.11.2023 | 36.100 | (126) | (119) | (0,01) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 07.12.2023 | 13.300 | (41) | (58) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 07.12.2023 | 13.300 | (42) | (41) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,500 | 07.02.2023 | 493.200 | (1.702) | (6.367) | (0,21) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 26.04.2023 | 11.000 | (19) | (9) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 26.04.2023 | 11.000 | (19) | (37) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 0,020 | 15.09.2023 | 55.000 | (598) | (2.909) | (0,10) |
| | | | | | | | $ (6.938) | $ (26.518) | (0,88) |

#### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SAL | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | $ 94,688 | 07.09.2022 | 10.000 | $ (60) | $ (52) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 99,281 | 07.07.2022 | 9.100 | (41) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 99,305 | 07.07.2022 | 9.100 | (41) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 99,344 | 07.07.2022 | 9.100 | (40) | (3) | 0,00 |
| | | | | | $ (182) | $ (59) | 0,00 |

[1] Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]**

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | UBS AG | (1,000) % | 20.06.2024 | $ 200 | $ 13 | $ (13) | $ 0 | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2022 | $ 200 | $ (1) | $ 2 | $ 1 | 0,00 |
| BRC | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 200 | (26) | (2) | (28) | 0,00 |
| CBK | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 100 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| GLM | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.12.2023 | 1.200 | (88) | 76 | (12) | 0,00 |
| GST | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 200 | (3) | (1) | (4) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 200 | (3) | 2 | (1) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 2.300 | (102) | 57 | (45) | (0,01) |
| HUS | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 400 | (12) | 9 | (3) | 0,00 |
| MYC | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 500 | (16) | 18 | 2 | 0,00 |
| | | | | | $ (251) | $ 159 | $ (92) | (0,01) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 % | 17.11.2059 | $ 2.200 | $ (9) | $ 1 | $ (8) | 0,00 |
| MYC | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 100 | (4) | 4 | 0 | 0,00 |
| SAL | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 1.500 | (3) | (3) | (6) | 0,00 |
| UAG | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 300 | (9) | 8 | (1) | 0,00 |
| | | | | | $ (25) | $ 10 | $ (15) | 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 | Nenn-betrag | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Receive | 6-Month THB-THBFIX | 1,000 % | 15.12.2026 | THB 1.401.800 | $ 385 | $ 2.259 | $ 2.644 | 0,09 |
| | Pay | 6-Month THB-THBFIX | 1,500 | 15.12.2031 | 714.100 | (481) | (1.810) | (2.291) | (0,08) |
| CBK | Receive | 6-Month THB-THBFIX | 1,000 | 15.12.2026 | 3.877.400 | 506 | 6.805 | 7.311 | 0,24 |
| | Pay | 6-Month THB-THBFIX | 1,500 | 15.12.2031 | 2.001.900 | (832) | (5.588) | (6.420) | (0,21) |
| GLM | Pay | 6-Month THB-THBFIX | 1,500 | 15.12.2031 | 15.800 | (11) | (43) | (54) | 0,00 |
| SCX | Receive | 6-Month THB-THBFIX | 1,000 | 15.12.2026 | 760.100 | 323 | 1.200 | 1.523 | 0,05 |
| | Pay | 6-Month THB-THBFIX | 1,500 | 15.12.2031 | 370.800 | (336) | (925) | (1.261) | (0,04) |
| | | | | | | $ (446) | $ 1.898 | $ 1.452 | 0,05 |

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | £ 147.227 | $ 186.152 | $ 7.352 | $ 0 | $ 7.352 | 0,24 |
| | 07.2022 | ¥ 3.015 | 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | PEN 43.718 | 11.085 | 24 | (421) | (397) | (0,01) |
| | 07.2022 | $ 5.650 | £ 4.534 | 0 | (143) | (143) | (0,01) |
| | 07.2022 | 1.250 | ZAR 19.178 | 0 | (80) | (80) | 0,00 |
| | 08.2022 | MXN 12.258 | $ 604 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN 8.175 | 2.075 | 0 | (69) | (69) | 0,00 |
| | 09.2022 | 12.459 | 3.225 | 0 | (32) | (32) | 0,00 |
| | 11.2022 | $ 925 | ZAR 14.689 | 0 | (40) | (40) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | BRL 160.720 | $ 31.171 | 438 | 0 | 438 | 0,01 |
| | 07.2022 | CAD 1.481 | 1.176 | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| | 07.2022 | € 3.004 | 3.145 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN 20.290 | 970 | 0 | (36) | (36) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 8.820 | CAD 11.411 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07.2022 | $ | 493.912 | € | 469.540 | $ 0 | $ (3.032) | $ (3.032) | (0,10) |
| | 07.2022 | | 5.218 | £ | 4.214 | 0 | (100) | (100) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.010 | MXN | 20.290 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08.2022 | COP | 863.751 | $ | 209 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 462.840 | | 487.703 | 2.932 | 0 | 2.932 | 0,10 |
| | 08.2022 | $ | 30.926 | BRL | 160.720 | 0 | (458) | (458) | (0,02) |
| | 08.2022 | | 3.912 | ZAR | 62.457 | 0 | (116) | (116) | 0,00 |
| | 09.2022 | ¥ | 6.019.000 | $ | 45.049 | 537 | 0 | 537 | 0,02 |
| | 09.2022 | MXN | 20.290 | | 995 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 09.2022 | TWD | 1.361 | | 49 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 11.2022 | $ | 2.060 | ZAR | 33.029 | 0 | (69) | (69) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | ¥ | 12.323.000 | $ | 101.160 | 10.424 | 0 | 10.424 | 0,34 |
| | 09.2022 | | 7.101.000 | | 53.144 | 630 | 0 | 630 | 0,02 |
| | 11.2022 | $ | 3.499 | ZAR | 52.185 | 0 | (353) | (353) | (0,01) |
| | 02.2023 | | 204 | | 3.378 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | ILS | 41 | $ | 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | PEN | 20.232 | | 5.115 | 0 | (203) | (203) | (0,01) |
| | 07.2022 | $ | 2.553 | € | 2.378 | 0 | (67) | (67) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 2.141 | PEN | 8.252 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| | 08.2022 | NZD | 869 | $ | 543 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN | 3.202 | | 846 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 11.2022 | | 8.142 | | 2.051 | 0 | (65) | (65) | 0,00 |
| | 12.2022 | | 22.918 | | 5.708 | 0 | (231) | (231) | (0,01) |
| | 04.2023 | | 8.252 | | 2.089 | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | $ | 32.349 | BRL | 160.720 | 0 | (1.615) | (1.615) | (0,05) |
| | 07.2022 | | 8 | PLN | 37 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN | 7.739 | $ | 2.063 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 2.868 | COP | 10.934.450 | 0 | (262) | (262) | (0,01) |
| | 11.2022 | | 969 | ZAR | 15.555 | 0 | (32) | (32) | 0,00 |
| | 05.2023 | | 354 | | 5.921 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| HUS | 07.2022 | AUD | 11.633 | $ | 8.012 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 07.2022 | CAD | 2.521 | | 1.997 | 42 | 0 | 42 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 490.599 | | 529.060 | 16.164 | 0 | 16.164 | 0,53 |
| | 07.2022 | ¥ | 15.000.000 | | 121.642 | 11.141 | 0 | 11.141 | 0,37 |
| | 07.2022 | $ | 22.581 | € | 21.685 | 100 | (11) | 89 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 8.013 | AUD | 11.633 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 5.133 | CLP | 4.301.236 | 0 | (574) | (574) | (0,02) |
| | 08.2022 | | 933 | CNH | 6.264 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 05.2023 | | 653 | | 4.383 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| IND | 08.2022 | | 1.627 | CLP | 1.423.513 | 0 | (118) | (118) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | £ | 87 | $ | 106 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 14 | € | 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.999 | £ | 1.649 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 497 | $ | 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 655 | | 23 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| RBC | 07.2022 | CAD | 3.933 | | 3.090 | 41 | 0 | 41 | 0,00 |
| | 09.2022 | MXN | 13.228 | | 643 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| RYL | 07.2022 | $ | 1.530 | £ | 1.258 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | CAD | 1.770 | $ | 1.370 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.221 | £ | 1.010 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 36.726 | ¥ | 4.718.497 | 0 | (1.994) | (1.994) | (0,07) |
| | 07.2022 | | 514 | PEN | 1.942 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 643 | $ | 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 1.153 | CNH | 7.721 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 1.560 | ZAR | 24.124 | 0 | (98) | (98) | 0,00 |
| | 11.2022 | PEN | 2.097 | $ | 506 | 0 | (38) | (38) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | $ | 8.310 | AUD | 11.633 | 0 | (310) | (310) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 1.299 | € | 1.235 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 08.2022 | CLP | 5.695.075 | $ | 6.514 | 492 | 0 | 492 | 0,02 |
| | 08.2022 | NZD | 4.193 | | 2.692 | 86 | 0 | 86 | 0,00 |
| | 09.2022 | MXN | 28.384 | | 1.424 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| | 11.2022 | $ | 2.591 | ZAR | 40.914 | 0 | (125) | (125) | 0,00 |
| | | | | | | $ 50.601 | $ (10.765 ) | $ 39.836 | 1,32 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | € | 190 | $ | 202 | $ 3 | $ 0 | $ 3 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | | 24.233 | | 25.492 | 158 | 0 | 158 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 3.946 | € | 3.687 | 0 | (91) | (91) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 23.843 | | 22.627 | 0 | (143) | (143) | (0,01) |
| CBK | 07.2022 | € | 447 | $ | 477 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 599 | € | 558 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| HUS | 07.2022 | € | 22.922 | $ | 24.114 | 151 | 0 | 151 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 25.257 | € | 23.434 | 0 | (758) | (758) | (0,03) |
| | 08.2022 | | 23.847 | | 22.627 | 0 | (148) | (148) | (0,01) |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SCX | 07.2022 | $ 17.757 | € 16.577 | $ 0 | $ (427) | $ (427) | (0,01) |
| UAG | 07.2022 | 24.659 | 22.948 | 0 | (669) | (669) | (0,02) |
| | | | | $ 322 | $ (2.252) | $ (1.930) | (0,06) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | £ 51.939 | $ 64.036 | $ 958 | $ 0 | $ 958 | 0,03 |
| | 07.2022 | $ 997.065 | £ 788.576 | 0 | (39.379) | (39.379) | (1,30) |
| BPS | 07.2022 | £ 23.277 | $ 28.182 | 6 | (92) | (86) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 15.145 | £ 12.025 | 0 | (541) | (541) | (0,02) |
| BRC | 07.2022 | £ 14.102 | $ 17.336 | 209 | 0 | 209 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ 1.005.399 | £ 797.585 | 0 | (36.772) | (36.772) | (1,22) |
| CBK | 07.2022 | 52 | 41 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| HUS | 07.2022 | £ 50.882 | $ 62.529 | 735 | 0 | 735 | 0,02 |
| MYI | 07.2022 | 26.001 | 31.410 | 0 | (167) | (167) | (0,01) |
| SCX | 07.2022 | 3 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | $ 991.506 | £ 786.460 | 0 | (36.389) | (36.389) | (1,20) |
| | | | | $ 1.908 | $ (113.342) | $ (111.434) | (3,69) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **$ (91.963)** | **(3,05)** |

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.07.2052 (i) | $ 98.500 | $ (85.510) | (2,83) |
| 2,000 % fällig am 01.08.2052 | 99.000 | (85.852) | (2,84) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (171.362)** | **(5,67)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 2.820.394** | **93,35** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ 200.927** | **6,65** |
| **Nettovermögen** | | **$ 3.021.321** | **100,00** |

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

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

**^** **Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a)** **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

**(b)** **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

**(c)** **Nullkuponwertpapier.**

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

**(e)** **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)** **Zum 30. Juni 2022 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.**

**(j)** **Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|
| Citigroup. Inc, 3,290 % fällig am 17.03.2026 | 10.03.2022 | $ 3.700 | $ 3.582 | 0,12 |
| Citigroup. Inc, 3,785 % fällig am 17.03.2033 | 10.03.2022 | 6.500 | 5.862 | 0,19 |
| Constellation Oil Services Holding S.A. | 10.06.2022 | 67 | 67 | 0,00 |
| Deutsche Bank AG 3,729 % fällig am 14.01.2032 | 11.01.2021 - 24.02.2021 | 2.202 | 1.656 | 0,05 |
| | | $ 12.469 | $ 11.167 | 0,36 |

**(k)** **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurde zum 30. Juni 2022 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von USD 713 als Sicherheiten verpfändet.**

**(l)** **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 144 und Barmittel in Höhe von USD 120.649 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von USD 44.269 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 2.537.794 | $ 470 | $ 2.538.264 |
| Investmentfonds | 238.936 | 60.803 | 0 | 299.739 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 284.260 | 0 | 284.260 |
| Finanzderivate[3] | (2.704) | (127.803) | 0 | (130.507) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (171.362) | 0 | (171.362) |
| **Summen** | **$ 236.232** | **$ 2.583.692** | **$ 470** | **$ 2.820.394** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 2.782.550 | $ 4.246 | $ 2.786.796 |
| Investmentfonds | 312.142 | 0 | 0 | 312.142 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 72.663 | 0 | 72.663 |
| Finanzderivate[3] | (1.587) | 23.278 | 0 | 21.691 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (253.414) | 0 | (253.414) |
| **Summen** | **$ 310.555** | **$ 2.625.077** | **$ 4.246** | **$ 2.939.878** |

(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 2022:**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | (2,000) % | 20.05.2022 | TBD[1] | € (824) | $ (859) | (0,03) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (859)** | **(0,03)** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (33.299) | $ 34.240 | $ 941 |
| BPS | (1.273) | 1.270 | (3) |
| BRC | (26.040) | 23.260 | (2.780) |
| CBK | 323 | (650) | (327) |
| FAR | (936) | 1.260 | 324 |
| GLM | (17.015) | 18.457 | 1.442 |
| GST | (80) | 22 | (58) |
| HUS | 26.842 | 0 | 26.842 |
| IND | (118) | 0 | (118) |
| MBC | 0 | (26.502) | (26.502) |
| MYC | (987) | 1.350 | 363 |
| MYI | (161) | 130 | (31) |
| RBC | 36 | 0 | 36 |
| RYL | (2) | 0 | (2) |
| SAL | (65) | 94 | 29 |
| SCX | (2.298) | 2.180 | (118) |
| TOR | (36.389) | 38.070 | 1.681 |
| UAG | (501) | 460 | (41) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 41,31 | 44,94 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 39,62 | 39,48 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 3,08 | 2,20 |
| Investmentfonds | 9,92 | 9,70 |
| Pensionsgeschäfte | 9,41 | 2,26 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,28) | (0,09) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,99) | (0,58) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (3,04) | 1,34 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (5,67) | (7,87) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (0,03) | (0,03) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 1,45 | 1,55 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 29,64 | 27,44 |
| Kommunalanleihen und Wechsel | 0,26 | 0,23 |
| US-Regierungsbehörden | 6,96 | 1,40 |
| US-Schatzobligationen | 10,89 | 14,78 |
| Non-Agency-MBS | 4,42 | 4,45 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 12,57 | 8,35 |
| Staatsemissionen | 1,49 | 2,74 |
| Stammaktien | 0,00 | k. A. |
| Vorzugswertpapiere | 0,02 | 0,02 |
| Kurzfristige Instrumente | 16,31 | 25,66 |
| Investmentfonds | 9,92 | 9,70 |
| Pensionsgeschäfte | 9,41 | 2,26 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,27) | (0,09) |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | (0,01) | k. A. |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,01) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | (0,04) | (0,09) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,11) | 0,01 |
| Zinsswaps | (0,83) | (0,50) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoptionen | 0,23 | 0,06 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,01) | 0,00 |
| Zinsswapoptionen | (0,88) | (0,13) |
| Optionen auf Wertpapiere | 0,00 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf | 0,00 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,01) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | 0,00 | 0,00 |
| Zinsswaps | 0,05 | 0,01 |
| Devisenterminkontrakte | 1,32 | (0,25) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (3,75) | 1,65 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (5,67) | (7,87) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 6,65 | 8,62 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | |
| **KANADA** | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| Enbridge, Inc. | 110.200 | $ 4.644 | 3,84 |
| Pembina Pipeline Corp. | 128.600 | 4.536 | 3,75 |
| TC Energy Corp. | 68.520 | 3.542 | 2,92 |
| Summe Kanada | | 12.722 | 10,51 |
| **USA** | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **ENERGIE** | | | |
| Antero Resources Corp. (a) | 44.600 | 1.367 | 1,13 |
| Cheniere Energy, Inc. | 50.333 | 6.697 | 5,53 |
| Chesapeake Energy Corp. | 58.200 | 4.720 | 3,90 |
| Diamondback Energy, Inc. | 21.100 | 2.556 | 2,11 |
| DTE Midstream LLC | 84.900 | 4.162 | 3,44 |
| EnLink Midstream LLC | 292.900 | 2.490 | 2,06 |
| EOG Resources, Inc. | 26.800 | $ 2.960 | 2,44 |
| EQT Corp. | 67.200 | 2.312 | 1,91 |
| Equitrans Midstream Corp. | 492.882 | 3.135 | 2,59 |
| Occidental Petroleum Corp. | 18.100 | 1.066 | 0,88 |
| ONEOK, Inc. | 50.830 | 2.821 | 2,33 |
| Ovintiv, Inc. | 41.400 | 1.829 | 1,51 |
| Pioneer Natural Resources Co. | 15.000 | 3.346 | 2,76 |
| Range Resources Corp. (a) | 58.800 | 1.455 | 1,20 |
| Southwestern Energy Co. (a) | 224.400 | 1.402 | 1,16 |
| Targa Resources Corp. | 100.100 | 5.973 | 4,93 |
| Williams Cos., Inc. | 206.000 | 6.429 | 5,31 |
| Total United States | | 54.720 | 45,19 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **U.S. TREASURY BILLS** | | | |
| 0,685 % fällig am 19.07.2022 (b)(c) | $ 4.100 | 4.098 | 3,38 |
| 0,704 % fällig am 26.07.2022 (b)(c) | 7.100 | 7.095 | 5,86 |
| 0,797 % fällig am 14.07.2022 (b)(c) | 1.200 | $1.199 | 0,99 |
| 0,885 % fällig am 26.07.2022 (b)(c) | 1.700 | 1.699 | 1,40 |
| 0,904 % fällig am 28.07.2022 (b)(c) | 16.600 | 16.587 | 13,70 |
| 1,120 % fällig am 01.09.2022 (b)(c) | 5.500 | 5.485 | 4,53 |
| 1,656 % fällig am 15.09.2022 (b)(c) | 2.400 | 2.392 | 1,98 |
| 2,103 % fällig am 25.10.2022 (b)(c) | 1.600 | 1.590 | 1,31 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 40.145 | 33,15 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | **$ 107.587** | **88,85** |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d) | 1.230.139 | 12.237 | 10,11 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$ 12.237** | **10,11** |

**PENSIONSGESCHÄFTE**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SSB | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 1.991 | U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026 | $ (2.031) | $ 1.991 | $ 1.991 | 1,64 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (2.031)** | **$ 1.991** | **$ 1.991** | **1,64** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## 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 WERTPAPIERE**

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nenn-betrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Erhalt | Enterprise Products Partners LP | 24.300 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 666 | 12.10.2022 | $ 0 | $ (75) | $ (75) | (0,06) |
| | Erhalt | Genesis Energy LP | 189.800 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 2.323 | 16.11.2022 | 0 | (804) | (804) | (0,66) |
| | Erhalt | MPLX LP | 258.500 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 8.518 | 16.11.2022 | 0 | (989) | (989) | (0,82) |
| | Erhalt | Plains All American Pipeline LP | 287.356 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 3.273 | 16.11.2022 | 0 | (455) | (455) | (0,38) |
| | Erhalt | Energy Transfer LP | 402.969 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 4.699 | 18.01.2023 | 0 | (683) | (683) | (0,56) |
| | Erhalt | Enterprise Products Partners LP | 302.970 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 8.307 | 18.01.2023 | 0 | (911) | (911) | (0,75) |
| | Erhalt | Western Midstream Partners LP | 122.261 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 3.381 | 18.01.2023 | 0 | (412) | (412) | (0,34) |
| | Erhalt | Energy Transfer LP | 343.320 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 3.495 | 12.04.2023 | 0 | (74) | (74) | (0,06) |
| | Erhalt | Equitrans Midstream Corp. | 118.899 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 936 | 17.05.2023 | 0 | (181) | (181) | (0,15) |
| CBK | Erhalt | DCP Midstream LP | 166.200 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 5.968 | 15.02.2023 | 0 | (1.058) | (1.058) | (0,87) |
| | Erhalt | Energy Transfer LP | 157.884 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.841 | 12.04.2023 | 0 | (267) | (267) | (0,22) |
| FAR | Erhalt | DCP Midstream LP | 15.900 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 471 | 28.06.2023 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MYI | Erhalt | Sunoco LP | 89.100 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 3.674 | 16.11.2022 | 0 | (360) | (360) | (0,30) |
| | Erhalt | Western Midstream Partners LP | 68.832 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.903 | 16.11.2022 | 0 | (232) | (232) | (0,19) |
| | Erhalt | Plains All American Pipeline LP | 426.400 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 4.857 | 18.01.2023 | 0 | (675) | (675) | (0,56) |
| | Erhalt | Enterprise Products Partners LP | 57.800 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.420 | 12.04.2023 | 0 | (13) | (13) | (0,01) |
| | Erhalt | Western Midstream Partners LP | 148.289 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 3.556 | 12.04.2023 | 0 | 43 | 43 | 0,03 |
| | | | | | | | $ 0 | $ (7.147) | $ (7.147) | (5,90) |

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | $ | 1.417 | CAD | 1.833 | $ 4 | $ 0 | $ 4 | 0,00 |
| HUS | 07.2022 | CAD | 1.408 | $ | 1.115 | 24 | 0 | 24 | 0,02 |
| MYI | 07.2022 | $ | 111 | € | 106 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| RBC | 07.2022 | | 2.651 | CAD | 3.408 | 0 | (9) | (9) | (0,01) |
| | 08.2022 | CAD | 3.408 | $ | 2.651 | 9 | 0 | 9 | 0,01 |
| TOR | 07.2022 | | 16.462 | | 12.888 | 126 | 0 | 126 | 0,11 |
| | 07.2022 | $ | 8.000 | CAD | 10.291 | 1 | (22) | (21) | (0,02) |
| | 08.2022 | CAD | 10.292 | $ | 8.000 | 23 | (2) | 21 | 0,02 |
| | | | | | | $ 187 | $ (34) | $ 153 | 0,13 |

**ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE**

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Institutional 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 | 07.2022 | € | 1.147 | $ | 1.214 | $ 14 | $ 0 | $ 14 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 1.487 | € | 1.385 | 0 | (39) | (39) | (0,03) |
| BPS | 07.2022 | € | 19.605 | $ | 20.638 | 142 | 0 | 142 | 0,12 |
| | 07.2022 | $ | 2.460 | € | 2.298 | 0 | (58) | (58) | (0,05) |
| | 08.2022 | | 17.143 | | 16.269 | 0 | (103) | (103) | (0,08) |
| CBK | 07.2022 | | 3.594 | | 3.353 | 0 | (89) | (89) | (0,07) |
| HUS | 07.2022 | € | 17.247 | $ | 18.133 | 107 | (5) | 102 | 0,08 |
| | 07.2022 | $ | 19.617 | € | 18.196 | 0 | (595) | (595) | (0,49) |
| | 08.2022 | | 17.147 | | 16.269 | 0 | (106) | (106) | (0,09) |
| JPM | 07.2022 | € | 4.019 | $ | 4.251 | 49 | 0 | 49 | 0,04 |
| SOG | 07.2022 | $ | 18.927 | € | 17.610 | 0 | (517) | (517) | (0,43) |
| UAG | 07.2022 | | 13.019 | | 12.115 | 0 | (353) | (353) | (0,29) |
| | | | | | | $ 312 | $ (1.865) | $ (1.553) | (1,28) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | £ | 33 | $ | 41 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 823 | £ | 651 | 0 | (32) | (32) | (0,03 ) |
| BPS | 07.2022 | £ | 222 | $ | 271 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 143 | £ | 114 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | | 589 | | 467 | 0 | (22) | (22) | (0,02 ) |
| CBK | 07.2022 | £ | 13 | $ | 16 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | | 130 | | 160 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 29 | | 36 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | | 465 | | 566 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 566 | £ | 465 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | | 704 | | 559 | 0 | (26) | (26) | (0,02 ) |
| | | | | | | $ 5 | $ (85) | $ (80) | (0,07) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (8.627)** | **(7,12)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 113.188** | **93,48** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ 7.901** | **6,52** |
| **Nettovermögen** | **$ 121.089** | **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 2022 Barmittel in Höhe von USD 9.140 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 67.442 | $ 40.145 | $ 0 | $ 107.587 |
| Investmentfonds | 12.237 | 0 | 0 | 12.237 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 1.991 | 0 | 1.991 |
| Finanzderivate[3] | 0 | (8.627) | 0 | (8.627) |
| **Summen** | **$ 79.679** | **$ 33.509** | **$ 0** | **$ 113.188** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 45.541 | $ 45.693 | $ 0 | $ 91.234 |
| Investmentfonds | 9.531 | 0 | 0 | 9.531 |
| Finanzderivate[3] | 0 | 395 | 0 | 395 |
| **Summen** | **$ 55.072** | **$ 46.088** | **$ 0** | **$ 101.160** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (4.637) | $ 4.970 | $ 333 |
| BPS | (22) | 0 | (22) |
| BRC | (22) | 0 | (22) |
| CBK | (1.413) | 1.150 | (263) |
| FAR | (1) | 0 | (1) |
| HUS | (575) | 0 | (575) |
| JPM | 49 | 0 | 49 |
| MBC | 0 | 460 | 460 |
| MYI | (1.236) | 1.920 | 684 |
| SOG | (517) | 380 | (137) |
| TOR | 100 | 0 | 100 |
| UAG | (353) | 260 | (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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 55,70 | 49,88 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 33,15 | 40,87 |
| Investmentfonds | 10,11 | 9,48 |
| Pensionsgeschäfte | 1,64 | k. A. |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (7,12) | 0,39 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Kanada | 10,51 | 9,60 |
| Vereinigte Staaten | 45,19 | 35,70 |
| Kurzfristige Instrumente | 33,15 | 45,45 |
| Investmentfonds | 10,11 | 9,48 |
| Pensionsgeschäfte | 1,64 | k. A. |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Total Return Swaps auf Indizes | k. A. | 0,02 |
| Total Return Swaps auf Wertpapiere | (5,90) | 0,29 |
| Devisenterminkontrakte | 0,13 | (0,16) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (1,35) | 0,24 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 6,52 | (0,62) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 24.06.2024 (e)(g) | £ | 2.600 | $ 3.047 | 0,19 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,269 % fällig am 15.12.2033 | € | 828 | 818 | 0,05 |
| **U.S. Capital Funding Ltd.** | | | | |
| 1,269 % fällig am 10.07.2043 | $ | 16.612 | 15.096 | 0,94 |
| | | | 18.961 | 1,18 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **Times Square Hotel Trust** | | | | |
| 8,528 % fällig am 01.08.2026 | | 117 | 120 | 0,01 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **PG&E Wildfire Recovery Funding LLC** | | | | |
| 3,594 % fällig am 01.06.2032 (i) | | 3.200 | 3.179 | 0,20 |
| 4,263 % fällig am 01.06.2038 (i) | | 2.900 | 2.921 | 0,18 |
| 4,451 % fällig am 01.12.2049 (i) | | 7.500 | 7.573 | 0,47 |
| 4,674 % fällig am 01.12.2053 (i) | | 3.700 | 3.704 | 0,23 |
| | | | 17.377 | 1,08 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 36.458 | 2,27 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Pennsylvania Higher Education Assistance Agency Revenue Bonds, Series 2006** | | | | |
| 1,314 % fällig am 25.10.2036 | | 1.176 | 1.163 | 0,07 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.05.2033 - 25.05.2048 (b)(c) | | 6.524 | 5.205 | 0,32 |
| 0,200 % fällig am 25.02.2043 (a) | | 2.700 | 19 | 0,00 |
| 1,000 % fällig am 25.06.2043 (a) | | 1.160 | 69 | 0,00 |
| 1,038 % fällig am 25.03.2045 (a) | | 2.873 | 121 | 0,01 |
| 1,247 % fällig am 25.03.2060 (a) | | 8.000 | 304 | 0,02 |
| 1,302 % fällig am 25.06.2052 (a) | | 6.280 | 236 | 0,01 |
| 1,414 % fällig am 25.07.2045 (a) | | 5.315 | 255 | 0,02 |
| 1,433 % fällig am 25.11.2047 (a) | | 19.374 | 915 | 0,06 |
| 1,624 % fällig am 25.02.2052 (a) | | 256.462 | 8.278 | 0,51 |
| 1,801 % fällig am 25.02.2062 (a) | | 11.535 | 783 | 0,05 |
| 1,965 % fällig am 25.09.2042 | | 952 | 601 | 0,04 |
| 2,000 % fällig am 25.10.2050 (a) | | 3.251 | 392 | 0,02 |
| 2,314 % fällig am 25.10.2042 | | 11 | 10 | 0,00 |
| 2,326 % fällig am 25.08.2047 (a) | | 30.118 | 1.699 | 0,11 |
| 2,500 % fällig am 25.12.2027 - 25.09.2051 (a) | | 68.791 | 9.126 | 0,57 |
| 3,000 % fällig am 25.11.2027 - 25.01.2051 (a) | | 60.667 | 8.947 | 0,56 |
| 3,000 % fällig am 01.02.2057 - 01.07.2060 (i) | | 26.799 | 25.203 | 1,57 |
| 3,126 % fällig am 25.05.2040 (a) | | 53 | 0 | 0,00 |
| 3,376 % fällig am 25.06.2050 (a) | | 3.243 | 443 | 0,03 |
| 3,500 % fällig am 25.02.2028 - 25.11.2047 (a) | | 26.359 | 4.150 | 0,26 |
| 3,510 % fällig am 01.03.2029 (i) | | 1.126 | 1.083 | 0,07 |
| 3,511 % fällig am 01.08.2049 | | 841 | 842 | 0,05 |
| 3,565 % fällig am 25.04.2043 | | 232 | 188 | 0,01 |
| 3,644 % fällig am 01.12.2048 | | 737 | 745 | 0,05 |
| 3,752 % fällig am 25.03.2033 | | 762 | 637 | 0,04 |
| 3,870 % fällig am 01.07.2027 (i) | | 1.600 | 1.597 | 0,10 |
| 3,938 % fällig am 25.03.2047 | | 53 | 46 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 25.04.2032 - 25.07.2050 (a) | | 35.503 | 6.093 | 0,38 |
| 4,000 % fällig am 25.05.2050 | | 2.115 | 2.069 | 0,13 |
| 4,050 % fällig am 01.12.2028 (i) | | 1.915 | 1.974 | 0,12 |
| 4,126 % fällig am 25.12.2042 | | 1.238 | 937 | 0,06 |
| 4,186 % fällig am 25.03.2033 | | 115 | 99 | 0,01 |
| 4,326 % fällig am 25.04.2044 (a) | | 1.738 | 244 | 0,02 |
| 4,329 % fällig am 25.05.2051 | | 2.708 | 2.605 | 0,16 |
| 4,376 % fällig am 25.05.2046 - 25.01.2050 (a) | | 22.651 | 3.594 | 0,22 |
| 4,407 % fällig am 25.06.2043 | | 456 | 355 | 0,02 |
| 4,426 % fällig am 25.10.2042 - 25.07.2059 (a) | | 45.798 | 6.587 | 0,41 |
| 4,476 % fällig am 25.06.2037 - 25.07.2050 (a) | | 26.788 | 3.946 | 0,25 |
| 4,500 % fällig am 25.06.2029 - 25.07.2050 (a) | $ | 7.180 | $ 1.050 | 0,07 |
| 4,500 % fällig am 01.04.2059 (i) | | 5.092 | 5.275 | 0,33 |
| 4,526 % fällig am 25.12.2042 - 25.09.2048 (a) | | 12.002 | 1.810 | 0,11 |
| 4,576 % fällig am 25.11.2047 - 25.06.2048 (a) | | 32.869 | 4.876 | 0,30 |
| 4,626 % fällig am 25.04.2043 (a) | | 2.200 | 228 | 0,01 |
| 4,676 % fällig am 25.05.2030 (a) | | 1.934 | 153 | 0,01 |
| 4,906 % fällig am 25.01.2041 (a) | | 631 | 96 | 0,01 |
| 4,976 % fällig am 25.09.2040 - 25.09.2042 (a) | | 4.136 | 460 | 0,03 |
| 5,000 % fällig am 25.04.2034 - 25.06.2050 (a) | | 1.950 | 357 | 0,02 |
| 5,000 % fällig am 25.05.2043 | | 357 | 271 | 0,02 |
| 5,026 % fällig am 25.05.2034 - 25.03.2039 (a) | | 892 | 27 | 0,00 |
| 5,076 % fällig am 25.07.2026 (a) | | 544 | 4 | 0,00 |
| 5,176 % fällig am 25.12.2032 (a) | | 604 | 76 | 0,00 |
| 5,476 % fällig am 25.11.2033 - 25.10.2034 (a) | | 954 | 92 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.06.2035 - 25.02.2040 (a) | | 2.452 | 494 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 25.06.2043 | | 362 | 313 | 0,02 |
| 5,576 % fällig am 25.10.2042 (a) | | 537 | 88 | 0,01 |
| 5,620 % fällig am 01.06.2041 | | 480 | 510 | 0,03 |
| 5,976 % fällig am 25.11.2033 (a) | | 56 | 7 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2032 - 25.03.2033 (a) | | 360 | 59 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2041 | | 235 | 221 | 0,01 |
| 6,017 % fällig am 25.10.2043 | | 127 | 114 | 0,01 |
| 6,051 % fällig am 25.08.2033 | | 302 | 291 | 0,02 |
| 6,118 % fällig am 25.08.2033 | | 101 | 96 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.12.2034 (a) | | 1.627 | 284 | 0,02 |
| 6,856 % fällig am 25.11.2042 | | 322 | 284 | 0,02 |
| 7,500 % fällig am 25.04.2042 | | 100 | 98 | 0,01 |
| 11,346 % fällig am 25.07.2023 | | 66 | 64 | 0,00 |
| **Freddie Mac** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.02.2035 - 15.10.2058 (b)(c) | | 14.876 | 11.846 | 0,74 |
| 0,501 % fällig am 25.08.2024 (a) | | 56.667 | 423 | 0,03 |
| 0,999 % fällig am 15.07.2042 (a) | | 10.498 | 444 | 0,03 |
| 1,135 % fällig am 15.02.2038 (a) | | 4.308 | 187 | 0,01 |
| 1,295 % fällig am 15.01.2038 (a) | | 260 | 14 | 0,00 |
| 1,694 % fällig am 25.12.2036 | | 7.660 | 7.066 | 0,44 |
| 1,707 % fällig am 15.04.2047 (a) | | 3.884 | 295 | 0,02 |
| 1,817 % fällig am 15.10.2032 | | 62 | 53 | 0,00 |
| 1,868 % fällig am 15.08.2047 (a) | | 4.352 | 229 | 0,01 |
| 1,965 % fällig am 15.09.2042 | | 925 | 621 | 0,04 |
| 2,000 % fällig am 25.11.2050 - 25.01.2051 (a) | | 6.511 | 640 | 0,04 |
| 2,500 % fällig am 15.11.2027 - 25.11.2051 (a) | | 48.525 | 6.157 | 0,38 |
| 2,726 % fällig am 25.01.2051 | | 2.867 | 2.743 | 0,17 |
| 2,750 % fällig am 25.11.2029 | | 13.041 | 12.535 | 0,78 |
| 2,920 % fällig am 01.09.2036 (i) | | 1.529 | 1.318 | 0,08 |
| 3,000 % fällig am 15.03.2027 - 25.06.2051 (a) | | 103.396 | 15.705 | 0,98 |
| 3,126 % fällig am 25.05.2042 | | 3.249 | 3.210 | 0,20 |
| 3,176 % fällig am 15.08.2040 (a) | | 1.877 | 121 | 0,01 |
| 3,314 % fällig am 15.12.2027 (a) | | 799 | 45 | 0,00 |
| 3,471 % fällig am 15.11.2048 (a) | | 48.388 | 2.393 | 0,15 |
| 3,500 % fällig am 15.03.2029 - 25.03.2052 (a) | | 33.019 | 5.407 | 0,34 |
| 3,500 % fällig am 01.01.2038 - 01.12.2046 | | 1.221 | 1.206 | 0,07 |
| 3,554 % fällig am 25.09.2024 | | 6.100 | 5.384 | 0,33 |
| 3,676 % fällig am 15.04.2042 (a) | | 1.697 | 161 | 0,01 |
| 3,826 % fällig am 25.04.2042 | | 3.100 | 2.922 | 0,18 |
| 3,848 % fällig am 15.12.2048 | | 1.021 | 1.000 | 0,06 |
| 4,000 % fällig am 15.10.2041 - 25.08.2050 (a) | | 27.494 | 6.006 | 0,37 |
| 4,000 % fällig am 15.01.2043 - 01.04.2048 | | 13.647 | 13.424 | 0,84 |
| 4,014 % fällig am 15.05.2043 | | 38 | 27 | 0,00 |
| 4,426 % fällig am 25.11.2049 - 25.06.2050 (a) | | 30.116 | 4.391 | 0,27 |
| 4,476 % fällig am 25.06.2050 (a) | | 12.392 | 2.076 | 0,13 |
| 4,500 % fällig am 15.02.2037 - 25.10.2051 (a) | | 12.560 | 2.032 | 0,13 |
| 4,500 % fällig am 15.08.2043 - 01.02.2048 | | 1.109 | 1.078 | 0,07 |
| 4,526 % fällig am 15.02.2041 - 25.06.2050 (a) | $ | 9.690 | $ 1.645 | 0,10 |
| 4,566 % fällig am 15.09.2043 (a) | | 839 | 125 | 0,01 |
| 4,626 % fällig am 15.07.2041 (a) | | 2.526 | 303 | 0,02 |
| 4,676 % fällig am 15.10.2041 - 15.08.2042 (a) | | 12.185 | 1.884 | 0,12 |
| 4,726 % fällig am 15.08.2041 - 15.09.2044 (a) | | 8.645 | 1.224 | 0,08 |
| 4,776 % fällig am 15.02.2044 (a) | | 183 | 36 | 0,00 |
| 4,826 % fällig am 15.08.2025 - 15.10.2048 (a) | | 14.458 | 2.251 | 0,14 |
| 4,876 % fällig am 15.03.2048 (a) | | 3.694 | 579 | 0,04 |
| 4,926 % fällig am 15.09.2042 (a) | | 1.127 | 122 | 0,01 |
| 4,976 % fällig am 15.10.2036 (a) | | 1.291 | 143 | 0,01 |
| 5,000 % fällig am 15.05.2025 - 25.05.2048 (a) | | 2.157 | 356 | 0,02 |
| 5,000 % fällig am 15.10.2042 - 01.03.2049 | | 3.610 | 3.658 | 0,23 |
| 5,146 % fällig am 15.11.2037 (a) | | 256 | 29 | 0,00 |
| 5,166 % fällig am 15.01.2042 (a) | | 6.572 | 1.067 | 0,07 |
| 5,276 % fällig am 15.07.2023 - 15.11.2041 (a) | | 194 | 15 | 0,00 |
| 5,326 % fällig am 15.07.2026 (a) | | 962 | 50 | 0,00 |
| 5,374 % fällig am 25.08.2050 | | 123 | 123 | 0,01 |
| 5,376 % fällig am 15.09.2026 - 15.12.2042 (a) | | 2.459 | 381 | 0,02 |
| 5,383 % fällig am 15.07.2043 | | 11 | 10 | 0,00 |
| 5,387 % fällig am 15.12.2043 | | 164 | 122 | 0,01 |
| 5,406 % fällig am 15.09.2039 (a) | | 2.913 | 410 | 0,03 |
| 5,526 % fällig am 15.03.2038 (a) | | 496 | 63 | 0,00 |
| 5,952 % fällig am 15.06.2037 - 15.06.2044 | | 3.915 | 3.328 | 0,21 |
| 6,452 % fällig am 15.05.2041 | | 363 | 345 | 0,02 |
| 6,576 % fällig am 15.12.2031 (a) | | 63 | 9 | 0,00 |
| 6,609 % fällig am 15.12.2043 | | 648 | 496 | 0,03 |
| 7,346 % fällig am 15.01.2041 | | 829 | 789 | 0,05 |
| 9,497 % fällig am 15.09.2032 | | 329 | 338 | 0,02 |
| 10,203 % fällig am 15.05.2041 | | 1.425 | 1.381 | 0,09 |
| **Ginnie Mae** | | | | |
| 0,000 % fällig am 20.08.2033 - 20.01.2044 (b)(c) | | 2.788 | 2.582 | 0,16 |
| 0,663 % fällig am 20.11.2046 (a) | | 5.633 | 155 | 0,01 |
| 0,693 % fällig am 20.06.2046 (a) | | 6.238 | 238 | 0,01 |
| 0,704 % fällig am 20.08.2047 (a) | | 4.827 | 156 | 0,01 |
| 0,725 % fällig am 20.06.2042 (a) | | 1.825 | 57 | 0,00 |
| 0,748 % fällig am 20.05.2047 (a) | | 8.614 | 348 | 0,02 |
| 0,765 % fällig am 20.01.2047 (a) | | 5.607 | 171 | 0,01 |
| 0,775 % fällig am 20.06.2042 (a) | | 1.688 | 40 | 0,00 |
| 0,779 % fällig am 20.07.2041 (a) | | 1.540 | 46 | 0,00 |
| 0,804 % fällig am 20.10.2046 (a) | | 4.885 | 170 | 0,01 |
| 0,818 % fällig am 20.07.2046 (a) | | 5.670 | 163 | 0,01 |
| 0,859 % fällig am 20.06.2043 (a) | | 1.656 | 49 | 0,00 |
| 0,890 % fällig am 20.05.2040 (a) | | 5.207 | 163 | 0,01 |
| 0,897 % fällig am 20.11.2046 (a) | | 8.403 | 395 | 0,02 |
| 1,123 % fällig am 20.04.2043 (a) | | 8.189 | 256 | 0,02 |
| 1,713 % fällig am 20.01.2066 | | 90 | 89 | 0,01 |
| 2,000 % fällig am 16.05.2041 | | 2.612 | 2.399 | 0,15 |
| 2,444 % fällig am 20.03.2058 | | 217 | 217 | 0,01 |
| 2,500 % fällig am 20.09.2027 (a) | | 4.514 | 220 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 20.12.2047 - 20.02.2048 (i) | | 5.806 | 5.528 | 0,34 |
| 3,000 % fällig am 20.12.2049 - 20.02.2052 (a) | | 14.601 | 1.762 | 0,11 |
| 3,000 % fällig am 20.08.2051 - 20.11.2067 | | 4.472 | 4.173 | 0,26 |
| 3,250 % fällig am 20.01.2047 | | 643 | 610 | 0,04 |
| 3,500 % fällig am 20.09.2029 - 20.09.2046 (a) | | 1.565 | 239 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 20.03.2042 - 20.03.2052 | | 9.767 | 9.291 | 0,58 |
| 3,500 % fällig am 20.11.2046 - 20.02.2052 (i) | | 16.542 | 16.209 | 1,01 |
| 3,955 % fällig am 20.09.2043 (a) | | 1.268 | 105 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 15.04.2047 - 15.08.2048 | | 1.725 | 1.750 | 0,11 |
| 4,000 % fällig am 15.07.2048 (i) | | 912 | 926 | 0,06 |
| 4,125 % fällig am 20.09.2045 (a) | | 2.279 | 347 | 0,02 |
| 4,500 % fällig am 20.05.2043 - 20.09.2047 (a) | | 2.959 | 645 | 0,04 |
| 4,500 % fällig am 20.04.2048 - 20.02.2049 | | 2.340 | 2.385 | 0,15 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 4,505 % fällig am 20.01.2035 - 20.08.2049 (a) | $ | 11.257 | $ 1.131 | 0,07 |
| 4,541 % fällig am 16.04.2040 - 16.08.2042 (a) | | 3.430 | 371 | 0,02 |
| 4,605 % fällig am 20.03.2035 - 20.09.2048 (a) | | 2.364 | 311 | 0,02 |
| 4,655 % fällig am 20.07.2044 (a) | | 2.278 | 465 | 0,03 |
| 4,891 % fällig am 16.01.2038 (a) | | 34 | 1 | 0,00 |
| 4,941 % fällig am 16.02.2040 (a) | | 1.986 | 200 | 0,01 |
| 5,000 % fällig am 20.09.2040 (a) | | 559 | 0 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 20.11.2048 | | 1.015 | 1.046 | 0,06 |
| 5,105 % fällig am 20.05.2041 (a) | | 1.703 | 154 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 20.02.2047 | | 19 | 20 | 0,00 |
| 13,500 % fällig am 20.11.2045 | | 534 | 768 | 0,05 |
| **Ginnie Mae, TBA** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.07.2052 | | 47.100 | 44.418 | 2,76 |
| 3,500 % fällig am 01.07.2052 | | 24.550 | 23.860 | 1,48 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2052 | | 15.700 | 15.615 | 0,97 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2052 | | 9.620 | 9.727 | 0,61 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.01.2033 - 01.09.2051 | | 18.734 | 16.950 | 1,05 |
| 2,500 % fällig am 01.01.2033 - 01.09.2051 (i) | | 68.591 | 62.341 | 3,88 |
| 3,000 % fällig am 01.01.2038 - 01.06.2051 (i) | | 272.061 | 254.798 | 15,85 |
| 3,000 % fällig am 01.04.2038 - 01.04.2052 | | 99.597 | 93.586 | 5,82 |
| 3,500 % fällig am 01.02.2030 - 01.01.2052 | | 29.894 | 29.137 | 1,81 |
| 3,500 % fällig am 01.10.2034 - 01.06.2051 (i) | | 48.744 | 47.751 | 2,97 |
| 4,000 % fällig am 01.02.2037 - 01.08.2049 | | 15.404 | 15.493 | 0,96 |
| 4,000 % fällig am 01.09.2037 - 01.08.2038 (i) | | 4.931 | 5.038 | 0,31 |
| 4,500 % fällig am 01.12.2038 (i) | | 2.728 | 2.851 | 0,18 |
| 4,500 % fällig am 01.07.2044 - 01.01.2049 | | 1.035 | 1.049 | 0,07 |
| 5,000 % fällig am 01.06.2048 - 01.03.2049 | | 922 | 955 | 0,06 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.07.2037 - 01.07.2052 | | 68.700 | 66.052 | 4,11 |
| 3,500 % fällig am 01.07.2037 - 01.08.2052 | | 558.900 | 537.645 | 33,45 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2037 - 01.08.2052 | | 269.933 | 266.922 | 16,61 |
| 5,000 % fällig am 01.07.2052 | | 100 | 102 | 0,01 |
| | | | 1.801.177 | 112,06 |

## NON-AGENCY-MBS

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **1166 Avenue of the Americas Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,690 % fällig am 13.10.2037 | | 2.000 | 1.949 | 0,12 |
| **225 Liberty Street Trust** | | | | |
| 4,803 % fällig am 10.02.2036 | | 5.000 | 4.673 | 0,29 |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | | |
| 1,749 % fällig am 25.03.2047 | | 2.385 | 2.150 | 0,13 |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 2,204 % fällig am 25.11.2045 | | 2.103 | 1.919 | 0,12 |
| 5,883 % fällig am 25.09.2035 | | 629 | 387 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 25.03.2047 | | 1.252 | 1.028 | 0,06 |
| **Angel Oak Mortgage Trust** | | | | |
| 1,469 % fällig am 25.06.2065 | | 634 | 608 | 0,04 |
| 2,336 % fällig am 25.04.2066 | | 3.638 | 2.995 | 0,19 |
| **Ashford Hospitality Trust** | | | | |
| 2,574 % fällig am 15.04.2035 | | 12.000 | 11.549 | 0,72 |
| 2,724 % fällig am 15.04.2035 | | 3.000 | 2.851 | 0,18 |
| 2,775 % fällig am 15.06.2035 | | 15.150 | 14.587 | 0,91 |
| 3,175 % fällig am 15.06.2035 | | 11.900 | 11.324 | 0,70 |
| 3,424 % fällig am 15.04.2035 | | 17.050 | 15.990 | 0,99 |
| 4,075 % fällig am 15.06.2035 | | 6.900 | 6.477 | 0,40 |
| **Atlas Funding PLC** | | | | |
| 1,388 % fällig am 25.07.2058 | £ | 1.681 | 2.022 | 0,13 |
| 1,988 % fällig am 25.07.2058 | | 2.500 | 2.990 | 0,19 |
| 2,188 % fällig am 25.07.2058 | £ | 1.150 | $ 1.352 | 0,08 |
| 2,738 % fällig am 25.07.2058 | | 950 | 1.114 | 0,07 |
| **Atrium Hotel Portfolio Trust** | | | | |
| 2,754 % fällig am 15.06.2035 | $ | 1.400 | 1.333 | 0,08 |
| 2,824 % fällig am 15.12.2036 | | 4.000 | 3.807 | 0,24 |
| 2,974 % fällig am 15.06.2035 | | 7.500 | 7.103 | 0,44 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 1,843 % fällig am 26.05.2037 | | 4.002 | 3.611 | 0,22 |
| 5,763 % fällig am 25.10.2036 | | 1.983 | 1.829 | 0,11 |
| **Barclays Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.07.2037 (c) | | 5.300 | 5.128 | 0,32 |
| 3,715 % fällig am 15.07.2037 | | 5.581 | 5.335 | 0,33 |
| **Barley Hill PLC** | | | | |
| 2,372 % fällig am 27.08.2058 | £ | 4.900 | 5.796 | 0,36 |
| 2,672 % fällig am 27.08.2058 | | 2.953 | 3.483 | 0,22 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 1,904 % fällig am 25.04.2037 | $ | 1.835 | 1.698 | 0,11 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 2,749 % fällig am 25.01.2035 | | 1.379 | 1.435 | 0,09 |
| **Bear Stearns Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.01.2037 | | 5.112 | 4.527 | 0,28 |
| 1,804 % fällig am 25.06.2037 | | 3.244 | 2.892 | 0,18 |
| **Braemar Hotels & Resorts Trust** | | | | |
| 2,374 % fällig am 15.06.2035 | | 2.500 | 2.410 | 0,15 |
| **BX Trust** | | | | |
| 2,544 % fällig am 15.05.2030 | | 3.000 | 2.871 | 0,18 |
| 2,649 % fällig am 15.09.2037 | | 1.225 | 1.160 | 0,07 |
| **BXP Trust** | | | | |
| 3,379 % fällig am 13.06.2039 | | 1.500 | 1.404 | 0,09 |
| **Cascade Funding Mortgage Trust** | | | | |
| 4,000 % fällig am 25.10.2068 | | 1.119 | 1.100 | 0,07 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | | |
| 3,342 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 56 | 54 | 0,00 |
| **ChaseFlex Trust** | | | | |
| 2,304 % fällig am 25.05.2037 | | 1.884 | 1.853 | 0,12 |
| **Chester B1 Issuer PLC** | | | | |
| 1,750 % fällig am 17.01.2058 | £ | 6.388 | 7.733 | 0,48 |
| 2,050 % fällig am 17.01.2058 | | 500 | 603 | 0,04 |
| **Citigroup Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 2,424 % fällig am 15.07.2030 | $ | 241 | 241 | 0,01 |
| 3,635 % fällig am 10.05.2035 | | 1.900 | 1.773 | 0,11 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.12.2035 | | 1.569 | 1.504 | 0,09 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 2,651 % fällig am 25.08.2035 | | 16 | 16 | 0,00 |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,174 % fällig am 25.01.2037 | | 1.638 | 1.386 | 0,09 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036 | | 955 | 901 | 0,06 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,416 % fällig am 25.06.2046 | | 2.358 | 1.974 | 0,12 |
| 1,476 % fällig am 25.12.2035 | | 1.341 | 1.241 | 0,08 |
| 1,856 % fällig am 25.11.2047 ^ | | 3.297 | 2.877 | 0,18 |
| 1,944 % fällig am 25.02.2047 | | 330 | 293 | 0,02 |
| 1,944 % fällig am 25.09.2047 | | 9 | 8 | 0,00 |
| 2,032 % fällig am 20.03.2046 | | 564 | 446 | 0,03 |
| 2,032 % fällig am 20.05.2046 ^ | | 2.007 | 1.724 | 0,11 |
| 2,184 % fällig am 25.10.2046 | | 2.478 | 2.261 | 0,14 |
| 2,264 % fällig am 25.11.2035 | | 4.325 | 3.573 | 0,22 |
| 2,324 % fällig am 25.09.2035 | | 2.038 | 1.867 | 0,12 |
| 5,500 % fällig am 25.06.2035 | | 155 | 135 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.07.2035 | | 2.259 | 1.746 | 0,11 |
| 5,500 % fällig am 25.10.2035 | | 1.285 | 1.012 | 0,06 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 1.783 | 1.174 | 0,07 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 | | 260 | 206 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 | | 3.747 | 2.495 | 0,16 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 1.437 | 688 | 0,04 |
| 6,250 % fällig am 25.05.2036 | | 294 | 196 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 25.09.2037 | | 518 | 387 | 0,02 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 2,124 % fällig am 25.03.2036 | | 675 | 682 | 0,04 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,592 % fällig am 25.04.2035 ^ | | 255 | 196 | 0,01 |
| 2,784 % fällig am 20.11.2035 | | 3.528 | 3.196 | 0,20 |
| 2,930 % fällig am 20.04.2036 | | 47 | 43 | 0,00 |
| 3,213 % fällig am 20.04.2036 | | 578 | 482 | 0,03 |
| 5,750 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 745 | 441 | 0,03 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2037 ^ | | 2.317 | 1.063 | 0,07 |
| 6,500 % fällig am 25.12.2037 | | 5.242 | 2.703 | 0,17 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.10.2021 | $ | 15 | $ 13 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Trust** | | | | |
| 3,303 % fällig am 10.07.2034 | | 3.500 | 3.496 | 0,22 |
| **DBGS Mortgage Trust** | | | | |
| 2,824 % fällig am 15.06.2033 | | 2.422 | 2.282 | 0,14 |
| **DBWF Mortgage Trust** | | | | |
| 3,995 % fällig am 19.12.2030 | | 7.000 | 6.655 | 0,41 |
| **Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,104 % fällig am 25.01.2047 | | 5.527 | 5.055 | 0,31 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,802 % fällig am 19.10.2036 | | 4.944 | 4.340 | 0,27 |
| **Dutch Property Finance BV** | | | | |
| 0,250 % fällig am 28.01.2048 | € | 1.321 | 1.381 | 0,09 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 13.03.2045 | | 550 | 552 | 0,03 |
| 0,148 % fällig am 10.09.2044 | | 800 | 785 | 0,05 |
| 2,140 % fällig am 13.06.2045 | £ | 1.673 | 1.661 | 0,10 |
| 2,590 % fällig am 13.06.2045 | | 359 | 409 | 0,03 |
| **Fingal Securities RMBS DAC** | | | | |
| 1,070 % fällig am 28.07.2055 | € | 8.200 | 8.567 | 0,53 |
| 1,570 % fällig am 28.07.2055 | | 21.845 | 22.799 | 1,42 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 3,292 % fällig am 25.07.2035 | $ | 222 | 207 | 0,01 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,024 % fällig am 25.10.2046 | | 5.799 | 5.348 | 0,33 |
| **Grifonas Finance PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 28.08.2039 | € | 1.089 | 1.078 | 0,07 |
| **GS Mortgage Securities Corp. Trust** | | | | |
| 2,524 % fällig am 15.07.2031 | $ | 600 | 583 | 0,04 |
| 2,774 % fällig am 15.07.2025 | | 2.712 | 2.595 | 0,16 |
| 2,774 % fällig am 15.07.2031 | | 2.000 | 1.921 | 0,12 |
| 2,924 % fällig am 15.11.2032 | | 4.000 | 3.840 | 0,24 |
| 3,324 % fällig am 15.11.2032 | | 9.250 | 8.846 | 0,55 |
| 4,579 % fällig am 10.10.2032 | | 5.821 | 5.754 | 0,36 |
| **GS Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 3,932 % fällig am 10.10.2035 | | 3.700 | 3.400 | 0,21 |
| **GSMPS Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,024 % fällig am 25.04.2036 | | 382 | 318 | 0,02 |
| 7,064 % fällig am 20.10.2032 | | 1.356 | 1.230 | 0,08 |
| **GSMSC Resecuritization Trust** | | | | |
| 9,289 % fällig am 26.04.2037 | | 7.355 | 2.294 | 0,14 |
| **Hilton USA Trust** | | | | |
| 3,174 % fällig am 15.12.2034 | | 10.400 | 9.899 | 0,62 |
| 4,927 % fällig am 05.11.2035 | | 8.201 | 7.953 | 0,49 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | | |
| 2,434 % fällig am 25.10.2035 | | 7.184 | 6.939 | 0,43 |
| **Hops Hill No. 1 PLC** | | | | |
| 1,922 % fällig am 27.05.2054 | £ | 2.136 | 2.581 | 0,16 |
| **Hops Hill PLC** | | | | |
| 2,572 % fällig am 27.05.2054 | | 3.100 | 3.727 | 0,23 |
| 2,822 % fällig am 27.05.2054 | | 3.000 | 3.538 | 0,22 |
| 3,322 % fällig am 27.05.2054 | | 1.100 | 1.308 | 0,08 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | | |
| 2,584 % fällig am 25.07.2035 | $ | 1.100 | 1.071 | 0,07 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,024 % fällig am 25.10.2036 | | 3.814 | 3.506 | 0,22 |
| 2,899 % fällig am 25.12.2035 | | 396 | 329 | 0,02 |
| 3,028 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 3.336 | 2.306 | 0,14 |
| **InTown Hotel Portfolio Trust** | | | | |
| 3,775 % fällig am 15.01.2033 | | 3.853 | 3.798 | 0,24 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 5.111 | 4.648 | 0,29 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 3,464 % fällig am 15.10.2032 | | 404 | 403 | 0,03 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 3,524 % fällig am 15.02.2035 | | 6.000 | 5.733 | 0,36 |
| 3,881 % fällig am 05.01.2031 | | 443 | 438 | 0,03 |
| 5,337 % fällig am 15.05.2047 | | 4.815 | 4.437 | 0,28 |
| 5,350 % fällig am 05.07.2033 | | 1.950 | 1.921 | 0,12 |
| 6,278 % fällig am 12.02.2051 | | 71 | 311 | 0,02 |
| **JPMorgan Resecuritization Trust** | | | | |
| 5,225 % fällig am 26.09.2037 | | 1.422 | 1.146 | 0,07 |
| 6,497 % fällig am 26.04.2037 | | 996 | 570 | 0,04 |
| **Lehman Mortgage Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036 | | 1.584 | 1.398 | 0,09 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 2,104 % fällig am 25.06.2047 | $ | 6.446 | $ 6.218 | 0,39 |
| **MASTR Asset Securitization Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 | | 735 | 674 | 0,04 |
| **MASTR Reperforming Loan Trust** | | | | |
| 7,000 % fällig am 25.07.2035 | | 1.314 | 1.023 | 0,06 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 6,250 % fällig am 25.08.2036 | | 4.163 | 2.179 | 0,14 |
| **Morgan Stanley Capital Trust** | | | | |
| 2,574 % fällig am 15.11.2034 | | 3.800 | 3.691 | 0,23 |
| 2,724 % fällig am 15.11.2034 | | 1.000 | 961 | 0,06 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 | | 1.091 | 810 | 0,05 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2037 | | 6.452 | 3.884 | 0,24 |
| **Mortgage Equity Conversion Asset Trust** | | | | |
| 3,300 % fällig am 25.02.2042 | | 1.005 | 922 | 0,06 |
| **MSCG Trust** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.10.2037 (c) | | 3.400 | 3.295 | 0,21 |
| **Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,549 % fällig am 25.10.2035 | | 1.111 | 734 | 0,05 |
| 6,017 % fällig am 25.06.2037 | | 1.341 | 1.221 | 0,08 |
| **Nomura Resecuritization Trust** | | | | |
| 0,000 % fällig am 26.11.2036 (c) | | 2.236 | 1.972 | 0,12 |
| **Precise Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,952 % fällig am 12.12.2055 | £ | 6.367 | 7.695 | 0,48 |
| **Ready Capital Mortgage Financing LLC** | | | | |
| 3,774 % fällig am 25.02.2035 | $ | 4.953 | 4.922 | 0,31 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.08.2036 | | 980 | 800 | 0,05 |
| 3,688 % fällig am 25.12.2035 | | 1.216 | 609 | 0,04 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 190 | 164 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 1.134 | 978 | 0,06 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 2.989 | 1.112 | 0,07 |
| **RMAC PLC** | | | | |
| 1,841 % fällig am 12.06.2046 | £ | 2.625 | 3.189 | 0,20 |
| **RMAC Securities PLC** | | | | |
| 1,041 % fällig am 12.06.2044 | | 435 | 499 | 0,03 |
| **Sestante Finance SRL** | | | | |
| 0,000 % fällig am 23.07.2046 | € | 980 | 958 | 0,06 |
| **Stratton BTL Mortgage Funding** | | | | |
| 2,137 % fällig am 20.01.2054 | £ | 3.000 | 3.293 | 0,20 |
| **Stratton Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,961 % fällig am 20.07.2060 | | 8.100 | 9.777 | 0,61 |
| 2,224 % fällig am 25.09.2051 | | 3.250 | 3.906 | 0,24 |
| 2,461 % fällig am 20.07.2060 | | 2.200 | 2.654 | 0,17 |
| 2,524 % fällig am 25.09.2051 | | 5.000 | 5.977 | 0,37 |
| 2,961 % fällig am 20.07.2060 | | 2.500 | 3.019 | 0,19 |
| 3,461 % fällig am 20.07.2060 | | 3.600 | 4.346 | 0,27 |
| 3,752 % fällig am 12.03.2052 | | 1.400 | 1.660 | 0,10 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.02.2037 | $ | 518 | 505 | 0,03 |
| 2,064 % fällig am 25.06.2037 | | 376 | 341 | 0,02 |
| 2,543 % fällig am 25.02.2034 | | 10 | 10 | 0,00 |
| 2,810 % fällig am 25.07.2035 | | 1.714 | 953 | 0,06 |
| 3,048 % fällig am 25.05.2035 | | 1.028 | 836 | 0,05 |
| 3,245 % fällig am 25.12.2034 | | 2.047 | 1.969 | 0,12 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 1,844 % fällig am 25.09.2047 | | 3.607 | 3.087 | 0,19 |
| 2,164 % fällig am 25.08.2035 | | 534 | 476 | 0,03 |
| 2,720 % fällig am 19.12.2033 | | 516 | 484 | 0,03 |
| **Structured Asset Securities Corp.** | | | | |
| 1,874 % fällig am 25.07.2035 | | 1.558 | 1.439 | 0,09 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,874 % fällig am 25.05.2036 | | 2.226 | 1.843 | 0,11 |
| **Sutherland Commercial Mortgage Loans** | | | | |
| 3,192 % fällig am 25.05.2037 | | 139 | 139 | 0,01 |
| **Tharaldson Hotel Portfolio Trust** | | | | |
| 2,770 % fällig am 11.11.2034 | | 2.863 | 2.691 | 0,17 |
| **Trinity Square PLC** | | | | |
| 1,850 % fällig am 15.07.2059 | £ | 9.600 | 11.536 | 0,72 |
| 2,150 % fällig am 15.07.2059 | | 3.200 | 3.789 | 0,24 |
| 2,450 % fällig am 15.07.2059 | | 2.400 | 2.833 | 0,18 |
| 3,200 % fällig am 15.07.2059 | | 1.600 | 1.879 | 0,12 |
| **Tudor Rose Mortgages** | | | | |
| 1,690 % fällig am 20.06.2048 | | 3.705 | 4.371 | 0,27 |
| 1,940 % fällig am 20.06.2048 | | 5.105 | 6.010 | 0,37 |
| 2,290 % fällig am 20.06.2048 | | 9.746 | 11.443 | 0,71 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | |
| 1,632 % fällig am 12.09.2050 | £ | 2.803 | $ 3.387 | 0,21 |
| 2,324 % fällig am 01.12.2055 | | 3.007 | 3.331 | 0,21 |
| **UBS Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 4,241 % fällig am 15.06.2051 | $ | 1.700 | 1.684 | 0,10 |
| **Uropa Securities PLC** | | | | |
| 1,337 % fällig am 10.10.2040 | £ | 76 | 87 | 0,01 |
| 1,437 % fällig am 10.10.2040 | | 38 | 43 | 0,00 |
| **Verus Securitization Trust** | | | | |
| 1,977 % fällig am 25.03.2060 | $ | 391 | 384 | 0,02 |
| 2,338 % fällig am 25.10.2063 | | 1.250 | 1.201 | 0,07 |
| 3,035 % fällig am 25.03.2060 | | 200 | 196 | 0,01 |
| 3,195 % fällig am 25.10.2063 | | 1.000 | 924 | 0,06 |
| 3,889 % fällig am 25.03.2060 | | 400 | 396 | 0,02 |
| 4,199 % fällig am 25.10.2063 | | 1.000 | 931 | 0,06 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 1,246 % fällig am 25.04.2047 ^ | | 71 | 62 | 0,00 |
| 1,436 % fällig am 25.09.2046 | | 1.014 | 876 | 0,05 |
| 1,473 % fällig am 25.01.2047 | | 720 | 643 | 0,04 |
| 1,723 % fällig am 25.11.2046 | | 311 | 286 | 0,02 |
| 2,713 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 2.369 | 2.189 | 0,14 |
| 3,188 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 3.384 | 3.071 | 0,19 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 1,466 % fällig am 25.06.2046 | | 2.228 | 1.836 | 0,11 |
| **Worldwide Plaza Trust** | | | | |
| 3,715 % fällig am 10.11.2036 | | 3.950 | 3.389 | 0,21 |
| | | | 520.121 | 32,36 |

**FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,494 % fällig am 25.09.2035 | | 4.200 | 3.975 | 0,25 |
| 2,644 % fällig am 25.07.2035 | | 2.150 | 2.049 | 0,13 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,599 % fällig am 25.11.2033 | | 804 | 781 | 0,05 |
| **Adagio CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.10.2031 | € | 2.400 | 2.460 | 0,15 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.03.2035 ^ | $ | 69 | 66 | 0,00 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 3,454 % fällig am 25.12.2034 | | 1.181 | 1.112 | 0,07 |
| **American Credit Acceptance Receivables Trust** | | | | |
| 6,440 % fällig am 12.06.2025 | | 2.500 | 2.503 | 0,16 |
| **Ameriquest Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,194 % fällig am 25.04.2036 | | 6.350 | 5.639 | 0,35 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,719 % fällig am 25.09.2034 | | 3.079 | 2.934 | 0,18 |
| **Aqueduct European CLO DAC** | | | | |
| 0,640 % fällig am 20.07.2030 | € | 6.943 | 7.153 | 0,44 |
| **Ares European CLO DAC** | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.10.2030 | | 5.590 | 5.739 | 0,36 |
| **Argent Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,104 % fällig am 25.05.2035 | $ | 2.659 | 2.389 | 0,15 |
| **Argent Securities Trust** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.07.2036 | | 5.226 | 4.629 | 0,29 |
| 2,004 % fällig am 25.03.2036 | | 4.802 | 4.443 | 0,28 |
| **Armada Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.07.2031 | € | 2.400 | 2.445 | 0,15 |
| **Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,844 % fällig am 25.12.2036 | $ | 4.731 | 4.285 | 0,27 |
| 2,124 % fällig am 25.03.2036 | | 1.593 | 1.393 | 0,09 |
| 2,854 % fällig am 25.02.2035 | | 946 | 912 | 0,06 |
| **Attentus CDO Ltd.** | | | | |
| 1,439 % fällig am 11.10.2042 | | 10.120 | 8.931 | 0,56 |
| **Bain Capital Euro DAC** | | | | |
| 0,740 % fällig am 20.01.2032 | € | 5.300 | 5.377 | 0,33 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,104 % fällig am 25.07.2036 | $ | 652 | 644 | 0,04 |
| 2,164 % fällig am 25.04.2036 | | 2.128 | 2.115 | 0,13 |
| 2,674 % fällig am 25.08.2037 | | 8.744 | 8.058 | 0,50 |
| 2,704 % fällig am 25.12.2035 | | 1.677 | 1.385 | 0,09 |
| 2,824 % fällig am 25.01.2045 | | 84 | 84 | 0,01 |
| 3,499 % fällig am 25.07.2034 | | 166 | 160 | 0,01 |
| **Blackrock European CLO DAC** | | | | |
| 0,620 % fällig am 15.10.2031 | € | 1.700 | 1.719 | 0,11 |
| **BlueMountain Fuji EUR CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 15.07.2030 | € | 3.360 | $ 3.459 | 0,22 |
| **Cairn CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 20.10.2028 | | 1.198 | 1.245 | 0,08 |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | | 1.700 | 1.732 | 0,11 |
| **Capitalsource Real Estate Loan Trust** | | | | |
| 1,639 % fällig am 20.01.2037 | $ | 821 | 773 | 0,05 |
| 1,739 % fällig am 20.01.2037 | | 350 | 321 | 0,02 |
| 1,839 % fällig am 20.01.2037 | | 200 | 114 | 0,01 |
| **Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC** | | | | |
| 2,540 % fällig am 21.10.2028 | £ | 11.400 | 13.798 | 0,86 |
| 2,890 % fällig am 21.10.2028 | | 3.200 | 3.859 | 0,24 |
| 3,840 % fällig am 21.10.2028 | | 8.775 | 10.170 | 0,63 |
| **Carlyle Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,700 % fällig am 15.01.2031 | € | 2.200 | 2.247 | 0,14 |
| **Castlelake Aircraft Securitization Trust** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.06.2043 | $ | 2.585 | 2.327 | 0,14 |
| **CBAM CLO Ltd.** | | | | |
| 2,064 % fällig am 17.04.2031 | | 1.500 | 1.473 | 0,09 |
| **Centex Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,104 % fällig am 25.06.2036 | | 1.300 | 1.248 | 0,08 |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,124 % fällig am 25.10.2037 | | 880 | 824 | 0,05 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.12.2036 | | 3.540 | 2.039 | 0,13 |
| 2,224 % fällig am 25.03.2037 | | 274 | 275 | 0,02 |
| **Conseco Finance Corp.** | | | | |
| 6,920 % fällig am 01.12.2030 | | 2.887 | 2.955 | 0,18 |
| **Contego CLO DAC** | | | | |
| 0,640 % fällig am 23.01.2030 | € | 4.196 | 4.312 | 0,27 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 2,124 % fällig am 25.01.2046 ^ | $ | 6.641 | 6.265 | 0,39 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 6.233 | 5.695 | 0,35 |
| 1,774 % fällig am 25.04.2047 ^ | | 133 | 132 | 0,01 |
| 1,774 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 59 | 59 | 0,00 |
| 1,814 % fällig am 25.11.2037 | | 42 | 42 | 0,00 |
| 1,844 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 2.459 | 2.527 | 0,16 |
| 1,844 % fällig am 25.09.2047 ^ | | 1.154 | 1.115 | 0,07 |
| 1,854 % fällig am 25.05.2037 | | 4.974 | 4.702 | 0,29 |
| 1,914 % fällig am 25.10.2047 | | 10.000 | 9.040 | 0,56 |
| 1,924 % fällig am 25.03.2047 ^ | | 4.382 | 4.300 | 0,27 |
| 2,324 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 2.110 | 1.894 | 0,12 |
| 2,599 % fällig am 25.01.2036 | | 76 | 74 | 0,00 |
| 5,633 % fällig am 25.06.2035 | | 92 | 80 | 0,00 |
| 5,859 % fällig am 25.10.2046 ^ | | 19 | 19 | 0,00 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.** | | | | |
| 2,599 % fällig am 25.10.2034 | | 84 | 82 | 0,01 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.05.2036 | | 2.278 | 1.604 | 0,10 |
| 2,404 % fällig am 25.03.2034 | | 343 | 334 | 0,02 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,569 % fällig am 25.02.2037 | | 3.180 | 2.167 | 0,13 |
| **CVC Cordatus Loan Fund DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 15.10.2031 | € | 2.500 | 2.551 | 0,16 |
| **Dryden Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.04.2033 | | 2.100 | 2.130 | 0,13 |
| **ECMC Group Student Loan Trust** | | | | |
| 2,674 % fällig am 25.05.2067 | $ | 1.210 | 1.185 | 0,07 |
| **Euro-Galaxy CLO DAC** | | | | |
| 0,620 % fällig am 24.04.2034 | € | 1.400 | 1.427 | 0,09 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,744 % fällig am 25.11.2036 | $ | 8.188 | 7.618 | 0,47 |
| 1,784 % fällig am 25.11.2036 | | 3.531 | 3.478 | 0,22 |
| 1,934 % fällig am 25.09.2036 | | 6.462 | 6.041 | 0,38 |
| 2,284 % fällig am 25.01.2036 | | 708 | 702 | 0,04 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 1,864 % fällig am 25.08.2036 | | 4.238 | 1.574 | 0,10 |
| 1,904 % fällig am 25.02.2037 | | 6.456 | 5.097 | 0,32 |
| 2,554 % fällig am 25.07.2035 | | 4.000 | 3.391 | 0,21 |
| **Goodgreen Trust** | | | | |
| 3,930 % fällig am 15.10.2053 | | 3.394 | 3.205 | 0,20 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | | |
| 2,084 % fällig am 25.04.2047 | | 3.982 | 2.206 | 0,14 |
| 2,344 % fällig am 25.10.2035 | | 1.948 | 1.720 | 0,11 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **GSAMP Trust** | | | | |
| 1,894 % fällig am 25.03.2047 | $ | 749 | $ 721 | 0,04 |
| 2,509 % fällig am 25.07.2045 ^ | | 6.976 | 6.667 | 0,41 |
| **Harley Marine Financing LLC** | | | | |
| 5,682 % fällig am 15.05.2043 | | 1.308 | 1.259 | 0,08 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | € | 48 | 50 | 0,00 |
| 0,640 % fällig am 15.10.2031 | | 7.700 | 7.863 | 0,49 |
| 0,680 % fällig am 20.10.2031 | | 2.500 | 2.551 | 0,16 |
| 0,760 % fällig am 15.07.2031 | | 5.000 | 5.034 | 0,31 |
| 1,040 % fällig am 15.07.2031 | | 800 | 793 | 0,05 |
| 1,600 % fällig am 15.10.2031 | | 5.000 | 4.688 | 0,29 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.08.2036 | $ | 1.555 | 1.539 | 0,10 |
| 2,104 % fällig am 25.08.2037 | | 1.004 | 980 | 0,06 |
| 2,299 % fällig am 25.02.2036 | | 1.147 | 1.116 | 0,07 |
| 2,914 % fällig am 25.08.2033 | | 403 | 395 | 0,02 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | |
| 1,864 % fällig am 25.04.2037 | | 7.126 | 4.952 | 0,31 |
| 2,104 % fällig am 25.08.2036 | | 6.200 | 5.655 | 0,35 |
| 2,374 % fällig am 25.10.2035 | | 1.287 | 1.254 | 0,08 |
| 2,869 % fällig am 25.03.2035 | | 2.900 | 2.857 | 0,18 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.12.2036 | | 9.566 | 8.271 | 0,51 |
| 1,874 % fällig am 25.05.2037 | | 4.600 | 4.420 | 0,28 |
| **Invesco Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 15.07.2031 | € | 900 | 913 | 0,06 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.** | | | | |
| 2,164 % fällig am 25.03.2036 | $ | 6.153 | 5.863 | 0,36 |
| 2,269 % fällig am 25.10.2035 | | 4.900 | 4.527 | 0,28 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 1,744 % fällig am 25.12.2036 | | 6.207 | 3.618 | 0,23 |
| 2,029 % fällig am 25.07.2036 | | 8.195 | 7.943 | 0,49 |
| 2,104 % fällig am 25.11.2036 | | 208 | 179 | 0,01 |
| **Jubilee CLO DAC** | | | | |
| 0,391 % fällig am 12.07.2028 | € | 56 | 59 | 0,00 |
| 0,600 % fällig am 15.04.2030 | | 500 | 515 | 0,03 |
| 0,610 % fällig am 15.04.2030 | | 1.300 | 1.343 | 0,08 |
| 0,650 % fällig am 15.04.2031 | | 2.900 | 2.951 | 0,18 |
| **KKR CLO Ltd.** | | | | |
| 2,444 % fällig am 15.04.2031 | $ | 10.800 | 10.312 | 0,64 |
| **Laurelin DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 20.10.2031 | € | 6.000 | 6.147 | 0,38 |
| 1,800 % fällig am 20.10.2031 | | 3.500 | 3.288 | 0,20 |
| **LCM LP** | | | | |
| 2,103 % fällig am 20.10.2027 | $ | 396 | 394 | 0,02 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 1,426 % fällig am 25.06.2046 | | 3.481 | 3.236 | 0,20 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.10.2036 | | 22.961 | 8.390 | 0,52 |
| 2,224 % fällig am 25.02.2036 | | 147 | 126 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.08.2033 | | 221 | 219 | 0,01 |
| **Madison Park Euro Funding DAC** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.01.2032 | € | 19.600 | 19.841 | 1,23 |
| **Man GLG Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,680 % fällig am 15.10.2030 | | 4.083 | 4.183 | 0,26 |
| 1,680 % fällig am 15.12.2031 | | 4.700 | 4.435 | 0,28 |
| 1,700 % fällig am 15.10.2030 | | 5.000 | 4.783 | 0,30 |
| **MAPS Ltd.** | | | | |
| 4,212 % fällig am 15.05.2043 | $ | 2.526 | 2.344 | 0,15 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,194 % fällig am 25.01.2036 | | 2.857 | 2.800 | 0,17 |
| 2,204 % fällig am 25.12.2035 | | 345 | 343 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 1,769 % fällig am 25.08.2037 | $ | 2.542 | $ 2.348 | 0,15 |
| 2,224 % fällig am 25.12.2036 | | 2.850 | 2.680 | 0,17 |
| 2,704 % fällig am 25.10.2035 | | 600 | 589 | 0,04 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.10.2036 | | 1.063 | 541 | 0,03 |
| 1,874 % fällig am 25.07.2036 | | 10.578 | 8.986 | 0,56 |
| 1,924 % fällig am 25.07.2036 | | 3.595 | 1.545 | 0,10 |
| 2,124 % fällig am 25.07.2036 | | 3.595 | 1.564 | 0,10 |
| 2,194 % fällig am 25.12.2035 | | 6.879 | 5.717 | 0,36 |
| 2,224 % fällig am 25.12.2035 | | 4.900 | 4.577 | 0,28 |
| 2,419 % fällig am 25.01.2035 | | 848 | 807 | 0,05 |
| **Morgan Stanley Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 2,204 % fällig am 25.01.2036 | | 2.212 | 2.147 | 0,13 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,724 % fällig am 25.04.2037 | | 149 | 86 | 0,01 |
| **Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.07.2036 | | 3.683 | 1.675 | 0,10 |
| **National Collegiate Student Loan Trust** | | | | |
| 1,934 % fällig am 25.05.2032 | | 3.141 | 2.971 | 0,18 |
| **Navient Private Education Loan Trust** | | | | |
| 2,650 % fällig am 15.12.2028 | | 101 | 101 | 0,01 |
| 2,740 % fällig am 15.02.2029 | | 9 | 9 | 0,00 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,794 % fällig am 25.06.2035 | | 2.000 | 1.903 | 0,12 |
| **Oak Hill European Credit Partners DAC** | | | | |
| 0,730 % fällig am 20.01.2032 | € | 1.499 | 1.540 | 0,10 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.03.2037 | $ | 5.387 | 4.920 | 0,31 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,359 % fällig am 25.09.2035 | | 3.642 | 3.551 | 0,22 |
| 2,404 % fällig am 25.09.2035 | | 7.700 | 7.049 | 0,44 |
| 3,199 % fällig am 25.02.2035 | | 430 | 423 | 0,03 |
| 3,274 % fällig am 25.12.2034 | | 859 | 870 | 0,05 |
| 3,499 % fällig am 25.09.2034 | | 920 | 905 | 0,06 |
| **Pepper SPARKZ Trust** | | | | |
| 2,085 % fällig am 17.08.2028 | AUD | 1.424 | 978 | 0,06 |
| **Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 1,874 % fällig am 25.06.2047 ^ | $ | 57 | 57 | 0,00 |
| 1,954 % fällig am 25.07.2036 | | 2.901 | 2.786 | 0,17 |
| 2,164 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 444 | 408 | 0,03 |
| 2,209 % fällig am 25.02.2036 | | 1.127 | 1.116 | 0,07 |
| **Pretium Mortgage Credit Partners LLC** | | | | |
| 2,240 % fällig am 27.09.2060 | | 3.695 | 3.514 | 0,22 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 5,608 % fällig am 25.05.2036 | | 6.044 | 3.306 | 0,21 |
| 5,746 % fällig am 25.05.2036 | | 1.376 | 770 | 0,05 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | | |
| 2,164 % fällig am 25.02.2036 | | 200 | 190 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.08.2035 | | 2.663 | 2.613 | 0,16 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 1,844 % fällig am 25.02.2037 | | 7.590 | 7.135 | 0,44 |
| 1,864 % fällig am 25.10.2036 | | 2.307 | 2.218 | 0,14 |
| 1,884 % fällig am 25.07.2036 | | 1.057 | 1.050 | 0,07 |
| 2,059 % fällig am 25.06.2036 | | 1.400 | 1.314 | 0,08 |
| 2,314 % fällig am 25.11.2035 | | 788 | 775 | 0,05 |
| 2,404 % fällig am 25.06.2034 | | 797 | 778 | 0,05 |
| 2,569 % fällig am 25.05.2035 | | 309 | 308 | 0,02 |
| 2,659 % fällig am 25.08.2035 | | 2.131 | 2.041 | 0,13 |
| **Sapphire Aviation Finance Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.03.2040 | | 6.794 | 5.680 | 0,35 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 1,744 % fällig am 25.09.2036 | | 2.354 | 1.717 | 0,11 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Segovia European CLO DAC** | | | | |
| 0,880 % fällig am 20.07.2032 | € | 7.400 | $ 7.519 | 0,47 |
| **SLC Student Loan Trust** | | | | |
| 1,939 % fällig am 15.03.2027 | $ | 81 | 81 | 0,01 |
| **SLM Private Credit Student Loan Trust** | | | | |
| 2,099 % fällig am 15.12.2039 | | 2.121 | 2.020 | 0,13 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 3,029 % fällig am 15.12.2033 | | 2.574 | 2.469 | 0,15 |
| **SMB Private Education Loan Trust** | | | | |
| 2,474 % fällig am 15.09.2054 | | 9.170 | 8.970 | 0,56 |
| **SoFi Professional Loan Program LLC** | | | | |
| 2,650 % fällig am 25.09.2040 | | 65 | 64 | 0,00 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.07.2036 | | 2.860 | 2.736 | 0,17 |
| 1,794 % fällig am 25.07.2037 | | 6.306 | 5.600 | 0,35 |
| 1,794 % fällig am 25.08.2037 | | 6.980 | 6.181 | 0,38 |
| 2,314 % fällig am 25.12.2035 | | 4.500 | 4.199 | 0,26 |
| 2,524 % fällig am 25.10.2037 | | 7.443 | 5.858 | 0,36 |
| 2,614 % fällig am 25.06.2035 | | 744 | 729 | 0,05 |
| 2,924 % fällig am 25.10.2037 | | 5.869 | 4.712 | 0,29 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 2,224 % fällig am 25.04.2036 | | 11.400 | 6.441 | 0,40 |
| 2,524 % fällig am 25.05.2035 | | 3.631 | 3.582 | 0,22 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,754 % fällig am 25.05.2036 | | 383 | 369 | 0,02 |
| 1,934 % fällig am 25.08.2046 | | 4.429 | 4.183 | 0,26 |
| 2,749 % fällig am 25.04.2035 | | 99 | 97 | 0,01 |
| **Taberna Preferred Funding Ltd.** | | | | |
| 1,432 % fällig am 05.07.2035 | | 270 | 245 | 0,02 |
| 1,703 % fällig am 05.05.2038 | | 6.001 | 5.702 | 0,35 |
| **Terwin Mortgage Trust** | | | | |
| 2,569 % fällig am 25.06.2036 | | 200 | 190 | 0,01 |
| **Thunderbolt Aircraft Lease Ltd.** | | | | |
| 4,147 % fällig am 15.09.2038 | | 8.123 | 7.174 | 0,45 |
| **TruPS Financials Note Securitization Ltd.** | | | | |
| 3,666 % fällig am 20.09.2039 | | 3.793 | 3.584 | 0,22 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | |
| 1,924 % fällig am 15.04.2027 | | 2.991 | 2.959 | 0,18 |
| 2,113 % fällig am 20.07.2030 | | 10.000 | 9.880 | 0,61 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.07.2036 | | 4.946 | 4.606 | 0,29 |
| 2,044 % fällig am 25.03.2037 | | 1.441 | 1.402 | 0,09 |
| 2,134 % fällig am 25.05.2036 | | 4.000 | 3.826 | 0,24 |
| | | | 580.460 | 36,12 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **U.S. TREASURY BILLS** | | | | |
| 2,106 % fällig am 25.10.2022 (c)(d) | | 2.200 | 2.186 | 0,14 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 2.186 | 0,14 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **2.941.565** | **183,02** |
| | | **AKTIEN** | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)** | | 333.337 | 3.316 | 0,21 |
| **Summe Investmentfonds** | | | **$3.316** | **0,21** |

**PENSIONSGESCHÄFTE**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 1.042 | U,S, Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | $ (1.063) | $ 1.042 | $ 1.042 | 0,06 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (1.063)** | **$ 1.042** | **$ 1.042** | **0,06** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

### FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 90-Day Eurodollar December Futures | Short | 12.2022 | 555 | $ 4.650 | 0,29 |
| 90-Day Eurodollar March Futures | Short | 03.2023 | 365 | 2.983 | 0,19 |
| 90-Day Eurodollar September Futures | Short | 09.2022 | 555 | 4.008 | 0,25 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 1.073 | 1.504 | 0,09 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 3.341 | 2.474 | 0,15 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 618 | (1.029) | (0,06) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 174 | 164 | 0,01 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2022 | 27 | 121 | 0,01 |
| | | | | $ 14.875 | 0,93 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 14.875** | **0,93** |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

### ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt[1] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 % | 21.09.2052 | £ 500 | $ 91 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 0,100 | 13.01.2023 | $ 929.600 | 14.451 | 0,90 |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 0,200 | 29.04.2023 | 119.500 | 2.861 | 0,18 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2029 | 51.800 | (611) | (0,04) |
| Erhalt[1] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,560 | 29.03.2024 | 92.400 | 538 | 0,03 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,705 | 16.06.2024 | 890 | 1 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,400 | 30.03.2026 | 400 | 36 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,500 | 16.06.2028 | 39.000 | (3.538) | (0,22) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,500 | 16.06.2028 | 108.300 | (9.430) | (0,59) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,750 | 16.12.2022 | 29.700 | (604) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,080 | 22.10.2026 | 91.500 | (7.123) | (0,44) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,400 | 05.04.2025 | 114.200 | 5.067 | 0,32 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 04.05.2025 | 73.000 | 3.132 | 0,19 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 15.12.2028 | 235.300 | (22.877) | (1,42) |
| Zahlung[1] | 3-Month USD-LIBOR | 1,990 | 30.11.2024 | 65.600 | 1.667 | 0,10 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 18.12.2022 | 54.200 | (744) | (0,05) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,924 | 02.07.2028 | 45.300 | 225 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,987 | 12.06.2028 | 22.500 | (52) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,113 | 21.11.2028 | 5.800 | 34 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,142 | 20.11.2028 | 16.700 | 129 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,177 | 01.11.2028 | 12.700 | 135 | 0,01 |
| Erhalt[1] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | € 15.900 | 1.557 | 0,10 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 18.03.2050 | 2.400 | 821 | 0,05 |
| | | | | | $ (14.234) | (0,89) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (14.234)** | **(0,89)** |

[1] Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

### OPTIONSKAUF

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,960 % | 07.07.2022 | 40.800 | $ 420 | $ 48 | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,957 | 22.07.2022 | 23.800 | 328 | 138 | 0,01 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,770 | 04.08.2022 | 10.500 | 97 | 162 | 0,01 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,880 | 04.08.2022 | 21.700 | 282 | 237 | 0,01 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,043 | 04.08.2022 | 2.400 | 27 | 15 | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,800 | 14.09.2022 | 50.100 | 526 | 909 | 0,06 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,500 | 14.09.2022 | 50.100 | 526 | 177 | 0,01 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,500 | 08.06.2023 | 4.800 | 19 | 24 | 0,00 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,023 | 29.06.2023 | 34.890 | 1.856 | 5.129 | 0,32 |
| BPS | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,950 | 22.07.2022 | 23.800 | 334 | 143 | 0,01 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,500 | 05.02.2024 | 76.000 | 509 | 1.725 | 0,11 |

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Kosten | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,400 % | 19.05.2027 | 13.900 | $ 79 | $ 97 | 0,01 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,073 | 07.07.2022 | 12.700 | 128 | 4 | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,121 | 07.07.2022 | 12.700 | 132 | 2 | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,500 | 09.02.2024 | 24.700 | 179 | 564 | 0,03 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,500 | 20.02.2024 | 61.000 | 530 | 1.407 | 0,09 |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,034 | 28.02.2023 | 57.500 | 362 | 1.147 | 0,07 |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,880 | 01.03.2023 | 18.400 | 114 | 410 | 0,03 |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,933 | 01.03.2023 | 57.500 | 362 | 1.233 | 0,08 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,380 | 06.04.2023 | 7.100 | 150 | 141 | 0,01 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,285 | 14.04.2023 | 7.000 | 166 | 165 | 0,01 |
| DUB | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,955 | 14.09.2022 | 50.100 | 559 | 1.289 | 0,08 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,655 | 14.09.2022 | 50.100 | 559 | 118 | 0,01 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,500 | 07.02.2024 | 77.500 | 554 | 1.765 | 0,11 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,500 | 28.02.2024 | 35.500 | 288 | 826 | 0,05 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,500 | 04.03.2024 | 35.500 | 259 | 830 | 0,05 |
| GLM | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,400 | 19.05.2027 | 20.000 | 107 | 140 | 0,01 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,128 | 07.07.2022 | 12.700 | 132 | 2 | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,046 | 28.09.2022 | 36.000 | 312 | 460 | 0,03 |
| MYC | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,898 | 04.08.2022 | 18.200 | 236 | 188 | 0,01 |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,998 | 07.03.2023 | 56.100 | 406 | 1.146 | 0,07 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,348 | 13.04.2023 | 7.000 | 140 | 149 | 0,01 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,225 | 20.04.2023 | 6.800 | 166 | 179 | 0,01 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,273 | 20.04.2023 | 6.800 | 151 | 166 | 0,01 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,200 | 21.04.2023 | 7.500 | 220 | 206 | 0,01 |
| | | | | | | | $ 11.215 | $ 21.341 | 1,33 |

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01/08/2052 | $ 91,797 | 04.08.2022 | 74.000 | $ 347 | $ 43 | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01/09/2052 | 91,875 | 07.09.2022 | 72.000 | 506 | 131 | 0,01 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2052 | 94,313 | 04.08.2022 | 74.000 | 306 | 46 | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2052 | 94,547 | 04.08.2022 | 72.000 | 281 | 51 | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2052 | 95,859 | 04.08.2022 | 95.000 | 267 | 144 | 0,01 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2052 | 96,453 | 04.08.2022 | 198.000 | 681 | 108 | 0,01 |
| JPM | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.07.2052 | 113,000 | 07.07.2022 | 156.000 | 6 | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2052 | 114,000 | 04.08.2022 | 64.000 | 2 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.07.2052 | 68,000 | 07.07.2022 | 41.000 | 2 | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | 114,000 | 07.09.2022 | 75.000 | 3 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01/08/2052 | 70,000 | 04.08.2022 | 40.000 | 2 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01/08/2052 | 77,000 | 04.08.2022 | 50.000 | 2 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2052 | 99,422 | 04.08.2022 | 42.500 | 850 | 555 | 0,03 |
| SAL | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2052 | 125,000 | 04.08.2022 | 66.000 | 3 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.07.2052 | 70,000 | 07.07.2022 | 50.000 | 2 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01/08/2052 | 75,000 | 04.08.2022 | 70.000 | 3 | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ 3.263 | $ 1.078 | 0,06 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,230 % | 04.08.2022 | 47.500 | $ (238) | $ (151) | (0,01) |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,481 | 04.08.2022 | 34.600 | (277) | (44) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,483 | 04.08.2022 | 79.800 | (682) | (101) | (0,01) |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,491 | 04.08.2022 | 42.400 | (326) | (52) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,490 | 07.09.2022 | 40.400 | (482) | (130) | (0,01) |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 0,021 | 29.06.2023 | 170.970 | (1.856) | (8.119) | (0,51) |
| BPS | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,911 | 04.08.2022 | 9.800 | (82) | (97) | (0,01) |
| CBK | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,534 | 28.02.2023 | 57.500 | (334) | (74) | (0,01) |
| | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,380 | 01.03.2023 | 18.400 | (106) | (19) | 0,00 |
| | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,433 | 01.03.2023 | 57.500 | (336) | (63) | 0,00 |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 06.04.2023 | 39.600 | (150) | (163) | (0,01) |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 14.04.2023 | 38.900 | (167) | (162) | (0,01) |
| DUB | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,074 | 04.08.2022 | 9.800 | (77) | (55) | 0,00 |
| GLM | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,996 | 28.09.2022 | 20.000 | (292) | (37) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,498 | 04.08.2022 | 42.400 | (337) | (51) | 0,00 |
| | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,498 | 07.03.2023 | 56.100 | (381) | (72) | 0,00 |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 13.04.2023 | 38.900 | (140) | (161) | (0,01) |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 4,000 | 20.04.2023 | 75.200 | (316) | (245) | (0,02) |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 4,000 | 21.04.2023 | 41.500 | (221) | (136) | (0,01) |
| | | | | | | | $ (6.800 ) | $ (9.932 ) | (0,62) |

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | $ 92,703 | 07.09.2022 | 50.500 | $ (584) | $ (693) | (0,04) |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | 93,563 | 07.09.2022 | 4.000 | (30) | (38) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | 94,438 | 07.09.2022 | 4.000 | (23) | (24) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | 94,703 | 07.09.2022 | 3.500 | (23) | (18) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 98,297 | 07.07.2022 | 1.500 | (9) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 99,141 | 07.07.2022 | 3.500 | (24) | (22) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2052 | 99,828 | 04.08.2022 | 46.500 | (247) | (238) | (0,02) |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2052 | 100,313 | 04.08.2022 | 21.000 | (66) | (150) | (0,01) |
| JPM | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | 92,773 | 07.09.2022 | 6.000 | (69) | (80) | (0,01) |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01/08/2052 | 96,906 | 04.08.2022 | 1.500 | (7) | (19) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 99,008 | 07.07.2022 | 63.500 | (635) | (331) | (0,02) |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 99,508 | 07.07.2022 | 63.500 | (794) | (595) | (0,04) |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2052 | 98,422 | 04.08.2022 | 42.500 | (544) | (316) | (0,02) |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2052 | 98,922 | 04.08.2022 | 42.500 | (681) | (423) | (0,03) |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2052 | 99,906 | 04.08.2022 | 9.500 | (50) | (51) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,141 | 07.09.2022 | 1.500 | (6) | (10) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,156 | 07.09.2022 | 3.000 | (11) | (20) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,656 | 07.09.2022 | 6.000 | (22) | (50) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 101,141 | 07.09.2022 | 1.500 | (4) | (6) | 0,00 |
| MSC | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.09.2052 | 91,359 | 07.09.2022 | 1.500 | (10) | (7) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2052 | 95,453 | 04.08.2022 | 37.000 | (257) | (40) | 0,00 |
| SAL | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | 91,375 | 07.09.2022 | 56.500 | (742) | (1.253) | (0,08) |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | 94,688 | 07.09.2022 | 2.500 | (15) | (13) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 98,078 | 07.07.2022 | 48.000 | (334) | (49) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 100,289 | 07.07.2022 | 1.500 | (7) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 99,281 | 07.07.2022 | 22.000 | (100) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 99,305 | 07.07.2022 | 22.000 | (100) | (6) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 99,344 | 07.07.2022 | 22.000 | (97) | (6) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 99,563 | 07.07.2022 | 1.500 | (8) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 100,281 | 07.07.2022 | 3.500 | (17) | (8) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2052 | 99,281 | 04.08.2022 | 5.000 | (24) | (17) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2052 | 99,844 | 04.08.2022 | 14.000 | (74) | (72) | (0,01) |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2052 | 99,906 | 04.08.2022 | 24.500 | (63) | (133) | (0,01) |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2052 | 101,281 | 04.08.2022 | 5.000 | (16) | (10) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2052 | 101,844 | 04.08.2022 | 14.000 | (50) | (13) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,406 | 07.09.2022 | 1.500 | (5) | (11) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,656 | 07.09.2022 | 2.000 | (8) | (17) | 0,00 |
| | | | | | $ (5.756) | $ (4.747) | (0,29) |

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| DUB | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 % | 17.11.2059 | $ 1.100 | $ (26) | $ 22 | $ (4) | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.9 Index | 0,500 | 17.09.2058 | 5.978 | (86) | 81 | (5) | 0,00 |
| FBF | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18.11.2054 | 8.200 | (42) | (12) | (54) | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 600 | (4) | (3) | (7) | 0,00 |
| GST | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 7.100 | (3) | (23) | (26) | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18.11.2054 | 12.000 | 60 | (140) | (80) | (0,01) |
| | CMBX.NA.AAA.13 Index | 0,500 | 16.12.2072 | 22.100 | (27) | (366) | (393) | (0,02) |
| JPS | CMBX.NA.AAA.15 Index | 0,500 | 18.11.2064 | 91.800 | (1.406) | (1.505) | (2.911) | (0,18) |
| MYC | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 30.000 | (82) | (26) | (108) | (0,01) |
| | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18.11.2054 | 40.100 | (343) | 76 | (267) | (0,02) |
| SAL | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18.11.2054 | 70.900 | (599) | 128 | (471) | (0,03) |
| | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 1.600 | (3) | (14) | (17) | 0,00 |
| | | | | | $ (2.561) | $ (1.782) | $ (4.343) | (0,27) |

(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 | 07.2022 | £ 322 | $ 393 | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | € 754 | 800 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ 140.299 | 176.749 | 6.363 | 0 | 6.363 | 0,40 |
| | 07.2022 | $ 1.314 | € 1.253 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07.2022 | 1.627 | £ 1.344 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | 2.888 | 2.389 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | 07.2022 | € 153.579 | $ 164.895 | $ 4.336 | $ 0 | $ 4.336 | 0,27 |
| HUS | 07.2022 | AUD 1.280 | 924 | 44 | 0 | 44 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | $ 73 | £ 60 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 10.774 | $ (4) | $ 10.770 | 0,67 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | CAD 568 | $ 439 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | 355 | 279 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ 6.580 | CAD 8.353 | 0 | (104) | (104) | (0,01) |
| HUS | 07.2022 | 6.487 | 8.221 | 0 | (114) | (114) | (0,01) |
| SCX | 07.2022 | 6.487 | 8.206 | 0 | (125) | (125) | (0,01) |
| | | | | $ 3 | $ (344) | $ (341) | (0,02) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | CHF 90 | $ 91 | $ 0 | $ (4) | $ (4) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 1.483 | CHF 1.417 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CHF 98 | $ 101 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 18 | CHF 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | 1.452 | 1.390 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | CHF 1.264 | $ 1.331 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 1.422 | CHF 1.364 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | 1.331 | 1.262 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | CHF 24 | $ 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 110 | 115 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | 56 | 57 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | $ 13 | $ (19) | $ (6) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | € 32 | $ 34 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 22 | € 20 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | € 141.025 | $ 148.603 | 1.170 | 0 | 1.170 | 0,07 |
| | 07.2022 | $ 3.029 | € 2.862 | 0 | (36) | (36) | 0,00 |
| | 08.2022 | 123.362 | 117.073 | 0 | (744) | (744) | (0,05) |
| CBK | 07.2022 | € 626 | $ 668 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 1.157 | € 1.077 | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| HUS | 07.2022 | € 118.884 | $ 125.069 | 782 | (1) | 781 | 0,05 |
| | 07.2022 | $ 133.309 | € 123.648 | 0 | (4.040) | (4.040) | (0,25) |
| | 08.2022 | 123.384 | 117.073 | 0 | (765) | (765) | (0,05) |
| SCX | 07.2022 | 119.155 | 111.235 | 0 | (2.865) | (2.865) | (0,18) |
| UAG | 07.2022 | 132.036 | 122.870 | 0 | (3.582) | (3.582) | (0,22) |
| | | | | $ 1.966 | $ (12.064) | $ (10.098) | (0,63) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | $ 167.343 | £ 132.352 | $ 0 | $ (6.609) | $ (6.609) | (0,41) |
| BPS | 07.2022 | £ 7.656 | $ 9.266 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 2.813 | £ 2.234 | 0 | (100) | (100) | (0,01) |
| BRC | 07.2022 | £ 20 | $ 24 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 168.039 | £ 133.276 | 0 | (6.182) | (6.182) | (0,38) |
| CBK | 07.2022 | £ 851 | $ 1.069 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| HUS | 07.2022 | 1.095 | 1.342 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | 4.551 | 5.498 | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 40 | 49 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | $ 166.275 | £ 131.889 | 0 | (6.103) | (6.103) | (0,38) |
| | | | | $ 48 | $ (19.054) | $ (19.006) | (1,18) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Class E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | SGD | 160 | $ | 115 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 246 | SGD | 337 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 115 | | 160 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | SGD | 320 | $ | 231 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 231 | SGD | 320 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| HUS | 07.2022 | SGD | 7 | $ | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 10 | SGD | 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | | 3 | | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 255 | | 348 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | SGD | 40 | $ | 29 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 264 | SGD | 361 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | | | | | | $ 0 | $ (13) | $ (13) | 0,00 |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **$ (15.297)** | **(0,95)** |

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Ginnie Mae, TBA** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.07.2052 | $ 8.900 | $ (7.906) | (0,49) |
| 4,000 % fällig am 01.07.2052 (h) | 17.500 | (17.428) | (1,09) |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | |
| 1,500 % fällig am 01.07.2037 | 5.000 | (4.548) | (0,28) |
| 2,000 % fällig am 01.07.2037 | 40.900 | (38.187) | (2,38) |
| 2,000 % fällig am 01.08.2052 | 460.050 | (398.950) | (24,82) |
| 2,500 % fällig am 01.07.2037 | 400 | (382) | (0,02) |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 | 200.628 | (180.487) | (11,23) |
| 2,500 % fällig am 14.07.2052 | 138.272 | (124.391) | (7,74) |
| 3,000 % fällig am 01.07.2052 (h) | 6.500 | (6.056) | (0,38) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (778.335)** | **(48,43)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 2.152.932** | **133,95** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (545.662)** | **(33,95)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 1.607.270** | **100,00** |

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

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

**^ Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

**(b) Reines Kapitalwertpapier.**

**(c) Nullkuponwertpapier.**

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

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

**(f) Mit dem Fonds verbunden.**

**(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(h) Zum 30. Dezember 2022 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren abgedeckt.**

**(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 459.475 und Barmittel in Höhe von USD 4.416 als Sicherheiten verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von USD 10.709 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 38.370 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 2.940.306 | $ 1.259 | $ 2.941.565 |
| Investmentfonds | 3.316 | 0 | 0 | 3.316 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 1.042 | 0 | 1.042 |
| Finanzderivate[3] | 0 | (14.656) | 0 | (14.656) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (778.335) | 0 | (778.335) |
| **Summen** | **$ 3.316** | **$ 2.148.357** | **$ 1.259** | **$ 2.152.932** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 2.953.139 | $ 1.459 | $ 2.954.598 |
| Investmentfonds | 93.049 | 0 | 0 | 93.049 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 2.125 | 0 | 2.125 |
| Finanzderivate[3] | 1.373 | 35.920 | 0 | 37.293 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (640.730) | 0 | (640.730) |
| **Summen** | **$ 94.422** | **$ 2.350.454** | **$ 1.459** | **$ 2.446.335** |

(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 2022:**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 1,300 % | 13.06.2022 | 14.07.2022 | $ (436.770) | $ (436.964) | (27,18) |
| | 1,300 | 15.06.2022 | 14.07.2022 | (14.740) | (14.749) | (0,92) |
| | 1,300 | 23.06.2022 | 14.07.2022 | (49.487) | (49.501) | (3,08) |
| BPS | 1,600 | 21.06.2022 | 14.07.2022 | (12.195) | (12.200) | (0,76) |
| | 1,630 | 27.06.2022 | 14.07.2022 | (8.187) | (8.188) | (0,51) |
| CSN | 1,590 | 27.06.2022 | 14.07.2022 | (21.855) | (21.859) | (1,36) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (543.461)** | **(33,81)** |

**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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ (1) | $ 0 | $ (1) |
| BOA | (9.140) | 9.630 | 490 |
| BPS | 8.404 | (8.780) | (376) |
| BRC | (6.169) | 5.750 | (419) |
| CBK | 9.044 | (9.200) | (156) |
| DUB | 4.767 | (4.860) | (93) |
| FBF | (61) | 0 | (61) |
| GLM | 565 | (720) | (155) |
| GST | (499) | 260 | (239) |
| HUS | (4.082) | 0 | (4.082) |
| JPM | (1.346) | 1.930 | 584 |
| JPS | (2.911) | 2.610 | (301) |
| MBC | 0 | 3.690 | 3.690 |
| MSC | (47) | 0 | (47) |
| MYC | 994 | (2.116) | (1.122) |
| MYI | (29) | (10) | (39) |
| SAL | (2.102) | 2.180 | 78 |
| SCX | (2.994) | 2.690 | (304) |
| TOR | (6.103) | 6.390 | 287 |
| UAG | (3.587) | 3.240 | (347) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 21,29 | 21,88 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 155,88 | 108,20 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 5,85 | 1,91 |
| Investmentfonds | 0,21 | 4,16 |
| Pensionsgeschäfte | 0,06 | 0,09 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,93 | 0,12 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,89) | 0,91 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (0,95) | 0,64 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (48,43) | (28,62) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (33,81) | (16,26) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 2,27 | 0,85 |
| Kommunalanleihen und Wechsel | 0,07 | 0,06 |
| US-Regierungsbehörden | 112,06 | 76,22 |
| US-Schatzobligationen | k. A. | 0,13 |
| Non-Agency-MBS | 32,36 | 26,71 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 36,12 | 28,02 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,14 | k. A. |
| Investmentfonds | 0,21 | 4,16 |
| Pensionsgeschäfte | 0,06 | 0,09 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,93 | 0,12 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Zinsswaps | (0,89) | 0,91 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoption | 1,33 | 0,28 |
| Optionen auf Wertpapiere | 0,06 | 0,15 |
| Verkaufte Optionen Zins-Swaptions | | |
| Zinsswapoption | (0,62) | (0,21) |
| Optionen auf Wertpapiere | (0,29) | (0,13) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | (0,27) | 0,06 |
| Zinsswaps | k. A. | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | 0,67 | (0,16) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (1,83) | 0,65 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (48,43) | (28,62) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (33,95) | (9,29) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | | |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | | |
| 2,450 % fällig am 29.10.2026 | $ | 3.350 | $ | 2.919 | 0,18 |
| **American Tower Corp.** | | | | | |
| 1,450 % fällig am 15.09.2026 | | 8.200 | | 7.178 | 0,44 |
| 3,800 % fällig am 15.08.2029 | | 1.305 | | 1.199 | 0,07 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | | |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | | 6.500 | | 6.025 | 0,37 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.12.2024 | | 1.200 | | 1.191 | 0,07 |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | | |
| 2,528 % fällig am 18.11.2027 | | 1.219 | | 995 | 0,06 |
| **Banco BTG Pactual S.A.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 10.01.2025 | | 400 | | 386 | 0,02 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (h) | | 3.300 | | 3.333 | 0,21 |
| **Barclays PLC** | | | | | |
| 2,791 % fällig am 16.05.2024 | | 2.100 | | 2.100 | 0,13 |
| 4,337 % fällig am 10.01.2028 | | 400 | | 383 | 0,02 |
| 4,972 % fällig am 16.05.2029 | | 400 | | 394 | 0,03 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (f)(h) | £ | 2.800 | | 3.352 | 0,21 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (f)(h) | $ | 600 | | 591 | 0,04 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | | |
| 1,323 % fällig am 13.01.2027 | | 900 | | 796 | 0,05 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | | |
| 4,625 % fällig am 29.12.2025 (f)(h) | € | 3.000 | | 2.892 | 0,18 |
| **Credit Suisse AG** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (h) | $ | 11.500 | | 11.529 | 0,71 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | | |
| 2,961 % fällig am 12.06.2024 | | 4.400 | | 4.407 | 0,27 |
| **Danske Bank A/S** | | | | | |
| 0,976 % fällig am 10.09.2025 | | 6.200 | | 5.714 | 0,35 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 17.02.2027 | € | 3.400 | | 3.147 | 0,20 |
| 1,375 % fällig am 17.02.2032 | | 15.000 | | 11.989 | 0,74 |
| 1,625 % fällig am 20.01.2027 | | 1.100 | | 1.031 | 0,06 |
| **Discover Bank** | | | | | |
| 4,650 % fällig am 13.09.2028 | $ | 3.300 | | 3.179 | 0,20 |
| **Equinix, Inc.** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 18.11.2024 | | 200 | | 192 | 0,01 |
| **GA Global Funding Trust** | | | | | |
| 2,148 % fällig am 11.04.2025 | | 6.800 | | 6.738 | 0,42 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.03.2024 | | 2.800 | | 2.765 | 0,17 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | | |
| 2,633 % fällig am 07.11.2025 | | 3.900 | | 3.723 | 0,23 |
| 2,848 % fällig am 04.06.2031 | | 1.600 | | 1.353 | 0,08 |
| 2,999 % fällig am 10.03.2026 | | 5.000 | | 4.765 | 0,30 |
| 4,292 % fällig am 12.09.2026 | | 828 | | 810 | 0,05 |
| 4,300 % fällig am 08.03.2026 | | 500 | | 496 | 0,03 |
| 4,950 % fällig am 31.03.2030 | | 700 | | 692 | 0,04 |
| 5,250 % fällig am 16.09.2022 (f)(h) | € | 1.300 | | 1.343 | 0,08 |
| 6,250 % fällig am 23.03.2023 (f)(h) | $ | 900 | | 884 | 0,06 |
| **Hyundai Capital Services, Inc.** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.09.2023 | | 6.300 | | 6.065 | 0,38 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | | |
| 3,511 % fällig am 18.03.2026 | | 5.300 | | 5.165 | 0,32 |
| 4,550 % fällig am 16.08.2028 | | 1.100 | | 1.076 | 0,07 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 13.05.2025 | € | 6.000 | | 5.992 | 0,37 |
| **Nationwide Building Society** | | | | | |
| 4,363 % fällig am 01.08.2024 | $ | 4.236 | | 4.242 | 0,26 |
| **NatWest Group PLC** | | | | | |
| 3,747 % fällig am 25.06.2024 | | 6.500 | | 6.508 | 0,40 |
| 4,269 % fällig am 22.03.2025 | | 1.322 | | 1.310 | 0,08 |
| 4,800 % fällig am 05.04.2026 | | 300 | | 299 | 0,02 |
| **Nissan Motor Acceptance Co. LLC** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 16.09.2024 | | 3.900 | | 3.587 | 0,22 |
| 2,600 % fällig am 28.09.2022 | | 1.200 | | 1.194 | 0,07 |
| **Nomura Holdings, Inc.** | | | | | |
| 1,851 % fällig am 16.07.2025 | | 2.900 | | 2.659 | 0,17 |
| 2,648 % fällig am 16.01.2025 | | 2.500 | | 2.388 | 0,15 |
| 2,679 % fällig am 16.07.2030 | | 2.300 | | 1.883 | 0,12 |
| **Santander Holdings USA, Inc.** | | | | | |
| 3,244 % fällig am 05.10.2026 | $ | 900 | $ | 845 | 0,05 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | | |
| 4,796 % fällig am 15.11.2024 | | 4.333 | | 4.335 | 0,27 |
| **SMBC Aviation Capital Finance DAC** | | | | | |
| 3,550 % fällig am 15.04.2024 | | 400 | | 390 | 0,02 |
| **Stellantis Finance U.S., Inc.** | | | | | |
| 1,711 % fällig am 29.01.2027 | | 300 | | 261 | 0,02 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | | |
| 2,130 % fällig am 08.07.2030 | | 5.900 | | 4.860 | 0,30 |
| **UBS AG** | | | | | |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (h) | | 500 | | 502 | 0,03 |
| **UBS Group AG** | | | | | |
| 1,364 % fällig am 30.01.2027 | | 2.200 | | 1.954 | 0,12 |
| 4,125 % fällig am 24.09.2025 | | 500 | | 497 | 0,03 |
| 4,375 % fällig am 10.02.2031 (f)(h) | | 1.200 | | 881 | 0,06 |
| **VICI Properties LP** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.02.2025 | | 400 | | 375 | 0,02 |
| 3,750 % fällig am 15.02.2027 | | 500 | | 441 | 0,03 |
| 4,125 % fällig am 15.08.2030 | | 500 | | 432 | 0,03 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | | |
| 2,879 % fällig am 30.10.2030 | | 1.400 | | 1.232 | 0,08 |
| **WPC Eurobond BV** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 09.04.2026 | € | 944 | | 929 | 0,06 |
| | | | | 158.793 | 9,83 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | | |
| **BAT International Finance PLC** | | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.06.2025 | $ | 141 | | 138 | 0,01 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | | |
| 2,450 % fällig am 15.02.2031 | | 1.000 | | 804 | 0,05 |
| 3,419 % fällig am 15.04.2033 | | 5.300 | | 4.388 | 0,27 |
| 3,469 % fällig am 15.04.2034 | | 1.200 | | 978 | 0,06 |
| 4,000 % fällig am 15.04.2029 | | 4.000 | | 3.710 | 0,23 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.02.2024 | | 1.500 | | 1.510 | 0,09 |
| **DAE Funding LLC** | | | | | |
| 1,550 % fällig am 01.08.2024 | | 2.500 | | 2.344 | 0,14 |
| 2,625 % fällig am 20.03.2025 | | 1.700 | | 1.583 | 0,10 |
| 3,375 % fällig am 20.03.2028 | | 2.800 | | 2.467 | 0,15 |
| **Expedia Group, Inc.** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 01.05.2025 | | 462 | | 476 | 0,03 |
| **Hyatt Hotels Corp.** | | | | | |
| 1,800 % fällig am 01.10.2024 | | 5.600 | | 5.298 | 0,33 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK)** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2025 (b) | € | 2.500 | | 2.285 | 0,14 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (6,375 % bar oder 7,125 % PIK)** | | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.05.2029 (b) | $ | 1.200 | | 1.046 | 0,06 |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | | | |
| 3,125 % fällig am 26.07.2024 | | 200 | | 194 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 11.02.2023 | | 600 | | 597 | 0,04 |
| 3,500 % fällig am 26.07.2026 | | 3.243 | | 3.044 | 0,19 |
| **Magallanes, Inc.** | | | | | |
| 3,428 % fällig am 15.03.2024 | | 2.100 | | 2.061 | 0,13 |
| 3,638 % fällig am 15.03.2025 | | 2.100 | | 2.037 | 0,13 |
| 3,755 % fällig am 15.03.2027 | | 2.100 | | 1.972 | 0,12 |
| **Microchip Technology, Inc.** | | | | | |
| 0,983 % fällig am 01.09.2024 | | 700 | | 653 | 0,04 |
| **Micron Technology, Inc.** | | | | | |
| 5,327 % fällig am 06.02.2029 | | 200 | | 199 | 0,01 |
| **Nissan Motor Co. Ltd.** | | | | | |
| 3,522 % fällig am 17.09.2025 | | 2.000 | | 1.895 | 0,12 |
| 4,345 % fällig am 17.09.2027 | | 1.600 | | 1.470 | 0,09 |
| 4,810 % fällig am 17.09.2030 | | 1.600 | | 1.423 | 0,09 |
| **Quanta Services, Inc.** | | | | | |
| 0,950 % fällig am 01.10.2024 | | 6.300 | | 5.832 | 0,36 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.03.2025 | | 200 | | 204 | 0,01 |
| **Sands China Ltd.** | | | | | |
| 2,550 % fällig am 08.03.2027 | | 1.900 | | 1.387 | 0,09 |
| 5,125 % fällig am 08.08.2025 | | 4.200 | | 3.530 | 0,22 |
| **Skyworks Solutions, Inc.** | | | | | |
| 0,900 % fällig am 01.06.2023 | | 100 | | 97 | 0,01 |
| 1,800 % fällig am 01.06.2026 | | 100 | | 89 | 0,01 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.02.2026 | | 400 | | 361 | 0,02 |
| 2,875 % fällig am 15.02.2031 | $ | 1.200 | $ | 999 | 0,06 |
| 3,375 % fällig am 15.04.2029 | | 500 | | 439 | 0,03 |
| 3,500 % fällig am 15.04.2025 | | 3.000 | | 2.938 | 0,18 |
| 3,500 % fällig am 15.04.2031 | | 600 | | 519 | 0,03 |
| **Westinghouse Air Brake Technologies Corp.** | | | | | |
| 4,400 % fällig am 15.03.2024 | | 389 | | 390 | 0,02 |
| | | | | 59.357 | 3,67 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | | |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | | | |
| 1,700 % fällig am 15.11.2023 | | 2.800 | | 2.700 | 0,17 |
| 3,000 % fällig am 15.06.2028 | | 500 | | 431 | 0,02 |
| 4,550 % fällig am 01.07.2030 | | 900 | | 801 | 0,05 |
| **Southern California Edison Co.** | | | | | |
| 0,975 % fällig am 01.08.2024 | | 1.500 | | 1.415 | 0,09 |
| | | | | 5.347 | 0,33 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | | 223.497 | 13,83 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | | |
| 1,465 % fällig am 01.10.2034 | | 0 | | 0 | 0,00 |
| 1,524 % fällig am 01.07.2044 | | 2 | | 2 | 0,00 |
| 1,775 % fällig am 01.09.2035 | | 9 | | 10 | 0,00 |
| 1,805 % fällig am 01.07.2035 | | 4 | | 4 | 0,00 |
| 1,858 % fällig am 25.11.2022 | | 69 | | 69 | 0,01 |
| 2,137 % fällig am 01.11.2035 | | 3 | | 3 | 0,00 |
| 2,294 % fällig am 25.03.2038 | | 388 | | 391 | 0,03 |
| 2,352 % fällig am 01.05.2038 | | 222 | | 229 | 0,01 |
| 2,722 % fällig am 01.01.2036 | | 321 | | 332 | 0,02 |
| 3,000 % fällig am 25.10.2040 | | 803 | | 781 | 0,05 |
| 4,756 % fällig am 25.03.2037 (a) | | 295 | | 34 | 0,00 |
| **Freddie Mac** | | | | | |
| 1,240 % fällig am 15.07.2040 | | 549 | | 543 | 0,03 |
| 1,300 % fällig am 15.03.2042 | | 223 | | 221 | 0,01 |
| 1,524 % fällig am 25.02.2045 | | 18 | | 18 | 0,00 |
| 2,021 % fällig am 01.09.2035 | | 5 | | 5 | 0,00 |
| 2,485 % fällig am 01.09.2037 | | 429 | | 444 | 0,03 |
| 2,700 % fällig am 01.05.2031 | | 1 | | 1 | 0,00 |
| 3,036 % fällig am 01.06.2035 | | 10 | | 11 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 01.01.2048 | | 1.791 | | 1.794 | 0,11 |
| **Ginnie Mae** | | | | | |
| 1,503 % fällig am 20.10.2065 | | 6 | | 6 | 0,00 |
| 1,553 % fällig am 20.12.2065 | | 1.199 | | 1.193 | 0,07 |
| 1,573 % fällig am 20.02.2066 | | 6 | | 6 | 0,00 |
| 1,603 % fällig am 20.01.2066 | | 238 | | 236 | 0,02 |
| 1,625 % fällig am 20.08.2024 - 20.07.2027 | | 15 | | 15 | 0,00 |
| 1,750 % fällig am 20.10.2029 | | 9 | | 9 | 0,00 |
| 1,803 % fällig am 20.01.2066 | | 3.936 | | 3.930 | 0,24 |
| 1,875 % fällig am 20.04.2026 - 20.04.2041 | | 172 | | 174 | 0,01 |
| 1,953 % fällig am 20.03.2066 | | 409 | | 410 | 0,03 |
| 2,857 % fällig am 20.04.2068 | | 4.008 | | 3.959 | 0,25 |
| 3,000 % fällig am 20.05.2047 | | 394 | | 383 | 0,02 |
| 3,379 % fällig am 20.06.2067 | | 753 | | 752 | 0,05 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.10.2036 | | 34 | | 37 | 0,00 |
| | | | | 16.002 | 0,99 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)** | | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.02.2052 | | 10.799 | | 8.403 | 0,52 |
| 0,625 % fällig am 15.02.2043 | | 629 | | 556 | 0,04 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2046 | | 2.074 | | 1.969 | 0,12 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 | | 4.465 | | 4.575 | 0,28 |
| | | | | 15.503 | 0,96 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | | |
| **245 Park Avenue Trust** | | | | | |
| 3,508 % fällig am 05.06.2037 | | 12.203 | | 11.412 | 0,71 |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | | | |
| 2,004 % fällig am 25.09.2046 ^ | | 112 | | 101 | 0,01 |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | | | |
| 1,904 % fällig am 25.03.2046 | | 351 | | 320 | 0,02 |
| **Ashford Hospitality Trust** | | | | | |
| 2,574 % fällig am 15.04.2035 | | 6.200 | | 5.967 | 0,37 |
| **Atrium Hotel Portfolio Trust** | | | | | |
| 2,254 % fällig am 15.12.2036 | | 5.285 | | 5.146 | 0,32 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Avon Finance PLC** | | | | |
| 1,690 % fällig am 20.09.2048 | £ | 2.691 | $ 3.251 | 0,20 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 1,136 % fällig am 26.10.2036 | $ | 3.930 | 3.611 | 0,22 |
| 2,736 % fällig am 20.02.2036 | | 13 | 13 | 0,00 |
| 2,966 % fällig am 25.05.2035 | | 2 | 2 | 0,00 |
| **Barclays Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,515 % fällig am 15.07.2037 | | 800 | 774 | 0,05 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,321 % fällig am 25.01.2034 | | 1 | 0 | 0,00 |
| 2,371 % fällig am 25.01.2034 | | 6 | 6 | 0,00 |
| 2,842 % fällig am 25.02.2033 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 2,925 % fällig am 25.07.2035 | | 969 | 732 | 0,05 |
| 2,994 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 56 | 55 | 0,00 |
| 3,074 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 7 | 5 | 0,00 |
| 3,128 % fällig am 25.11.2036 | | 3.405 | 2.232 | 0,14 |
| 3,199 % fällig am 25.01.2035 | | 1.481 | 1.422 | 0,09 |
| 3,235 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 638 | 508 | 0,03 |
| **Bear Stearns Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 1,794 % fällig am 25.06.2047 | | 370 | 328 | 0,02 |
| 1,804 % fällig am 25.10.2036 | | 1.544 | 1.328 | 0,08 |
| **Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust** | | | | |
| 2,999 % fällig am 26.12.2046 ^ | | 549 | 458 | 0,03 |
| 3,490 % fällig am 26.01.2036 ^ | | 2.267 | 1.879 | 0,12 |
| **Braemar Hotels & Resorts Trust** | | | | |
| 2,144 % fällig am 15.06.2035 | | 4.400 | 4.267 | 0,26 |
| **Bruegel DAC** | | | | |
| 0,800 % fällig am 22.05.2031 | € | 295 | 298 | 0,02 |
| **BX Trust** | | | | |
| 2,124 % fällig am 15.05.2030 | $ | 8.000 | 7.752 | 0,48 |
| 2,344 % fällig am 15.05.2035 | | 7.010 | 6.774 | 0,42 |
| **Canada Square Funding PLC** | | | | |
| 1,550 % fällig am 17.06.2058 | £ | 3.047 | 3.628 | 0,22 |
| **Citigroup Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 3,024 % fällig am 10.09.2045 | $ | 304 | 304 | 0,02 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,829 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 59 | 48 | 0,00 |
| 3,150 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 39 | 39 | 0,00 |
| 3,950 % fällig am 25.05.2035 | | 2 | 2 | 0,00 |
| **Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 4,411 % fällig am 10.07.2045 | | 924 | 922 | 0,06 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,476 % fällig am 25.12.2035 | | 742 | 645 | 0,04 |
| 1,802 % fällig am 20.09.2046 | | 3.182 | 3.054 | 0,19 |
| 1,807 % fällig am 20.12.2046 ^ | | 60 | 50 | 0,00 |
| 1,824 % fällig am 25.04.2047 | | 2.150 | 1.974 | 0,12 |
| 1,834 % fällig am 25.04.2047 | | 1.571 | 1.270 | 0,08 |
| 1,924 % fällig am 25.06.2035 ^ | | 976 | 699 | 0,04 |
| 1,944 % fällig am 25.02.2047 | | 80 | 71 | 0,00 |
| 1,984 % fällig am 25.05.2047 | | 291 | 253 | 0,02 |
| 2,044 % fällig am 25.07.2046 | | 4.086 | 3.718 | 0,23 |
| 5,750 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 664 | 597 | 0,04 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,084 % fällig am 25.05.2035 | | 3.481 | 2.936 | 0,18 |
| 2,404 % fällig am 25.02.2035 | | 3.541 | 3.094 | 0,19 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 0,098 % fällig am 25.06.2032 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 1,081 % fällig am 25.03.2032 | | 1 | 1 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | | |
| 1,166 % fällig am 27.12.2037 | | 4.972 | 4.612 | 0,29 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Trust** | | | | |
| 1,115 % fällig am 25.01.2060 | | 2.328 | 2.064 | 0,13 |
| 2,074 % fällig am 15.07.2032 | | 860 | 817 | 0,05 |
| 2,688 % fällig am 25.03.2059 | | 1.811 | 1.750 | 0,11 |
| 3,850 % fällig am 25.09.2057 | | 10.972 | 10.816 | 0,67 |
| **DBWF Mortgage Trust** | | | | |
| 2,945 % fällig am 19.12.2030 | | 1.400 | 1.351 | 0,08 |
| **Dilosk RMBS DAC** | | | | |
| 0,528 % fällig am 20.12.2060 | € | 9.770 | 10.082 | 0,62 |
| **Dutch Property Finance BV** | | | | |
| 0,285 % fällig am 28.04.2059 | | 13.647 | 14.169 | 0,88 |
| 1,250 % fällig am 28.04.2050 | | 8.000 | 8.322 | 0,52 |
| 1,750 % fällig am 28.04.2050 | | 9.579 | 9.463 | 0,59 |
| **European Loan Conduit DAC** | | | | |
| 1,000 % fällig am 17.02.2030 | | 2.786 | 2.875 | 0,18 |
| **Fingal Securities RMBS DAC** | | | | |
| 0,570 % fällig am 28.07.2055 | | 1.203 | 1.252 | 0,08 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **FirstMac Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 1,960 % fällig am 08.03.2049 | $ | 174 | $ 174 | 0,01 |
| **Frost CMBS DAC** | | | | |
| 1,150 % fällig am 22.11.2026 | € | 4.894 | 4.932 | 0,31 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,164 % fällig am 25.11.2045 | $ | 68 | 59 | 0,00 |
| **GS Mortgage Securities Corp. Trust** | | | | |
| 2,224 % fällig am 15.07.2031 | | 7.525 | 7.386 | 0,46 |
| **GS Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 4,074 % fällig am 10.01.2047 | | 9.886 | 9.856 | 0,61 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,974 % fällig am 25.01.2034 | | 1 | 1 | 0,00 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,052 % fällig am 19.05.2035 | | 21 | 19 | 0,00 |
| 3,401 % fällig am 19.08.2036 ^ | | 23 | 22 | 0,00 |
| **Hilton Orlando Trust** | | | | |
| 2,244 % fällig am 15.12.2034 | | 5.000 | 4.880 | 0,30 |
| 2,524 % fällig am 15.12.2034 | | 9.170 | 8.838 | 0,55 |
| **Hops Hill No. 1 PLC** | | | | |
| 1,922 % fällig am 27.05.2054 | £ | 1.602 | 1.936 | 0,12 |
| **Impac CMB Trust** | | | | |
| 2,164 % fällig am 25.05.2035 | $ | 4.134 | 3.908 | 0,24 |
| 2,384 % fällig am 25.10.2033 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Independence Plaza Trust** | | | | |
| 3,911 % fällig am 10.07.2035 | | 4.300 | 4.152 | 0,26 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | | |
| 6,500 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 1.476 | 990 | 0,06 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,574 % fällig am 15.02.2035 | | 7.100 | 6.914 | 0,43 |
| 2,840 % fällig am 15.12.2047 | | 1.870 | 1.865 | 0,12 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | | |
| 3,217 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 732 | 676 | 0,04 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 1,804 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 10.301 | 9.452 | 0,58 |
| 1,984 % fällig am 25.11.2035 | | 3.529 | 3.370 | 0,21 |
| 2,164 % fällig am 25.12.2035 | | 5.126 | 4.769 | 0,30 |
| **London Wall Mortgage Capital PLC** | | | | |
| 1,351 % fällig am 15.05.2051 | £ | 355 | 423 | 0,03 |
| 1,401 % fällig am 15.05.2052 | | 6.972 | 8.351 | 0,52 |
| **Luminent Mortgage Trust** | | | | |
| 2,024 % fällig am 25.10.2046 | $ | 170 | 154 | 0,01 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | | |
| 1,276 % fällig am 25.12.2046 | | 10.555 | 9.063 | 0,56 |
| **Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 1,804 % fällig am 15.06.2030 | | 6 | 5 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 2,044 % fällig am 25.02.2036 | | 7 | 7 | 0,00 |
| 2,084 % fällig am 25.04.2029 | | 143 | 134 | 0,01 |
| 2,124 % fällig am 25.11.2035 | | 4 | 4 | 0,00 |
| 2,292 % fällig am 25.12.2034 | | 6 | 6 | 0,00 |
| 2,722 % fällig am 25.12.2029 | | 141 | 133 | 0,01 |
| 3,586 % fällig am 25.12.2032 | | 1 | 1 | 0,00 |
| **MF1 Ltd.** | | | | |
| 3,443 % fällig am 15.07.2035 | | 385 | 384 | 0,02 |
| **Mortimer BTL PLC** | | | | |
| 1,492 % fällig am 23.06.2053 | £ | 572 | 674 | 0,04 |
| 1,862 % fällig am 21.06.2052 | | 2.566 | 3.104 | 0,19 |
| **Nomura Resecuritization Trust** | | | | |
| 2,524 % fällig am 25.03.2037 | $ | 3.979 | 3.746 | 0,23 |
| **Pierpont BTL PLC** | | | | |
| 1,592 % fällig am 22.12.2053 | £ | 12.762 | 15.211 | 0,94 |
| **Polaris PLC** | | | | |
| 1,730 % fällig am 23.12.2058 | | 1.983 | 2.374 | 0,15 |
| 1,740 % fällig am 23.10.2059 | | 4.941 | 5.920 | 0,37 |
| **Prime Mortgage Trust** | | | | |
| 2,024 % fällig am 25.02.2034 | $ | 24 | 24 | 0,00 |
| **Primrose Residential DAC** | | | | |
| 0,238 % fällig am 24.03.2061 | € | 2.425 | 2.500 | 0,15 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 6,500 % fällig am 25.08.2036 | $ | 1.024 | 883 | 0,05 |
| **Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust** | | | | |
| 3,027 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 459 | 322 | 0,02 |
| **Ripon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,351 % fällig am 28.08.2056 | £ | 13.674 | 16.443 | 1,02 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | | |
| 2,195 % fällig am 20.12.2034 | $ | 336 | 310 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Shamrock Residential DAC** | | | | |
| 0,338 % fällig am 24.01.2061 | € | 22.862 | $ 23.577 | 1,46 |
| **Stratton Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,452 % fällig am 12.12.2043 | £ | 5.824 | 6.993 | 0,43 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,876 % fällig am 25.01.2035 ^ | $ | 22 | 19 | 0,00 |
| 1,944 % fällig am 25.10.2035 | | 2.276 | 2.143 | 0,13 |
| 2,543 % fällig am 25.02.2034 | | 13 | 12 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 1,804 % fällig am 25.09.2047 | | 695 | 656 | 0,04 |
| 1,876 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 56 | 46 | 0,00 |
| 2,095 % fällig am 19.07.2035 | | 16 | 15 | 0,00 |
| 2,184 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 13 | 12 | 0,00 |
| **Taurus DEU DAC** | | | | |
| 1,200 % fällig am 22.12.2030 | € | 7.200 | 7.502 | 0,46 |
| **Taurus UK DAC** | | | | |
| 1,458 % fällig am 17.05.2031 | £ | 596 | 699 | 0,04 |
| **Tharaldson Hotel Portfolio Trust** | | | | |
| 2,520 % fällig am 11.11.2034 | $ | 3.159 | 2.984 | 0,18 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,264 % fällig am 25.09.2043 | | 402 | 389 | 0,02 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,827 % fällig am 20.02.2054 | £ | 277 | 337 | 0,02 |
| **Towd Point Mortgage Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.10.2059 | $ | 4.229 | 4.166 | 0,26 |
| 2,750 % fällig am 25.10.2056 | | 3.757 | 3.729 | 0,23 |
| 2,750 % fällig am 25.10.2057 | | 6.341 | 6.200 | 0,38 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | |
| 1,412 % fällig am 12.09.2055 | £ | 11.540 | 13.442 | 0,83 |
| **Verus Securitization Trust** | | | | |
| 1,829 % fällig am 25.10.2066 | $ | 13.568 | 12.250 | 0,76 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 1,176 % fällig am 25.03.2047 ^ | | 2.214 | 1.974 | 0,12 |
| 1,473 % fällig am 27.02.2034 | | 4 | 4 | 0,00 |
| 1,676 % fällig am 25.11.2042 | | 3 | 2 | 0,00 |
| 1,876 % fällig am 25.08.2042 | | 3 | 3 | 0,00 |
| 2,164 % fällig am 25.12.2045 | | 7 | 7 | 0,00 |
| 2,204 % fällig am 25.10.2045 | | 3 | 3 | 0,00 |
| 2,462 % fällig am 25.03.2034 | | 6 | 6 | 0,00 |
| 2,544 % fällig am 25.10.2044 | | 495 | 451 | 0,03 |
| 2,604 % fällig am 25.10.2045 | | 2.234 | 2.128 | 0,13 |
| 2,784 % fällig am 25.11.2045 | | 1.006 | 935 | 0,06 |
| 2,851 % fällig am 25.10.2035 | | 256 | 246 | 0,02 |
| 2,853 % fällig am 25.08.2046 ^ | | 28 | 26 | 0,00 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,734 % fällig am 25.04.2036 | | 1.941 | 1.858 | 0,12 |
| | | | 386.708 | 23,93 |

**FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Aames Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 2,539 % fällig am 25.10.2035 | | 2.900 | 2.736 | 0,17 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,904 % fällig am 25.07.2036 | | 2.264 | 2.170 | 0,13 |
| 1,944 % fällig am 25.10.2036 | | 4.185 | 1.809 | 0,11 |
| 2,524 % fällig am 25.08.2035 | | 1.250 | 1.221 | 0,08 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,494 % fällig am 25.11.2035 | | 3.026 | 2.880 | 0,18 |
| 2,539 % fällig am 25.09.2035 | | 6.000 | 5.803 | 0,36 |
| 2,584 % fällig am 25.10.2035 | | 1.700 | 1.619 | 0,10 |
| **Aqueduct European CLO DAC** | | | | |
| 0,640 % fällig am 20.07.2030 | € | 2.346 | 2.417 | 0,15 |
| **Ares European CLO DAC** | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.10.2030 | | 1.198 | 1.230 | 0,08 |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | | 1.000 | 1.022 | 0,06 |
| 0,850 % fällig am 20.04.2032 | | 14.100 | 14.358 | 0,89 |
| **Armada Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.07.2031 | | 1.400 | 1.426 | 0,09 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.11.2036 | $ | 6.259 | 3.000 | 0,19 |
| **Atlas Senior Loan Fund Ltd.** | | | | |
| 1,933 % fällig am 20.04.2028 | | 2.168 | 2.156 | 0,13 |
| **Aurium CLO DAC** | | | | |
| 0,730 % fällig am 16.01.2031 | € | 5.000 | 5.136 | 0,32 |
| **Avoca CLO DAC** | | | | |
| 0,690 % fällig am 15.07.2030 | | 4.359 | 4.492 | 0,28 |
| 0,820 % fällig am 15.10.2032 | | 4.200 | 4.282 | 0,27 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Bain Capital Euro DAC** | | | | | |
| 0,740 % fällig am 20.01.2032 | € | 700 | $ | 710 | 0,04 |
| **Barings CLO Ltd.** | | | | | |
| 1,863 % fällig am 20.01.2028 | $ | 980 | | 969 | 0,06 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.08.2036 | | 507 | | 482 | 0,03 |
| 1,964 % fällig am 25.12.2036 | | 1.000 | | 957 | 0,06 |
| 2,124 % fällig am 25.05.2037 | | 2.484 | | 2.428 | 0,15 |
| 2,269 % fällig am 25.12.2035 | | 517 | | 516 | 0,03 |
| 2,869 % fällig am 25.01.2035 | | 2.045 | | 2.027 | 0,13 |
| **Black Diamond CLO DAC** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 03.10.2029 | € | 166 | | 173 | 0,01 |
| 0,860 % fällig am 20.01.2032 | | 998 | | 1.031 | 0,06 |
| 0,980 % fällig am 15.05.2032 | | 20.700 | | 21.148 | 1,31 |
| 2,012 % fällig am 03.10.2029 | $ | 143 | | 143 | 0,01 |
| 2,500 % fällig am 15.05.2032 | | 4.000 | | 3.937 | 0,24 |
| **Blackrock European CLO DAC** | | | | | |
| 0,620 % fällig am 15.10.2031 | € | 1.350 | | 1.365 | 0,08 |
| **BlueMountain Fuji EUR CLO DAC** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 15.07.2030 | | 482 | | 497 | 0,03 |
| **BNPP AM Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,820 % fällig am 22.07.2032 | | 5.000 | | 5.074 | 0,31 |
| **Cairn CLO DAC** | | | | | |
| 0,600 % fällig am 30.04.2031 | | 1.199 | | 1.237 | 0,08 |
| 0,670 % fällig am 31.01.2030 | | 451 | | 463 | 0,03 |
| 0,780 % fällig am 15.10.2031 | | 600 | | 611 | 0,04 |
| **Carlyle Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,700 % fällig am 15.01.2031 | | 800 | | 817 | 0,05 |
| 0,890 % fällig am 15.08.2032 | | 5.700 | | 5.781 | 0,36 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,960 % fällig am 16.01.2033 | | 7.400 | | 7.523 | 0,47 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.11.2031 | | 800 | | 822 | 0,05 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,224 % fällig am 25.01.2036 | $ | 1.000 | | 973 | 0,06 |
| 2,614 % fällig am 25.06.2035 | | 513 | | 500 | 0,03 |
| **CBAM CLO Ltd.** | | | | | |
| 2,183 % fällig am 20.10.2029 | | 963 | | 951 | 0,06 |
| **Centex Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.09.2034 | | 2.649 | | 2.554 | 0,16 |
| **Chase Funding Trust** | | | | | |
| 2,364 % fällig am 25.10.2032 | | 2 | | 2 | 0,00 |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,974 % fällig am 25.10.2037 | | 1.308 | | 1.303 | 0,08 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | | |
| 3,274 % fällig am 25.07.2037 | | 1.264 | | 1.260 | 0,08 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | | |
| 2,024 % fällig am 25.08.2034 | | 123 | | 116 | 0,01 |
| 2,124 % fällig am 25.01.2046 ^ | | 5.603 | | 5.286 | 0,33 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.02.2037 | | 1.021 | | 957 | 0,06 |
| 1,764 % fällig am 25.03.2037 | | 1.174 | | 1.127 | 0,07 |
| 1,764 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 2.222 | | 2.178 | 0,13 |
| 1,764 % fällig am 25.08.2037 | | 393 | | 388 | 0,02 |
| 1,774 % fällig am 25.01.2037 | | 218 | | 215 | 0,01 |
| 1,844 % fällig am 25.05.2037 | | 3.270 | | 3.153 | 0,20 |
| 1,904 % fällig am 25.12.2046 | | 3.625 | | 3.358 | 0,21 |
| 1,914 % fällig am 25.10.2047 | | 5.400 | | 4.882 | 0,30 |
| 2,104 % fällig am 25.10.2046 | | 4.546 | | 4.356 | 0,27 |
| 2,149 % fällig am 25.08.2036 | | 1.400 | | 1.350 | 0,08 |
| 2,164 % fällig am 25.03.2036 | | 658 | | 606 | 0,04 |
| 2,629 % fällig am 25.10.2035 | | 245 | | 241 | 0,01 |
| 2,719 % fällig am 25.07.2035 | | 145 | | 144 | 0,01 |
| 2,719 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 11.300 | | 10.720 | 0,66 |
| 3,574 % fällig am 25.08.2035 | | 2.000 | | 1.938 | 0,12 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | | |
| 2,244 % fällig am 25.01.2032 | | 3 | | 2 | 0,00 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC** | | | | | |
| 3,199 % fällig am 25.03.2046 | | 1.500 | | 1.446 | 0,09 |
| **CVC Cordatus Loan Fund DAC** | | | | | |
| 0,630 % fällig am 15.09.2031 | € | 900 | | 920 | 0,06 |
| 0,650 % fällig am 21.07.2030 | | 8.411 | | 8.679 | 0,54 |
| 0,650 % fällig am 15.10.2031 | | 2.450 | | 2.500 | 0,15 |
| **Dryden Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.04.2033 | | 1.500 | | 1.521 | 0,09 |
| 0,860 % fällig am 15.05.2034 | | 1.000 | | 1.011 | 0,06 |
| **Ellington Loan Acquisition Trust** | | | | | |
| 2,674 % fällig am 25.05.2037 | $ | 2.012 | $ | 1.965 | 0,12 |
| 2,724 % fällig am 25.05.2037 | | 941 | | 911 | 0,06 |
| **EquiFirst Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 3,349 % fällig am 25.12.2034 | | 449 | | 436 | 0,03 |
| **Euro-Galaxy CLO DAC** | | | | | |
| 0,620 % fällig am 24.04.2034 | € | 2.100 | | 2.140 | 0,13 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,104 % fällig am 25.05.2036 | $ | 6.681 | | 5.338 | 0,33 |
| 2,299 % fällig am 25.11.2035 | | 1.417 | | 1.397 | 0,09 |
| 2,524 % fällig am 25.07.2035 | | 2.666 | | 2.626 | 0,16 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | | |
| 1,964 % fällig am 25.02.2037 | | 4.132 | | 1.604 | 0,10 |
| 2,239 % fällig am 25.11.2035 | | 2.400 | | 2.141 | 0,13 |
| 2,674 % fällig am 25.11.2034 | | 1.824 | | 1.771 | 0,11 |
| **Gallatin CLO Ltd.** | | | | | |
| 2,148 % fällig am 21.01.2028 | | 477 | | 473 | 0,03 |
| **GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | | |
| 2,264 % fällig am 25.12.2035 | | 4.224 | | 4.020 | 0,25 |
| **Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.** | | | | | |
| 2,504 % fällig am 15.09.2037 | | 2.100 | | 2.071 | 0,13 |
| **Griffith Park CLO DAC** | | | | | |
| 0,720 % fällig am 21.11.2031 | € | 11.600 | | 11.873 | 0,73 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | | | |
| 2,124 % fällig am 25.01.2036 | $ | 1.075 | | 459 | 0,03 |
| **GSAMP Trust** | | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.12.2036 | | 1.055 | | 604 | 0,04 |
| 1,924 % fällig am 25.09.2036 | | 2.898 | | 1.168 | 0,07 |
| 2,104 % fällig am 25.03.2046 | | 823 | | 808 | 0,05 |
| 2,524 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 1.550 | | 1.487 | 0,09 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | | |
| 0,640 % fällig am 15.10.2031 | € | 1.200 | | 1.225 | 0,08 |
| 0,650 % fällig am 26.06.2030 | | 396 | | 407 | 0,03 |
| 0,680 % fällig am 20.10.2031 | | 2.050 | | 2.092 | 0,13 |
| 0,760 % fällig am 15.07.2031 | | 900 | | 906 | 0,06 |
| 0,850 % fällig am 15.01.2032 | | 28.500 | | 29.002 | 1,78 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.11.2036 | $ | 1.184 | | 1.166 | 0,07 |
| 1,924 % fällig am 25.01.2037 | | 3.161 | | 2.860 | 0,18 |
| 2,329 % fällig am 25.01.2036 | | 1.130 | | 1.084 | 0,07 |
| 2,704 % fällig am 25.10.2035 | | 2.900 | | 2.782 | 0,17 |
| **Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 1,854 % fällig am 25.04.2037 | | 3.229 | | 3.125 | 0,19 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | | |
| 1,884 % fällig am 25.08.2036 | | 6.065 | | 5.835 | 0,36 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | | | |
| 2,404 % fällig am 25.01.2036 | | 1.200 | | 1.052 | 0,07 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.** | | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.12.2035 | | 1.339 | | 1.318 | 0,08 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | | |
| 1,884 % fällig am 25.06.2037 | | 429 | | 427 | 0,03 |
| 1,904 % fällig am 25.03.2047 | | 610 | | 576 | 0,04 |
| 2,029 % fällig am 25.07.2036 | | 1.263 | | 1.224 | 0,08 |
| 2,059 % fällig am 25.05.2036 | | 550 | | 519 | 0,03 |
| 2,064 % fällig am 25.07.2036 | | 3.200 | | 2.919 | 0,18 |
| **Jubilee CLO DAC** | | | | | |
| 0,519 % fällig am 15.12.2029 | € | 1.368 | | 1.415 | 0,09 |
| 0,600 % fällig am 15.04.2030 | | 400 | | 412 | 0,03 |
| 0,610 % fällig am 15.04.2030 | | 1.000 | | 1.033 | 0,06 |
| 0,650 % fällig am 15.04.2031 | | 1.200 | | 1.227 | 0,08 |
| **KVK CLO Ltd.** | | | | | |
| 1,938 % fällig am 14.01.2028 | $ | 266 | | 267 | 0,02 |
| **Laurelin DAC** | | | | | |
| 0,720 % fällig am 20.10.2031 | € | 1.100 | | 1.127 | 0,07 |
| **LCM LP** | | | | | |
| 2,103 % fällig am 20.10.2027 | $ | 1.188 | | 1.181 | 0,07 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,064 % fällig am 25.02.2036 | | 1.324 | | 1.288 | 0,08 |
| 2,184 % fällig am 25.10.2034 | | 5 | | 4 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.01.2036 | | 389 | | 359 | 0,02 |
| 2,539 % fällig am 25.08.2035 | | 3.000 | | 2.678 | 0,17 |
| **Madison Park Euro Funding DAC** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.01.2032 | € | 24.700 | | 25.004 | 1,55 |
| 0,800 % fällig am 15.07.2032 | | 5.000 | | 5.067 | 0,31 |
| **Man GLG Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,680 % fällig am 15.10.2030 | | 697 | | 714 | 0,04 |
| 0,690 % fällig am 15.12.2031 | | 1.000 | | 1.023 | 0,06 |
| 0,870 % fällig am 15.01.2030 | | 385 | | 399 | 0,02 |
| **Marathon CLO Ltd.** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 21.11.2027 | $ | 199 | $ | 199 | 0,01 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | | |
| 1,774 % fällig am 25.08.2037 | | 1.068 | | 1.001 | 0,06 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | | |
| 1,754 % fällig am 25.10.2036 | | 779 | | 703 | 0,04 |
| 2,124 % fällig am 25.04.2036 | | 1.970 | | 1.846 | 0,11 |
| 2,479 % fällig am 25.03.2034 | | 1.352 | | 1.317 | 0,08 |
| 2,539 % fällig am 25.07.2034 | | 1.213 | | 1.176 | 0,07 |
| 2,539 % fällig am 25.09.2034 | | 1.746 | | 1.654 | 0,10 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.04.2036 | | 212 | | 159 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 1,804 % fällig am 25.12.2036 | | 1.969 | | 886 | 0,05 |
| **Nationstar Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.04.2037 | | 8.523 | | 8.384 | 0,52 |
| **Navient Private Education Loan Trust** | | | | | |
| 2,774 % fällig am 16.07.2040 | | 5.380 | | 5.365 | 0,33 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 2,254 % fällig am 25.02.2036 | | 1.477 | | 1.375 | 0,09 |
| **Oak Hill European Credit Partners DAC** | | | | | |
| 0,740 % fällig am 20.10.2031 | € | 1.900 | | 1.934 | 0,12 |
| **Oak Hill European Credit Partners Ltd.** | | | | | |
| 0,900 % fällig am 22.07.2030 | | 218 | | 227 | 0,01 |
| **OCP CLO Ltd.** | | | | | |
| 2,183 % fällig am 20.07.2029 | $ | 1.088 | | 1.076 | 0,07 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 1,754 % fällig am 25.07.2037 | | 4.297 | | 3.302 | 0,20 |
| 1,844 % fällig am 25.04.2037 | | 2.209 | | 1.653 | 0,10 |
| **Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates** | | | | | |
| 2,359 % fällig am 25.11.2035 | | 274 | | 233 | 0,01 |
| **OZLM Ltd.** | | | | | |
| 2,336 % fällig am 30.04.2027 | | 184 | | 184 | 0,01 |
| **OZLME DAC** | | | | | |
| 1,350 % fällig am 27.07.2032 | € | 1.440 | | 1.420 | 0,09 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** | | | | | |
| 0,730 % fällig am 15.07.2031 | | 4.866 | | 4.988 | 0,31 |
| **Palmerston Park CLO DAC** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 18.04.2030 | | 4.272 | | 4.398 | 0,27 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | | |
| 2,359 % fällig am 25.09.2035 | $ | 1.428 | | 1.393 | 0,09 |
| 2,554 % fällig am 25.05.2035 | | 4.326 | | 4.016 | 0,25 |
| 2,629 % fällig am 25.06.2035 | | 3.700 | | 3.599 | 0,22 |
| 2,794 % fällig am 25.03.2035 | | 2.100 | | 1.959 | 0,12 |
| 2,944 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 1.000 | | 965 | 0,06 |
| **Pepper SPARKZ Trust** | | | | | |
| 1,885 % fällig am 15.09.2030 | AUD | 9.170 | | 6.269 | 0,39 |
| 2,085 % fällig am 17.08.2028 | | 1.946 | | 1.336 | 0,08 |
| **Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust** | | | | | |
| 2,494 % fällig am 25.02.2036 | $ | 1.700 | | 1.597 | 0,10 |
| **RAAC Trust** | | | | | |
| 3,124 % fällig am 25.09.2047 | | 3.429 | | 3.339 | 0,21 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | | | |
| 1,984 % fällig am 25.08.2046 | | 3.405 | | 3.207 | 0,20 |
| 2,164 % fällig am 25.02.2036 | | 1.200 | | 1.138 | 0,07 |
| 2,689 % fällig am 25.05.2035 | | 2.000 | | 1.895 | 0,12 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | | |
| 1,904 % fällig am 25.07.2036 | | 1.200 | | 1.140 | 0,07 |
| 2,284 % fällig am 25.12.2035 | | 700 | | 678 | 0,04 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | | | |
| 2,524 % fällig am 26.12.2034 | | 290 | | 284 | 0,02 |
| **Sculptor European CLO DAC** | | | | | |
| 0,790 % fällig am 14.01.2032 | € | 5.000 | | 5.047 | 0,31 |
| **Segovia European CLO DAC** | | | | | |
| 0,880 % fällig am 20.07.2032 | | 1.200 | | 1.219 | 0,08 |
| **SLM Private Credit Student Loan Trust** | | | | | |
| 2,119 % fällig am 15.06.2039 | $ | 2.979 | | 2.819 | 0,17 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | | |
| 2,329 % fällig am 25.11.2035 | | 2.485 | | 2.455 | 0,15 |
| **South Carolina Student Loan Corp.** | | | | | |
| 2,580 % fällig am 03.09.2024 | | 25 | | 25 | 0,00 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | | | |
| 1,744 % fällig am 25.03.2037 | | 5.023 | | 3.140 | 0,19 |
| 2,124 % fällig am 25.06.2037 | | 6.050 | | 3.821 | 0,24 |
| 2,599 % fällig am 25.12.2035 | | 169 | | 166 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | |
| 1,804 % fällig am 25.09.2036 | $ 7.295 | $ 4.825 | 0,30 |
| 2,244 % fällig am 25.01.2036 | 1.354 | 1.290 | 0,08 |
| 2,389 % fällig am 25.08.2035 | 1.936 | 1.876 | 0,12 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,894 % fällig am 25.03.2036 | 1.697 | 1.559 | 0,10 |
| 1,934 % fällig am 25.08.2046 | 3.600 | 3.400 | 0,21 |
| 1,944 % fällig am 25.10.2036 | 1.768 | 1.350 | 0,08 |
| 2,044 % fällig am 25.02.2037 | 1.561 | 1.473 | 0,09 |
| **Tikehau CLO BV** | | | |
| 0,870 % fällig am 04.08.2034 | € 6.200 | 6.319 | 0,39 |
| **Toro European CLO DAC** | | | |
| 0,810 % fällig am 15.02.2034 | 5.100 | 5.153 | 0,32 |
| **Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust** | | | |
| 1,934 % fällig am 25.08.2036 | $ 1.046 | 979 | 0,06 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 1,969 % fällig am 25.01.2037 | $ 488 | $ 468 | 0,03 |
| 2,119 % fällig am 25.05.2036 | 661 | 655 | 0,04 |
| | | 450.448 | 27,86 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **U.S. TREASURY BILLS** | | | |
| 0,676 % fällig am 19.07.2022 (c)(d) | 3.700 | 3.698 | 0,23 |
| 0,797 % fällig am 14.07.2022 (c)(d) | 72.300 | 72.272 | 4,47 |
| 1,139 % fällig am 01.09.2022 (c)(d) | 22.100 | 22.042 | 1,36 |
| 1,190 % fällig am 13.09.2022 (c)(d) | 98.500 | 98.187 | 6,08 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 196.199 | 12,14 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | **$1.288.357** | **79,71** |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)** | 15.572.814 | 154.918 | 9,59 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$154.918** | **9,59** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 6.862 | U.S. Treasury Notes 3,000% fällig am 30.06.2024 | $ (6.999) | $ 6.862 | $ 6.862 | 0,42 |
| MFK | 1,530 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 70.000 | U.S. Treasury Bonds 4,500 % fällig am 15.05.2038 | (72.138) | 70.000 | 70.003 | 4,33 |
| NOM | 1,480 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 39.200 | U.S. Treasury Bonds 4,375 % fällig am 15.05.2040 | (40.135) | 39.200 | 39.202 | 2,43 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (119.272)** | **$ 116.062** | **$ 116.067** | **7,18** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| E-mini S&P 500 Index September Futures | Long | 09.2022 | 3.326 | $ (14.241) | (0,88) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 50 | 212 | 0,01 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 1.068 | (379) | (0,02) |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 2.189 | (1.038) | (0,07) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 2.658 | 2.255 | 0,14 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 311 | (389) | (0,02) |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2022 | 175 | 992 | 0,06 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09.2022 | 6 | 30 | 0,00 |
| | | | | $ (12.558) | (0,78) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ (12.558)** | **(0,78)** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 6.300 | $ (74) | (0,01) |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.06.2026 | 3.200 | (67) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.12.2026 | 1.100 | (27) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.12.2022 | 600 | (1) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.06.2023 | 7.400 | (63) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.12.2023 | 6.800 | (119) | (0,01) |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.06.2026 | 1.800 | (74) | (0,01) |
| Enbridge, Inc. | 1,000 | 20.12.2022 | 400 | (2) | 0,00 |
| Exelon Generation Co. LLC | 1,000 | 20.12.2024 | 800 | 2 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2026 | 1.700 | (45) | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2026 | 3.700 | (146) | (0,01) |
| General Motors Co. | 5,000 | 20.12.2026 | 10.600 | (996) | (0,06) |
| Stellantis NV | 5,000 | 20.06.2026 | € 5.600 | (607) | (0,04) |
| Stellantis NV | 5,000 | 20.12.2026 | 1.800 | (193) | (0,01) |
| | | | | $ (2.412) | (0,15) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[2]

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag(3) | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-38 5-Year Index | (5,000) % | 20.06.2027 | $ 47.322 | $ 1.675 | 0,11 |
| CDX.IG-38 5-Year Index | (1,000 ) | 20.06.2027 | 45.700 | 219 | 0,01 |
| | | | | $ 1.894 | 0,12 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag(3) | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Asia Ex-Japan 37 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2027 | $ 6.300 | $ (84) | (0,01) |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabel Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,375 % | 06.07.2024 | $ 260.700 | $ (14.775) | (0,91) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,407 | 21.07.2024 | 182.400 | (10.302) | (0,64) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,500 | 16.06.2026 | 123.900 | 10.248 | 0,63 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 17.06.2025 | 107.800 | 10.072 | 0,62 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 17.06.2030 | 164.900 | (28.245) | (1,75) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 16.06.2051 | 13.000 | 1.893 | 0,12 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 | 22.01.2050 | 5.100 | 1.850 | 0,12 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,875 | 07.02.2050 | 300 | 111 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 15.01.2050 | 900 | 340 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 20.03.2050 | 1.900 | 729 | 0,05 |
| | | | | | $ (28.079) | (1,73) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (28.681)** | **(1,77)** |

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

(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 | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 % | 20.07.2022 | 2.000 | $ (9) | $ (4) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 2.100 | (6) | (7) | 0,00 |
| BRC | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 200 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 3.600 | (16) | (8) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 500 | (5) | (6) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 1.400 | (4) | (5) | 0,00 |
| | | | | | | $ (42) | $ (32) | 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 | Nenn-betrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FAR | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 4.267 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 37.177 | 06.07.2022 | $ 0 | $ (3.127) | $ (3.127) | (0,19) |
| | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 15.102 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 131.578 | 03.08.2022 | 0 | (11.008) | (11.008) | (0,68) |
| | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 32.517 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 258.077 | 21.06.2023 | 0 | 1.752 | 1.752 | 0,11 |
| MBC | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 7.445 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 64.865 | 16.11.2022 | 0 | (5.417) | (5.417) | (0,34) |
| | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 4.478 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 39.015 | 19.04.2023 | 0 | (3.261) | (3.261) | (0,20) |

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nenn-betrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 3.943 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 34.232 | 07.06.2023 | $ 0 | $ (2.742 ) | $ (2.742) | $ (0,17 ) |
| RBC | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 9.295 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 80.835 | 27.07.2022 | 0 | (6.750 ) | (6.750) | (0,42 ) |
| | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 11.325 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 98.670 | 17.08.2022 | 0 | (8.236 ) | (8.236) | (0,51 ) |
| | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 2.164 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 18.854 | 22.02.2023 | 0 | (1.576 ) | (1.576) | (0,10 ) |
| | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 11.325 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 98.670 | 17.05.2023 | 0 | (8.247 ) | (8.247) | (0,51 ) |
| | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 20.753 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 180.813 | 24.05.2023 | 0 | (15.111 ) | (15.111) | (0,93 ) |
| UAG | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 2.919 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 25.386 | 12.10.2022 | 0 | (2.120 ) | (2.120) | (0,13 ) |
| | | | | | | | $ 0 | $ (65.843 ) | $ (65.843) | (4,07 ) |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | £ 73.964 | $ 93.519 | $ 3.694 | $ 0 | $ 3.694 | 0,23 |
| | 07.2022 | $ 362 | DKK 2.547 | 0 | (4 ) | (4) | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK 2.541 | $ 362 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | $ 24 | BRL 115 | 0 | (2 ) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | 336.111 | € 319.524 | 0 | (2.066 ) | (2.066) | (0,13) |
| | 08.2022 | € 316.737 | $ 333.751 | 2.007 | 0 | 2.007 | 0,12 |
| | 08.2022 | $ 58 | ZAR 920 | 0 | (2 ) | (2) | 0,00 |
| | 09.2022 | 17 | TWD 471 | 0 | (1 ) | (1) | 0,00 |
| | 11.2022 | 40 | ZAR 649 | 0 | (1 ) | (1) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | 1.039 | £ 859 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | 19 | BRL 93 | 0 | (1 ) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | ILS 99.179 | $ 30.910 | 2.547 | 0 | 2.547 | 0,16 |
| | 10.2022 | 3.202 | 1.023 | 103 | 0 | 103 | 0,01 |
| | 12.2022 | 30.704 | 9.822 | 956 | 0 | 956 | 0,06 |
| | 01.2023 | 5.099 | 1.618 | 142 | 0 | 142 | 0,01 |
| DUB | 07.2022 | DKK 1.173 | 173 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| GLM | 10.2022 | $ 356 | MXN 7.281 | 0 | (1 ) | (1) | 0,00 |
| | 05.2023 | 8 | ZAR 132 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| HUS | 07.2022 | CAD 227 | $ 180 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07.2022 | NZD 212 | 138 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 10.2022 | $ 954 | ILS 3.197 | 0 | (35 ) | (35) | 0,00 |
| | 01.2023 | 1.525 | 5.077 | 0 | (56 ) | (56) | (0,01) |
| JPM | 08.2022 | 7 | TWD 201 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | 20 | 558 | 0 | (1 ) | (1) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | DKK 1.909 | $ 283 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 07.2022 | € 30 | 31 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 76 | DKK 534 | 0 | (1 ) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK 533 | $ 76 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 12 | IDR 178.372 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | 8 | TWD 228 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RBC | 08.2022 | AUD 12.151 | $ 8.638 | 280 | 0 | 280 | 0,02 |
| SOG | 07.2022 | € 318.609 | 342.443 | 9.355 | 0 | 9.355 | 0,58 |
| | 07.2022 | $ 88.969 | £ 73.105 | 0 | (186 ) | (186) | (0,01) |
| | 08.2022 | £ 73.105 | $ 89.010 | 185 | 0 | 185 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ 25.900 | ILS 87.100 | 0 | (992 ) | (992) | (0,06) |
| | 12.2022 | 9.181 | 30.620 | 0 | (339 ) | (339) | (0,02) |
| TOR | 07.2022 | BRL 208 | $ 40 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 40 | BRL 208 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 3.561 | ILS 11.986 | 0 | (134 ) | (134) | (0,01) |
| UAG | 09.2022 | MXN 7.067 | $ 355 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | | | | $ 19.320 | $ (3.822 ) | $ 15.498 | 0,96 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | € 102 | $ 110 | $ 3 | $ 0 | $ 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 30 | € 29 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | € 207.475 | $ 218.414 | 1.509 | 0 | 1.509 | 0,09 |
| | 07.2022 | $ 436 | € 406 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 08.2022 | 160.663 | 152.473 | 0 | (966) | (966) | (0,06) |
| CBK | 07.2022 | € 5 | $ 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 19.219 | € 17.900 | 0 | (506) | (506) | (0,03) |
| HUS | 07.2022 | € 163.962 | $ 172.448 | 1.062 | (29) | 1.033 | 0,06 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07.2022 | $ 190.538 | € 176.687 | $ 0 | $ (5.820) | $ (5.820) | (0,36) |
| | 08.2022 | 160.693 | 152.473 | 0 | (996) | (996) | (0,06) |
| SOG | 07.2022 | 185.545 | 172.630 | 0 | (5.068) | (5.068) | (0,31) |
| UAG | 07.2022 | 156.046 | 145.213 | 0 | (4.233) | (4.233) | (0,26) |
| | | | | $ 2.574 | $ (17.630) | $ (15.056) | (0,93) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | $ 1.870 | £ 1.479 | $ 0 | $ (74 ) | $ (74) | (0,01) |
| BRC | 07.2022 | £ 92 | $ 113 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 2.121 | £ 1.684 | 0 | (75 ) | (75) | (0,01) |
| MYI | 07.2022 | £ 299 | $ 361 | 0 | (2 ) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 110 | £ 87 | 0 | (4 ) | (4) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 1.612 | 1.282 | 0 | (55 ) | (55) | 0,00 |
| | | | | $ 2 | $ (210) | $ (208) | (0,02) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | SGD 47 | $ 34 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 85 | SGD 117 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | 34 | 47 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | SGD 2 | $ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| HUS | 07.2022 | 27 | 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 77 | SGD 105 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | 5 | 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 80 | 110 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | | | | $ 0 | $ (4) | $ (4) | 0,00 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (65.645)** | **(4,06)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 1.452.453** | **89,87** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ 163.713** | **10,13** |
| **Nettovermögen** | **$ 1.616.166** | **100,00** |

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

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

**^ Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

**(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.**

**Barmittel in Höhe von USD 69.055 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 66.090 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 1.288.357 | $ 0 | $ 1.288.357 |
| Investmentfonds | 154.918 | 0 | 0 | 154.918 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 116.062 | 0 | 116.062 |
| Finanzderivate[3] | (13.999) | (92.885) | 0 | (106.884) |
| **Summen** | **$ 140.919** | **$ 1.311.534** | **$ 0** | **$ 1.452.453** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 30.009 | $ 2.312.617 | $ 0 | $ 2.342.626 |
| Investmentfonds | 342.388 | 0 | 0 | 342.388 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 1.471.512 | 0 | 1.471.512 |
| Finanzderivate[3] | 29.744 | 39.536 | 0 | 69.280 |
| **Summen** | **$ 402.141** | **$ 3.823.665** | **$ 0** | **$ 4.225.806** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 3.611 | $ (3.699) | $ (88) |
| BPS | 466 | (330) | 136 |
| BRC | (78) | 0 | (78) |
| CBK | 3.241 | (2.782) | 459 |
| DUB | 8 | (10) | (2) |
| FAR | (12.383) | 8.790 | (3.593) |
| GLM | (1) | 0 | (1) |
| HUS | (5.865) | 0 | (5.865) |
| JPM | (12) | 0 | (12) |
| MBC | (11.420) | 15.660 | 4.240 |
| MYC | 0 | (860) | (860) |
| MYI | 8 | 0 | 8 |
| RBC | (39.640) | 35.910 | (3.730) |
| SCX | (57) | 0 | (57) |
| SOG | 2.955 | (3.550) | (595) |
| TOR | (134) | 0 | (134) |
| UAG | (6.344) | 5.730 | (614) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 35,26 | 30,73 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 40,10 | 31,01 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 4,35 | 0,55 |
| Investmentfonds | 9,59 | 9,10 |
| Pensionsgeschäfte | 7,18 | 39,12 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,78) | 0,77 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (1,77) | (0,29) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (4,06) | 1,36 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 13,83 | 10,86 |
| US-Regierungsbehörden | 0,99 | 0,52 |
| US-Schatzobligationen | 0,96 | 5,39 |
| Non-Agency-MBS | 23,93 | 10,74 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 27,86 | 12,05 |
| Staatsemissionen | k. A. | 0,20 |
| Stammaktien | k. A. | 0,80 |
| Kurzfristige Instrumente | 12,14 | 21,73 |
| Investmentfonds | 9,59 | 9,10 |
| Pensionsgeschäfte | 7,18 | 39,12 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,78) | 0,77 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,15) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | 0,12 | k. A. |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | (0,01) | 0,01 |
| Zinsswaps | (1,73) | (0,30) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | 0,00 | k. A. |
| Zinsswapoption | k. A. | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | k. A. | 0,00 |
| Total Return Swaps auf Indizes | (4,07) | 1,41 |
| Devisenterminkontrakte | 0,96 | (0,20) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (0,95) | 0,15 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 10,13 | (12,35) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | |
| 2,528 % fällig am 18.11.2027 | $ | 43 | $ 35 | 0,36 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 12.05.2026 | € | 100 | 93 | 0,95 |
| **Dell Bank International DAC** | | | | |
| 0,625 % fällig am 17.10.2022 | | 100 | 105 | 1,08 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 3,330 % fällig am 15.03.2028 | $ | 100 | 99 | 1,01 |
| **Nissan Motor Acceptance Co. LLC** | | | | |
| 2,750 % fällig am 09.03.2028 | | 50 | 42 | 0,43 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | DKK | 795 | 92 | 0,94 |
| **VICI Properties LP** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.02.2027 | $ | 100 | 88 | 0,90 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 1,338 % fällig am 04.05.2025 | € | 100 | 102 | 1,04 |
| | | | 656 | 6,71 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **Aker BP ASA** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.01.2025 | $ | 150 | 145 | 1,49 |
| **Boeing Co.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 01.02.2026 | | 104 | 97 | 0,99 |
| **Expedia Group, Inc.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 01.05.2025 | | 44 | 45 | 0,46 |
| **Magallanes, Inc.** | | | | |
| 4,279 % fällig am 15.03.2032 | | 100 | 90 | 0,92 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.02.2026 | | 100 | 90 | 0,92 |
| | | | 467 | 4,78 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | | |
| 4,550 % fällig am 01.07.2030 | | 5 | 4 | 0,04 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 1.127 | 11,53 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Freddie Mac** | | | | |
| 1,524 % fällig am 25.02.2045 | | 50 | 51 | 0,52 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2052 | | 700 | 690 | 7,06 |
| | | | 741 | 7,58 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)** | | | | |
| 1,000 % fällig am 15.02.2046 | | 122 | 116 | 1,19 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 | | 124 | 127 | 1,30 |
| | | | 243 | 2,49 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **245 Park Avenue Trust** | | | | |
| 3,508 % fällig am 05.06.2037 | | 100 | 94 | 0,96 |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | | |
| 1,396 % fällig am 25.11.2046 | $ | 243 | $ 80 | 0,82 |
| **Banc of America Alternative Loan Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.03.2021 ^ | | 13 | 11 | 0,11 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | | |
| 3,453 % fällig am 25.06.2034 | | 6 | 5 | 0,05 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 3,140 % fällig am 25.05.2037 | | 14 | 14 | 0,14 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | | |
| 3,718 % fällig am 25.07.2037 | | 2 | 2 | 0,02 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,476 % fällig am 25.12.2035 | | 24 | 23 | 0,24 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 | | 18 | 13 | 0,13 |
| 5,915 % fällig am 25.11.2035 | | 37 | 22 | 0,23 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,084 % fällig am 25.05.2035 | | 90 | 76 | 0,78 |
| **Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust** | | | | |
| 1,482 % fällig am 25.11.2034 | | 13 | 12 | 0,12 |
| **Dutch Property Finance BV** | | | | |
| 1,250 % fällig am 28.04.2050 | € | 100 | 104 | 1,06 |
| **Frost CMBS DAC** | | | | |
| 1,150 % fällig am 22.11.2026 | | 100 | 101 | 1,03 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,668 % fällig am 25.11.2035 | $ | 22 | 20 | 0,21 |
| **Mortgage Equity Conversion Asset Trust** | | | | |
| 3,300 % fällig am 25.02.2042 | | 125 | 114 | 1,17 |
| **Precise Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,952 % fällig am 12.12.2055 | £ | 98 | 118 | 1,21 |
| **Shamrock Residential DAC** | | | | |
| 0,338 % fällig am 24.01.2061 | € | 97 | 100 | 1,02 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 2,095 % fällig am 19.07.2035 | $ | 24 | 22 | 0,23 |
| 2,244 % fällig am 25.09.2045 | | 12 | 11 | 0,11 |
| **Structured Asset Securities Corp.** | | | | |
| 1,904 % fällig am 25.01.2036 | | 12 | 12 | 0,12 |
| 1,974 % fällig am 25.03.2035 | | 44 | 42 | 0,43 |
| | | | 996 | 10,19 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Ares European CLO DAC** | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.10.2030 | € | 100 | 102 | 1,04 |
| **Armada Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.07.2031 | | 100 | 102 | 1,04 |
| **Avoca CLO DAC** | | | | |
| 0,690 % fällig am 15.07.2030 | | 87 | 90 | 0,92 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.08.2036 | $ | 89 | 85 | 0,87 |
| 2,874 % fällig am 25.08.2037 | | 20 | 20 | 0,21 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,960 % fällig am 16.01.2033 | € | 100 | 102 | 1,04 |
| **Contego CLO DAC** | | | | |
| 0,640 % fällig am 23.01.2030 | | 100 | 103 | 1,06 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 2,239 % fällig am 25.11.2035 | $ | 100 | 89 | 0,91 |
| **Griffith Park CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 21.11.2031 | € | 100 | 102 | 1,04 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | | |
| 3,499 % fällig am 25.02.2035 | $ | 100 | 100 | 1,02 |
| **GSAMP Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.12.2036 | $ | 147 | $ 84 | 0,86 |
| **Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,854 % fällig am 25.04.2037 | | 90 | 87 | 0,89 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | | |
| 2,404 % fällig am 25.01.2036 | | 100 | 88 | 0,90 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 1,834 % fällig am 25.10.2036 | | 33 | 33 | 0,34 |
| **Jubilee CLO DAC** | | | | |
| 0,610 % fällig am 15.04.2030 | € | 100 | 103 | 1,06 |
| **LoanCore Issuer Ltd.** | | | | |
| 2,624 % fällig am 15.07.2036 | $ | 100 | 97 | 0,99 |
| **Man GLG Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,870 % fällig am 15.01.2030 | € | 64 | 66 | 0,68 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 2,479 % fällig am 25.03.2034 | $ | 84 | 82 | 0,84 |
| **Oak Hill European Credit Partners DAC** | | | | |
| 0,730 % fällig am 20.01.2032 | € | 100 | 103 | 1,05 |
| **Pretium Mortgage Credit Partners LLC** | | | | |
| 2,240 % fällig am 27.09.2060 | $ | 139 | 132 | 1,35 |
| | | | 1.770 | 18,11 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,400 % fällig am 12.08.2034 | PEN | 100 | 21 | 0,22 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **ISRAEL TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,051) % fällig am 03.08.2022 (b)(c) | ILS | 300 | 86 | 0,88 |
| (0,050) % fällig am 07.10.2022 (b)(c) | | 100 | 28 | 0,29 |
| 0,022 % fällig am 04.01.2023 (b)(c) | | 100 | 28 | 0,29 |
| | | | 142 | 1,46 |
| **U.S. TREASURY BILLS** | | | | |
| 1,038 % fällig am 02.08.2022 (a)(b)(c) | $ | 2.000 | 1.998 | 20,44 |
| 1,504 % fällig am 23.08.2022 (b)(c) | | 2.400 | 2.395 | 24,51 |
| | | | 4.393 | 44,95 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 4.535 | 46,41 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **$ 9.433** | **96,53** |
| | | **AKTIEN** | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)** | | 52.165 | 519 | 5,31 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (e)** | | 3.800 | 376 | 3,85 |
| **Summe Investmentfonds** | | | **$ 895** | **9,16** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SSB | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 119 | U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026 | $ (121) | $ 119 | $ 119 | 1,22 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (121)** | **$ 119** | **$ 119** | **1,22** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

### FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 1 | $ 4 | 0,04 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 3 | (3) | (0,03) |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 5 | 3 | 0,03 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 15 | (10) | (0,10) |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 1 | (1) | (0,01) |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2022 | 2 | 10 | 0,10 |
| | | | | $ 3 | 0,03 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 3** | **0,03** |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-36 5-Year Index | 1,000 % | 20.12.2026 | $ 100 | $ (10) | (0,10) |
| CDX.HY-38 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2027 | 99 | (7) | (0,07) |
| CDX.IG-38 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 3.500 | (55) | (0,56) |
| iTraxx Crossover 37 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2027 | € 100 | (10) | (0,10) |
| iTraxx Europe Main 34 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2025 | 400 | (11) | (0,11) |
| iTraxx Europe Main 37 10-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 400 | (8) | (0,09) |
| | | | | $ (101) | (1,03) |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 % | 15.06.2029 | $ 100 | $ (7) | (0,08) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,250 | 15.12.2028 | 200 | (18) | (0,19) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,250 | 15.06.2032 | 100 | (3) | (0,03) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,407 | 21.07.2024 | 200 | (11) | (0,12) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,500 | 16.06.2028 | 200 | (17) | (0,17) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,740 | 15.02.2027 | 100 | (10) | (0,10) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,750 | 16.12.2022 | 500 | (10) | (0,10) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,000 | 16.12.2025 | 350 | (30) | (0,30) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,000 | 16.12.2027 | 300 | 38 | 0,39 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 17.06.2030 | 100 | 19 | 0,20 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 16.06.2051 | 100 | 15 | 0,15 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,277 | 21.07.2031 | 200 | 28 | 0,28 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 18.12.2029 | 200 | 14 | 0,15 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 18.12.2024 | 100 | 6 | 0,06 |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | € 300 | (31) | (0,31) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2052 | 90 | 23 | 0,23 |
| Erhalt | UKRPI | 3,334 | 15.08.2025 | £ 100 | 16 | 0,17 |
| Zahlung | UKRPI | 3,650 | 15.12.2030 | 100 | (16) | (0,17) |
| | | | | | $ 6 | 0,06 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (95)** | **(0,97)** |

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

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

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

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

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

## OPTIONSKAUF

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,019 % | 18.03.2024 | 700 | $ 7 | $ 17 | 0,17 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 % | 20.07.2022 | 100 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| GST | Call - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Kauf | 0,700 | 17.08.2022 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,300 | 17.08.2022 | 200 | 0 | (1) | (0,01) |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,250 | 20.07.2022 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,350 | 17.08.2022 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (1) | $ (1) | (0,01) |

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 0,028 % | 18.03.2024 | 1.400 | $ (7) | $ (19) | (0,19) |

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

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nenn-betrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FAR | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 157 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 1.368 | 06.07.2022 | $ 0 | $ (115) | $ (115) | (1,18) |
| | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 232 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 2.021 | 03.08.2022 | 0 | (169) | (169) | (1,73) |
| | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 97 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 924 | 28.09.2022 | 0 | (152) | (152) | (1,55) |
| | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 119 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.035 | 05.10.2022 | 0 | (86) | (86) | (0,89) |
| RBC | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 615 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 5.358 | 22.02.2023 | 0 | (448) | (448) | (4,58) |
| | | | | | | | $ 0 | $ (970) | $ (970) | (9,93) |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | DKK | 115 | $ | 17 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 79 | DKK | 557 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 08.2022 | DKK | 556 | $ | 79 | 1 | 0 | 1 | 0,01 |
| | 08.2022 | MXN | 42 | | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 27 | € | 25 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | BRL | 1 | $ | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | ILS | 300 | | 96 | 10 | 0 | 10 | 0,10 |
| | 09.2022 | PEN | 97 | | 25 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10.2022 | ILS | 100 | | 32 | 3 | 0 | 3 | 0,03 |
| | 01.2023 | | 100 | | 32 | 3 | 0 | 3 | 0,03 |
| DUB | 07.2022 | DKK | 232 | | 34 | 2 | 0 | 2 | 0,02 |
| | 08.2022 | € | 1.469 | | 1.560 | 20 | 0 | 20 | 0,20 |
| | 08.2022 | £ | 103 | | 127 | 2 | 0 | 2 | 0,02 |
| GLM | 07.2022 | $ | 0 | BRL | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | BRL | 1 | $ | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 08.2022 | € | 12 | | 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 08.2022 | $ | 5 | € | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | DKK | 378 | $ | 56 | 3 | 0 | 3 | 0,03 |
| | 07.2022 | $ | 24 | DKK | 167 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 117 | $ | 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RBC | 09.2022 | $ | 46 | MXN | 943 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 09.2022 | MXN | 891 | $ | 45 | 1 | 0 | 1 | 0,01 |
| | | | | | | $ 46 | $ (2) | $ 44 | 0,45 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | € 9 | $ 10 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 10 | € 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | € 10 | $ 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | 118 | 124 | 1 | 0 | 1 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ 140 | € 130 | 0 | (4) | (4) | (0,04) |
| | 08.2022 | 124 | 118 | 0 | (1) | (1) | (0,01) |
| RBC | 07.2022 | € 17 | $ 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | $ 11 | € 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | 136 | 127 | 0 | (4) | (4) | (0,04) |
| UAG | 07.2022 | 113 | 105 | 0 | (3) | (3) | (0,03) |
| | | | | $ 1 | $ (12) | $ (11) | (0,11) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | $ 78 | £ 62 | $ 0 | $ (3) | $ (3) | (0,03) |
| BRC | 07.2022 | £ 4 | $ 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 90 | £ 72 | 0 | (3) | (3) | (0,03) |
| CBK | 07.2022 | £ 1 | $ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | 13 | 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | $ 72 | £ 57 | 0 | (3) | (3) | (0,03) |
| | | | | $ 0 | $ (9) | $ (9) | (0,09) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **$ (949)** | **(9,71)** |

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.07.2037 | $ 100 | $ (93) | (0,96) |
| 2,000 % fällig am 01.07.2052 | 600 | (521) | (5,33) |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 | 600 | (540) | (5,52) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (1.154)** | **(11,81)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 8.252** | **84,45** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ 1.520** | **15,55** |
| **Nettovermögen** | | **$ 9.772** | **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 205 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 660 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 9.433 | $ 0 | $ 9.433 |
| Investmentfonds | 519 | 376 | 0 | 895 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 119 | 0 | 119 |
| Finanzderivate[3] | 4 | (1.045) | 0 | (1.041) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (1.154) | 0 | (1.154) |
| **Summen** | **$ 523** | **$ 7.729** | **$ 0** | **$ 8.252** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 9.467 | $ 0 | $ 9.467 |
| Investmentfonds | 1.103 | 0 | 0 | 1.103 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 1.432 | 0 | 1.432 |
| Finanzderivate[3] | 0 | 195 | 0 | 195 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (305) | 0 | (305) |
| **Summen** | **$ 1.103** | **$ 10.789** | **$ 0** | **$ 11.892** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (3) | $ 0 | $ (3) |
| BRC | (3) | 0 | (3) |
| CBK | 14 | 0 | 14 |
| DUB | 24 | 0 | 24 |
| FAR | (522) | 370 | (152) |
| GST | (1) | 0 | (1) |
| MBC | (4) | 0 | (4) |
| MYI | 3 | 0 | 3 |
| RBC | (448) | 290 | (158) |
| SCX | (3) | 0 | (3) |
| SOG | (4) | 0 | (4) |
| UAG | (2) | 0 | (2) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 47,28 | 30,90 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 46,43 | 48,72 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 2,82 | 1,93 |
| Investmentfonds | 9,16 | 9,50 |
| Pensionsgeschäfte | 1,22 | 12,33 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,03 | 0,01 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,97) | (0,23) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (9,71) | 1,90 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (11,81) | (2,63) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 11,53 | 10,05 |
| US-Regierungsbehörden | 7,58 | 6,90 |
| US-Schatzobligationen | 2,49 | 5,34 |
| Non-Agency-MBS | 10,19 | 6,97 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 18,11 | 17,70 |
| Staatsemissionen | 0,22 | 0,20 |
| Kurzfristige Instrumente | 46,41 | 34,39 |
| Investmentfonds | 9,16 | 9,50 |
| Pensionsgeschäfte | 1,22 | 12,33 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,03 | 0,01 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | (1,03) | (0,01) |
| Zinsswaps | 0,06 | (0,22) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoption | 0,17 | 0,05 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,01) | 0,00 |
| Zinsswapoption | (0,19) | (0,04) |
| Total Return Swaps auf Indizes | (9,93) | 1,79 |
| Devisenterminkontrakte | 0,45 | 0,04 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (0,20) | 0,06 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (11,81) | (2,63) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 15,55 | (2,43) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **AmSurg Corp.** | | | | |
| TBD % fällig am 30.04.2027 µ | $ | 138 | $ 137 | 0,03 |
| TBD % fällig am 30.04.2027 | | 762 | 752 | 0,14 |
| 13,000 % fällig am 30.04.2028 | | 1.777 | 1.653 | 0,31 |
| **Aramark Services, Inc.** | | | | |
| 3,416 % fällig am 11.03.2025 | | 93 | 90 | 0,02 |
| **Avantor Funding, Inc.** | | | | |
| 3,666 % fällig am 21.11.2024 | | 4 | 4 | 0,00 |
| **Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC** | | | | |
| 3,095 % fällig am 12.02.2027 | | 658 | 623 | 0,12 |
| 3,345 % fällig am 15.01.2025 | | 1.400 | 1.336 | 0,25 |
| **Caesars Resort Collection LLC** | | | | |
| 4,416 % fällig am 23.12.2024 | | 382 | 369 | 0,07 |
| 5,166 % fällig am 21.07.2025 | | 1.777 | 1.718 | 0,32 |
| **Carnival Corp.** | | | | |
| 5,877 % fällig am 30.06.2025 | | 980 | 915 | 0,17 |
| 6,127 % fällig am 18.10.2028 | | 418 | 376 | 0,07 |
| **Emerald TopCo, Inc.** | | | | |
| 4,739 % - 5,166 % fällig am 24.07.2026 | | 40 | 37 | 0,01 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | |
| 3,374 % fällig am 22.06.2026 | | 326 | 313 | 0,06 |
| **iHeartCommunications, Inc.** | | | | |
| 4,666 % fällig am 01.05.2026 | | 3.320 | 3.092 | 0,58 |
| **INEOS Finance PLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.04.2024 | € | 4.347 | 4.350 | 0,82 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | |
| 4,920 % fällig am 01.02.2029 | $ | 1.127 | 1.034 | 0,20 |
| **Lealand Finance Company BV** | | | | |
| 4,666 % fällig am 28.06.2024 | | 26 | 16 | 0,00 |
| **Lealand Finance Company BV (2,666 % bar oder 3,000 % PIK)** | | | | |
| 2,666 % - 3,000 % fällig am 30.06.2025 (b) | | 140 | 72 | 0,01 |
| **PUG LLC** | | | | |
| 5,166 % fällig am 12.02.2027 | | 45 | 41 | 0,01 |
| **RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,416 % fällig am 16.11.2025 | | 87 | 81 | 0,02 |
| **Sequa Mezzanine Holdings LLC** | | | | |
| TBD % fällig am 23.07.2025 | | 0 | 0 | 0,00 |
| 8,303 % fällig am 28.11.2023 | | 590 | 587 | 0,11 |
| **SS&C European Holdings SARL** | | | | |
| 3,416 % fällig am 16.04.2025 | | 58 | 56 | 0,01 |
| **SS&C Technologies, Inc.** | | | | |
| 3,416 % fällig am 16.04.2025 | | 77 | 74 | 0,01 |
| **Sunshine Luxembourg SARL** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.10.2026 | | 318 | 295 | 0,06 |
| **Syniverse Holdings, Inc.** | | | | |
| 8,286 % fällig am 13.05.2027 | | 101 | 89 | 0,02 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | | |
| 4,416 % fällig am 15.03.2024 | | 461 | 453 | 0,09 |
| **Windstream Services LLC** | | | | |
| 7,916 % fällig am 21.09.2027 | | 21 | 19 | 0,00 |
| | | | 18.582 | 3,51 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.11.2031 | | 2 | 2 | 0,00 |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | |
| 2,528 % fällig am 18.11.2027 | | 1.625 | 1.326 | 0,25 |
| **Banco de Credito del Peru S.A.** | | | | |
| 4,650 % fällig am 17.09.2024 | PEN | 1.100 | 268 | 0,05 |
| **Banco Espirito Santo S.A.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 08.05.2017 ^ | € | 100 | 18 | 0,00 |
| **Bank of Ireland Group PLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 19.05.2025 (g)(i) | | 1.761 | 1.829 | 0,35 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (i) | $ | 349 | 352 | 0,07 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 4,972 % fällig am 16.05.2029 | | 400 | 393 | 0,08 |
| 7,125 % fällig am 15.06.2025 (g)(i) | £ | 200 | 234 | 0,05 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (g)(i) | £ | 1.200 | $ 1.437 | 0,27 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (g)(i) | $ | 1.200 | 1.182 | 0,22 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2022 (g)(i) | £ | 1.700 | 2.061 | 0,39 |
| **Corestate Capital Holding S.A.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.04.2023 | € | 700 | 165 | 0,03 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (i) | $ | 1.915 | 1.920 | 0,36 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 3,869 % fällig am 12.01.2029 | | 1.670 | 1.502 | 0,28 |
| 7,250 % fällig am 12.09.2025 (g)(i) | | 200 | 174 | 0,03 |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (g)(i) | | 400 | 370 | 0,07 |
| **EPR Properties** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.12.2026 | | 15 | 14 | 0,00 |
| 4,950 % fällig am 15.04.2028 | | 24 | 22 | 0,00 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 1,744 % fällig am 19.07.2024 | € | 200 | 194 | 0,04 |
| 3,250 % fällig am 15.09.2025 | | 3.244 | 3.116 | 0,59 |
| 3,550 % fällig am 07.10.2022 | $ | 600 | 598 | 0,11 |
| **GLP Capital LP** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.01.2031 | | 3.748 | 3.238 | 0,61 |
| 5,250 % fällig am 01.06.2025 | | 39 | 38 | 0,01 |
| 5,300 % fällig am 15.01.2029 | | 186 | 178 | 0,03 |
| **Host Hotels & Resorts LP** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.09.2030 | | 4.700 | 4.020 | 0,76 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 3,973 % fällig am 22.05.2030 | | 1.700 | 1.563 | 0,30 |
| 6,000 % fällig am 29.09.2023 (g)(i) | € | 1.100 | 1.140 | 0,22 |
| **Legal & General Group PLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 24.03.2031 (g)(i) | £ | 1.000 | 1.029 | 0,20 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 0,000 % fällig am 02.04.2032 (k) | $ | 700 | 437 | 0,08 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 5,875 % fällig am 20.12.2024 (g)(i) | £ | 200 | 231 | 0,04 |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 4,445 % fällig am 08.05.2030 | $ | 1.200 | 1.131 | 0,21 |
| 4,892 % fällig am 18.05.2029 | | 500 | 485 | 0,09 |
| 5,076 % fällig am 27.01.2030 | | 1.400 | 1.372 | 0,26 |
| 6,000 % fällig am 29.12.2025 (g)(i) | | 1.000 | 928 | 0,18 |
| 8,000 % fällig am 10.08.2025 (g)(i) | | 600 | 595 | 0,11 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.01.2023 | | 3.900 | 3.873 | 0,73 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | DKK | 0 | 0 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Omega Healthcare Investors, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.10.2029 | $ | 110 | 93 | 0,02 |
| **OneMain Finance Corp.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.03.2023 | | 3.646 | 3.604 | 0,68 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2023 | | 393 | 392 | 0,07 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2024 | | 7 | 7 | 0,00 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 24.06.2024 (g)(i) | £ | 200 | 234 | 0,05 |
| **Sitka Holdings LLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 06.07.2026 | $ | 731 | 708 | 0,13 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 04.10.2023 (g)(i) | | 700 | 675 | 0,13 |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | |
| 6,500 % (g) | € | 511 | 520 | 0,10 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | |
| 8,350 % fällig am 19.04.2023 ^ | $ | 200 | 30 | 0,01 |
| **Tesco Property Finance PLC** | | | | |
| 6,052 % fällig am 13.10.2039 | £ | 898 | 1.184 | 0,22 |
| **Unique Pub Finance Co. PLC** | | | | |
| 5,659 % fällig am 30.06.2027 | | 770 | 987 | 0,19 |
| **Voyager Aviation Holdings LLC** | | | | |
| 8,500 % fällig am 09.05.2026 | $ | 33 | 30 | 0,01 |
| | | | 45.899 | 8,68 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **American Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,350 % fällig am 15.04.2031 | | 31 | 29 | 0,01 |
| **American Airlines, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 20.04.2026 | | 3.457 | 3.188 | 0,60 |
| **Boeing Co.** | | | | |
| 5,805 % fällig am 01.05.2050 | $ | 1.200 | $ 1.104 | 0,21 |
| 5,930 % fällig am 01.05.2060 | | 1.300 | 1.187 | 0,22 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | |
| 3,137 % fällig am 15.11.2035 | | 120 | 91 | 0,02 |
| 3,187 % fällig am 15.11.2036 | | 28 | 21 | 0,00 |
| 3,469 % fällig am 15.04.2034 | | 121 | 99 | 0,02 |
| 4,150 % fällig am 15.11.2030 | | 136 | 125 | 0,02 |
| 4,300 % fällig am 15.11.2032 | | 501 | 456 | 0,09 |
| 4,926 % fällig am 15.05.2037 | | 219 | 197 | 0,04 |
| **Carvana Co.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.04.2027 | | 668 | 432 | 0,08 |
| 10,250 % fällig am 01.05.2030 | | 2.120 | 1.745 | 0,33 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 4,800 % fällig am 01.03.2050 | | 221 | 176 | 0,03 |
| **Citrix Systems, Inc.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 01.03.2030 | | 38 | 37 | 0,01 |
| **Community Health Systems, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.03.2027 | | 3.611 | 3.066 | 0,58 |
| 8,000 % fällig am 15.03.2026 | | 682 | 623 | 0,12 |
| **Energy Transfer LP** | | | | |
| 4,950 % fällig am 15.05.2028 | | 25 | 24 | 0,00 |
| **Exela Intermediate LLC** | | | | |
| 11,500 % fällig am 15.07.2026 | | 57 | 19 | 0,00 |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 2,949 % fällig am 24.01.2024 | € | 500 | 170 | 0,03 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.03.2030 | $ | 3.988 | 3.300 | 0,62 |
| **Magallanes, Inc.** | | | | |
| 4,279 % fällig am 15.03.2032 | | 900 | 805 | 0,15 |
| **Market Bidco Finco PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 04.11.2027 | € | 800 | 667 | 0,13 |
| **Marriott International, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.06.2030 | $ | 28 | 27 | 0,01 |
| **Melco Resorts Finance Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 04.12.2029 | | 930 | 563 | 0,11 |
| **MGM China Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.05.2026 | | 3.110 | 2.356 | 0,44 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | |
| 6,013 % fällig am 15.12.2030 | £ | 26 | 32 | 0,01 |
| **Netflix, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.06.2030 | € | 214 | 194 | 0,04 |
| 3,875 % fällig am 15.11.2029 | | 476 | 450 | 0,08 |
| 4,625 % fällig am 15.05.2029 | | 300 | 297 | 0,06 |
| 4,875 % fällig am 15.06.2030 | $ | 200 | 183 | 0,03 |
| 5,375 % fällig am 15.11.2029 | | 72 | 68 | 0,01 |
| **NMG Holding Co., Inc.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 01.04.2026 | | 700 | 647 | 0,12 |
| **Noble Finance Co. (11,000 % bar oder 15,000 % PIK)** | | | | |
| 11,000 % fällig am 15.02.2028 (b) | | 59 | 65 | 0,01 |
| **Petroleos de Venezuela S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 12.04.2027 ^ | | 707 | 42 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 12.04.2037 ^ | | 762 | 45 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 16.05.2024 ^ | | 642 | 40 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 15.11.2026 ^ | | 518 | 31 | 0,01 |
| 9,750 % fällig am 17.05.2035 ^ | | 280 | 13 | 0,00 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 6,700 % fällig am 16.02.2032 | | 4.318 | 3.302 | 0,62 |
| 6,750 % fällig am 21.09.2047 | | 32 | 20 | 0,00 |
| **Roadster Finance DAC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 08.12.2032 | € | 100 | 87 | 0,02 |
| **Royal Caribbean Cruises Ltd.** | | | | |
| 10,875 % fällig am 01.06.2023 | $ | 448 | 451 | 0,08 |
| 11,500 % fällig am 01.06.2025 | | 410 | 422 | 0,08 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 08.01.2026 | | 200 | 161 | 0,03 |
| 4,875 % fällig am 18.06.2030 | | 200 | 146 | 0,03 |
| 5,125 % fällig am 08.08.2025 | | 200 | 168 | 0,03 |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028 | | 400 | 309 | 0,06 |
| **Seagate HDD Cayman** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.01.2031 | | 62 | 51 | 0,01 |
| **Topaz Solar Farms LLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.09.2039 | | 73 | 64 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 30.09.2039 | | 631 | 574 | 0,11 |
| **Transocean, Inc.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 01.11.2025 | | 42 | 31 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 7,500 % fällig am 15.01.2026 | $ | 36 | $ 26 | 0,00 |
| 8,000 % fällig am 01.02.2027 | | 164 | 110 | 0,02 |
| **U.S. Renal Care, Inc.** | | | | |
| 10,625 % fällig am 15.07.2027 | | 90 | 34 | 0,01 |
| **United Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,150 % fällig am 11.10.2025 | | 8 | 8 | 0,00 |
| 5,875 % fällig am 15.04.2029 | | 5.947 | 5.853 | 1,11 |
| **United Group BV** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.07.2024 | € | 100 | 95 | 0,02 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.02.2025 | $ | 1.559 | 1.470 | 0,28 |
| **Valaris Ltd. (8,250 % bar oder 12,000 % PIK)** | | | | |
| 8,250 % fällig am 30.04.2028 (b) | | 16 | 16 | 0,00 |
| **Western Midstream Operating LP** | | | | |
| 2,621 % fällig am 13.01.2023 | | 60 | 60 | 0,01 |
| **Windstream Escrow LLC** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.08.2028 | | 1.753 | 1.416 | 0,27 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.12.2029 | | 1.840 | 1.145 | 0,22 |
| | | | 38.633 | 7,30 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC** | | | | |
| 2,950 % fällig am 27.01.2029 | | 5.100 | 1.530 | 0,29 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | | |
| 6,720 % fällig am 01.12.2022 ^ | | 5 | 4 | 0,00 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 01.03.2026 ^ | | 1.171 | 1.065 | 0,20 |
| 3,250 % fällig am 15.06.2023 ^ | | 625 | 616 | 0,12 |
| 3,250 % fällig am 01.06.2031 | | 2.460 | 1.989 | 0,38 |
| 3,300 % fällig am 15.03.2027 ^ | | 324 | 290 | 0,06 |
| 3,400 % fällig am 15.08.2024 ^ | | 403 | 388 | 0,07 |
| 3,450 % fällig am 01.07.2025 | | 1.102 | 1.037 | 0,20 |
| 3,500 % fällig am 15.06.2025 ^ | | 1.891 | 1.793 | 0,34 |
| 3,750 % fällig am 01.07.2028 | | 1.102 | 974 | 0,18 |
| 3,750 % fällig am 15.08.2042 ^ | | 20 | 14 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 01.12.2046 ^ | | 8 | 6 | 0,00 |
| 4,200 % fällig am 01.03.2029 | | 1.000 | 894 | 0,17 |
| 4,250 % fällig am 15.03.2046 ^ | | 6 | 4 | 0,00 |
| 4,300 % fällig am 15.03.2045 ^ | | 236 | 172 | 0,03 |
| 4,450 % fällig am 15.04.2042 ^ | | 145 | 109 | 0,02 |
| 4,500 % fällig am 01.07.2040 | | 240 | 186 | 0,04 |
| 4,500 % fällig am 15.12.2041 ^ | | 30 | 22 | 0,00 |
| 4,600 % fällig am 15.06.2043 ^ | | 56 | 43 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 15.02.2044 ^ | | 190 | 146 | 0,03 |
| 4,950 % fällig am 01.07.2050 | | 2.011 | 1.608 | 0,30 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 6,250 % fällig am 14.12.2026 | £ | 1.196 | 1.412 | 0,27 |
| **PG&E Wildfire Recovery Funding LLC** | | | | |
| 4,451 % fällig am 01.12.2049 | $ | 1.100 | 1.111 | 0,21 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | | |
| 8,200 % fällig am 06.04.2028 | | 224 | 233 | 0,04 |
| **Southern California Edison Co.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.03.2049 | | 13 | 12 | 0,00 |
| **Sprint Corp.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 01.03.2026 | | 47 | 50 | 0,01 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2023 | | 2.681 | 2.772 | 0,53 |
| **Transocean Phoenix Ltd.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.10.2024 | | 11 | 11 | 0,00 |
| | | | 18.491 | 3,50 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 103.023 | 19,48 |
| **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 2021** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.07.2033 (d) | | 124 | 70 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2033 | | 97 | 89 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2035 | | 87 | 78 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2037 | | 75 | 66 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2041 | | 74 | 64 | 0,01 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2022** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.11.2043 | | 482 | 240 | 0,05 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Notes, Series 2021** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.07.2024 (d) | $ | 50 | $ 46 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 01.07.2023 | | 108 | 110 | 0,02 |
| 5,625 % fällig am 01.07.2029 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010** | | | | |
| 6,630 % fällig am 01.02.2035 | | 30 | 32 | 0,01 |
| 7,350 % fällig am 01.07.2035 | | 15 | 16 | 0,00 |
| **Puerto Rico Electric Power Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | | |
| 6,125 % fällig am 01.07.2040 ^ | | 200 | 161 | 0,03 |
| | | | 980 | 0,19 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 4,376 % fällig am 25.11.2049 (a) | | 118 | 21 | 0,00 |
| 6,644 % fällig am 25.07.2033 (a) | | 51 | 7 | 0,00 |
| **Freddie Mac** | | | | |
| 5,226 % fällig am 15.06.2042 (a) | | 44 | 7 | 0,00 |
| **Ginnie Mae, TBA** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.07.2052 | | 3.600 | 3.499 | 0,66 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2052 | | 2.300 | 2.291 | 0,43 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2052 | | 16.400 | 16.583 | 3,14 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.03.2050 | | 377 | 353 | 0,07 |
| 3,500 % fällig am 01.04.2048 - 01.02.2050 | | 588 | 574 | 0,11 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2039 - 01.05.2047 | | 677 | 677 | 0,13 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 | | 3.600 | 3.239 | 0,61 |
| 3,000 % fällig am 01.07.2037 - 01.08.2052 | | 20.200 | 18.938 | 3,58 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2052 | | 40.350 | 38.771 | 7,33 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2052 | | 31.500 | 31.018 | 5,87 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2052 | | 4.500 | 4.509 | 0,85 |
| | | | 120.487 | 22,78 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.11.2046 | | 2.200 | 2.007 | 0,38 |
| 3,000 % fällig am 15.11.2045 | | 4.800 | 4.464 | 0,85 |
| 3,000 % fällig am 15.08.2048 | | 20 | 19 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 15.02.2049 | | 3.500 | 3.337 | 0,63 |
| 3,125 % fällig am 15.02.2043 | | 114 | 108 | 0,02 |
| 3,375 % fällig am 15.05.2044 | | 20 | 20 | 0,00 |
| 3,625 % fällig am 15.08.2043 | | 372 | 382 | 0,07 |
| 3,625 % fällig am 15.02.2044 | | 280 | 288 | 0,06 |
| 3,750 % fällig am 15.11.2043 | | 160 | 167 | 0,03 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (f)** | | | | |
| 0,250 % fällig am 15.02.2050 | | 1.124 | 889 | 0,17 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2042 | | 128 | 117 | 0,02 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2045 | | 982 | 881 | 0,17 |
| 0,875 % fällig am 15.02.2047 | | 1.197 | 1.109 | 0,21 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2046 | | 488 | 463 | 0,09 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2048 | | 1.524 | 1.458 | 0,28 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2049 | | 3.687 | 3.556 | 0,67 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 | | 124 | 127 | 0,02 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2041 | | 132 | 154 | 0,03 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 1,250 % fällig am 30.06.2028 | | 14.000 | 12.596 | 2,38 |
| 1,500 % fällig am 15.08.2026 | | 200 | 188 | 0,04 |
| 2,250 % fällig am 15.11.2025 | | 1.030 | 1.003 | 0,19 |
| 2,375 % fällig am 31.03.2029 | | 3.200 | 3.064 | 0,58 |
| 2,625 % fällig am 31.01.2026 | | 9.200 | 9.069 | 1,71 |
| 2,625 % fällig am 15.02.2029 | | 160 | 156 | 0,03 |
| 2,750 % fällig am 15.02.2028 | | 600 | 590 | 0,11 |
| 2,875 % fällig am 15.08.2028 | | 120 | 119 | 0,02 |
| 2,875 % fällig am 30.04.2029 | | 8.700 | 8.599 | 1,63 |
| 2,875 % fällig am 15.05.2032 | | 930 | 920 | 0,17 |
| | | | 55.850 | 10,56 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | | |
| 1,396 % fällig am 25.11.2046 | | 4.534 | 1.480 | 0,28 |
| **Banc of America Funding Corp.** | | | | |
| 4,017 % fällig am 25.09.2048 | | 1.968 | 1.860 | 0,35 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 2,772 % fällig am 20.05.2036 ^ | $ | 41 | $ 38 | 0,01 |
| **Bear Stearns Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,064 % fällig am 25.08.2036 | | 948 | 863 | 0,16 |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 224 | 198 | 0,04 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,904 % fällig am 25.06.2037 | | 1.950 | 1.712 | 0,32 |
| 2,924 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 260 | 194 | 0,04 |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 2.143 | 1.742 | 0,33 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,284 % fällig am 25.02.2035 | | 665 | 551 | 0,10 |
| **Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust** | | | | |
| 6,500 % fällig am 25.11.2034 ^ | | 254 | 240 | 0,05 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 2,290 % fällig am 13.09.2045 | £ | 3.481 | 4.108 | 0,78 |
| 2,540 % fällig am 13.06.2045 | | 1.496 | 1.802 | 0,34 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,024 % fällig am 25.10.2046 | $ | 430 | 396 | 0,08 |
| **Grifonas Finance PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 28.08.2039 | € | 237 | 234 | 0,04 |
| **GSMPS Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 7,064 % fällig am 20.10.2032 | $ | 1.536 | 1.393 | 0,26 |
| **GSMSC Resecuritization Trust** | | | | |
| 9,289 % fällig am 26.04.2037 | | 7.355 | 2.294 | 0,43 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | | |
| 2,690 % fällig am 25.04.2037 | | 29 | 26 | 0,01 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | | |
| 2,856 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 95 | 81 | 0,02 |
| 3,350 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 36 | 31 | 0,01 |
| **Legacy Mortgage Asset Trust** | | | | |
| 3,383 % fällig am 28.01.2070 | | 2.440 | 2.439 | 0,46 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | | |
| 2,724 % fällig am 25.09.2037 | | 7.300 | 3.486 | 0,66 |
| **Morgan Stanley Capital Trust** | | | | |
| 3,274 % fällig am 15.07.2035 | | 3.026 | 2.869 | 0,54 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,884 % fällig am 25.04.2035 | | 72 | 69 | 0,01 |
| **RBSGC Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 18 | 17 | 0,00 |
| **Sandwell Commercial Finance PLC** | | | | |
| 1,584 % fällig am 30.09.2037 | £ | 23 | 23 | 0,01 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,876 % fällig am 25.05.2035 ^ | $ | 125 | 100 | 0,02 |
| 3,011 % fällig am 25.09.2035 | | 60 | 48 | 0,01 |
| **Sutherland Commercial Mortgage Loans** | | | | |
| 3,192 % fällig am 25.05.2037 | | 149 | 149 | 0,03 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 1,144 % fällig am 25.12.2046 ^ | | 2.307 | 2.018 | 0,38 |
| 1,723 % fällig am 25.08.2046 | | 892 | 814 | 0,15 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,074 % fällig am 25.05.2035 ^ | | 320 | 274 | 0,05 |
| **Wells Fargo Alternative Loan Trust** | | | | |
| 6,250 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 1.196 | 1.078 | 0,20 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,609 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 14 | 13 | 0,00 |
| | | | 32.640 | 6,17 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,104 % fällig am 25.04.2036 | | 7.820 | 7.020 | 1,33 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.03.2035 ^ | | 659 | 632 | 0,12 |
| **Ameriquest Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,134 % fällig am 25.04.2036 | | 1.282 | 1.277 | 0,24 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,599 % fällig am 25.07.2035 | | 3.990 | 3.790 | 0,72 |
| 2,599 % fällig am 25.09.2035 | | 1.635 | 1.416 | 0,27 |
| **Argent Securities Trust** | | | | |
| 1,924 % fällig am 25.07.2036 | | 5.567 | 4.931 | 0,93 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | |
| 2,449 % fällig am 25.08.2033 | | 47 | 47 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 3,574 % fällig am 25.11.2039 | $ 415 | $ 409 | 0,08 |
| **Castlelake Aircraft Securitization Trust** | | | |
| 4,125 % fällig am 15.06.2043 | 693 | 624 | 0,12 |
| **Conseco Finance Corp.** | | | |
| 6,280 % fällig am 01.09.2030 | 331 | 334 | 0,06 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | |
| 1,874 % fällig am 25.11.2047 ^ | 5.054 | 4.462 | 0,84 |
| 1,884 % fällig am 25.12.2036 ^ | 2.112 | 1.919 | 0,36 |
| 2,689 % fällig am 25.08.2035 | 2.056 | 2.040 | 0,38 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | |
| 3,136 % fällig am 25.01.2037 ^ | 176 | 66 | 0,01 |
| **Fieldstone Mortgage Investment Trust** | | | |
| 1,246 % fällig am 25.11.2036 | 1.868 | 1.220 | 0,23 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,744 % fällig am 25.12.2036 | 4.831 | 4.513 | 0,85 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | |
| 1,774 % fällig am 25.01.2037 | 1.538 | 734 | 0,14 |
| **GSAMP Trust** | | | |
| 1,994 % fällig am 25.03.2047 | 9.000 | 7.594 | 1,44 |
| **Harley Marine Financing LLC** | | | |
| 5,682 % fällig am 15.05.2043 | 87 | 84 | 0,02 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | |
| 1,744 % fällig am 25.04.2037 | 1.920 | 1.326 | 0,25 |
| 1,784 % fällig am 25.11.2036 | 3.905 | 3.419 | 0,65 |
| 1,794 % fällig am 25.04.2037 | 1.988 | 1.377 | 0,26 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | |
| 1,764 % fällig am 25.01.2037 | 5.320 | 4.253 | 0,80 |
| **Lehman XS Trust** | | | |
| 2,424 % fällig am 25.10.2035 | 36 | 36 | 0,01 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,984 % fällig am 25.03.2046 | 3.396 | 2.888 | 0,55 |
| 2,224 % fällig am 25.01.2036 | 2.841 | 2.623 | 0,50 |
| **Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust** | | | |
| 4,874 % fällig am 25.03.2032 | 822 | 823 | 0,15 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,144 % fällig am 25.06.2036 | 394 | 357 | 0,07 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | |
| 1,734 % fällig am 25.02.2037 | 755 | 427 | 0,08 |
| 1,774 % fällig am 25.02.2037 | 2.343 | 1.326 | 0,25 |
| 1,874 % fällig am 25.03.2037 | 8.484 | 4.069 | 0,77 |
| 2,419 % fällig am 25.01.2035 | 1.044 | 994 | 0,19 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,404 % fällig am 25.03.2035 | 72 | 69 | 0,01 |
| 3,649 % fällig am 25.05.2034 ^ | 354 | 368 | 0,07 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,944 % fällig am 25.01.2036 ^ | 5.365 | 5.175 | 0,98 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | |
| 4,934 % fällig am 25.08.2035 | 29 | 29 | 0,01 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | |
| 1,864 % fällig am 25.09.2036 | 360 | 359 | 0,07 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | |
| 3,374 % fällig am 25.12.2037 | 1.976 | 1.939 | 0,37 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | |
| 2,089 % fällig am 25.06.2036 ^ | 7.537 | 6.248 | 1,18 |
| 2,624 % fällig am 25.09.2037 | 6.124 | 4.716 | 0,89 |
| 2,659 % fällig am 25.05.2035 | 1.478 | 1.449 | 0,27 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | |
| 2,404 % fällig am 25.07.2035 | 14 | 14 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,964 % fällig am 25.12.2036 | 161 | 158 | 0,03 |
| 2,124 % fällig am 25.11.2037 | 2.600 | 2.381 | 0,45 |
| 2,749 % fällig am 25.07.2035 | 1.220 | 1.165 | 0,22 |
| **TruPS Financials Note Securitization Ltd.** | | | |
| 3,666 % fällig am 20.09.2039 | 2.348 | 2.219 | 0,42 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,044 % fällig am 25.03.2037 | 9 | 8 | 0,00 |
| | | 93.327 | 17,65 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | |
| 0,500 % fällig am 09.07.2030 | 5.595 | 1.214 | 0,23 |
| 1,000 % fällig am 09.07.2029 | 377 | 89 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 1,125 % fällig am 09.07.2035 | $ | 2.879 | $ 600 | 0,11 |
| 1,125 % fällig am 09.07.2046 | | 115 | 27 | 0,01 |
| 15,500 % fällig am 17.10.2026 | ARS | 3.906 | 5 | 0,00 |
| 47,331 % fällig am 04.10.2022 | | 730 | 1 | 0,00 |
| **Argentina Treasury Bond BONCER** | | | | |
| 1,400 % fällig am 25.03.2023 | | 56.095 | 206 | 0,04 |
| **Australia Government International Bond** | | | | |
| 1,750 % fällig am 21.06.2051 | AUD | 2.200 | 963 | 0,18 |
| **Autonomous City of Buenos Aires Argentina** | | | | |
| 52,234 % fällig am 22.02.2028 (a) | ARS | 27.495 | 99 | 0,02 |
| **Export-Credit Bank of Turkey** | | | | |
| 8,250 % fällig am 24.01.2024 | $ | 200 | 197 | 0,04 |
| **Israel Government International Bond** | | | | |
| 3,800 % fällig am 13.05.2060 | | 2.400 | 2.006 | 0,38 |
| 4,500 % fällig am 03.04.2120 | | 200 | 182 | 0,03 |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,350 % fällig am 12.08.2040 | PEN | 922 | 182 | 0,03 |
| 5,400 % fällig am 12.08.2034 | | 750 | 159 | 0,03 |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | | 2.330 | 561 | 0,11 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 9.873 | 2.298 | 0,44 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 | | 468 | 116 | 0,02 |
| 6,950 % fällig am 12.08.2031 | | 133 | 33 | 0,01 |
| 8,200 % fällig am 12.08.2026 | | 1.040 | 286 | 0,05 |
| **Provincia de Buenos Aires** | | | | |
| 49,102 % fällig am 12.04.2025 | ARS | 14.289 | 48 | 0,01 |
| **Republic of Greece Government International Bond** | | | | |
| 3,500 % fällig am 30.01.2023 | € | 31 | 33 | 0,01 |
| 3,750 % fällig am 30.01.2028 | | 58 | 63 | 0,01 |
| 3,900 % fällig am 30.01.2033 | | 61 | 65 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 30.01.2037 | | 36 | 40 | 0,01 |
| 4,200 % fällig am 30.01.2042 | | 11 | 12 | 0,00 |
| **Russia Government International Bond** | | | | |
| 0,000 % fällig am 24.04.2024 ^ | RUB | 187.500 | 308 | 0,06 |
| 4,250 % fällig am 23.06.2027 ^ | $ | 200 | 55 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 27.05.2026 | | 400 | 108 | 0,02 |
| 5,100 % fällig am 28.03.2035 ^ | | 200 | 53 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 23.06.2047 ^ | | 2.800 | 742 | 0,14 |
| 5,625 % fällig am 04.04.2042 ^ | | 1.400 | 413 | 0,08 |
| 5,875 % fällig am 16.09.2043 ^ | | 200 | 59 | 0,01 |
| 7,150 % fällig am 12.11.2025 ^ | RUB | 214.863 | 353 | 0,07 |
| 7,500 % fällig am 31.03.2030 ^ | $ | 202 | 56 | 0,01 |
| 7,950 % fällig am 07.10.2026 ^ | RUB | 82.843 | 136 | 0,03 |
| 12,750 % fällig am 24.06.2028 ^ | $ | 185 | 51 | 0,01 |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 8,000 % fällig am 31.01.2030 | ZAR | 2.600 | 138 | 0,03 |
| 8,250 % fällig am 31.03.2032 | | 4.300 | 220 | 0,04 |
| 8,750 % fällig am 28.02.2048 | | 2.100 | 99 | 0,02 |
| 8,875 % fällig am 28.02.2035 | | 3.000 | 154 | 0,03 |
| 10,500 % fällig am 21.12.2026 | | 102.900 | 6.652 | 1,26 |
| **Turkey Government International Bond** | | | | |
| 4,250 % fällig am 13.03.2025 | $ | 1.800 | 1.549 | 0,29 |
| 4,625 % fällig am 31.03.2025 | € | 200 | 194 | 0,04 |
| **Venezuela Government International Bond** | | | | |
| 6,000 % fällig am 09.12.2020 ^ | $ | 289 | 22 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 31.03.2038 ^ | | 107 | 9 | 0,00 |
| 7,650 % fällig am 21.04.2025 ^ | | 266 | 23 | 0,00 |
| 8,250 % fällig am 13.10.2024 ^ | | 269 | 23 | 0,00 |
| 9,000 % fällig am 07.05.2023 ^ | | 144 | 12 | 0,00 |
| 9,250 % fällig am 15.09.2027 ^ | | 301 | 26 | 0,01 |
| 9,250 % fällig am 07.05.2028 ^ | | 256 | 22 | 0,00 |
| 11,750 % fällig am 21.10.2026 ^ | | 40 | 4 | 0,00 |
| 11,950 % fällig am 05.08.2031 ^ | | 400 | 35 | 0,01 |
| 12,750 % fällig am 23.08.2022 ^ | | 180 | 16 | 0,00 |
| | | | 21.017 | 3,98 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| AT&T, Inc. | 241.479 | 5.061 | 0,96 |
| BCE, Inc. | 400 | 20 | 0,00 |
| Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (c) | 320.208 | 343 | 0,07 |
| Deutsche Telekom AG | 6.487 | 129 | 0,02 |
| iHeartMedia, Inc. 'A' (c) | 75.157 | 593 | 0,11 |
| iHeartMedia, Inc. 'B' (c) | 58.371 | 415 | 0,08 |
| KDDI Corp. | 22.300 | 702 | 0,13 |
| Lumen Technologies, Inc. | 196.499 | 2.144 | 0,41 |
| Nintendo Co. Ltd. | 600 | $ 258 | 0,05 |
| Nippon Telegraph & Telephone Corp. | 50.600 | 1.452 | 0,27 |
| Omnicom Group, Inc. | 1.463 | 93 | 0,02 |
| Orange S.A. | 46.491 | 547 | 0,10 |
| PCCW Ltd. | 63.000 | 33 | 0,01 |
| Proximus SADP | 5.190 | 76 | 0,01 |
| Publicis Groupe S.A. (c) | 813 | 40 | 0,01 |
| SoftBank Corp. | 192.200 | 2.131 | 0,40 |
| Spark New Zealand Ltd. | 13.385 | 40 | 0,01 |
| Telefonica Deutschland Holding AG | 40.791 | 117 | 0,02 |
| Telefonica S.A. | 633.750 | 3.228 | 0,61 |
| Telenet Group Holding NV | 1.487 | 31 | 0,01 |
| Telenor ASA | 4.378 | 58 | 0,01 |
| Telia Co. AB | 6.039 | 23 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 48.638 | 2.468 | 0,47 |
| Vodafone Group PLC | 212.769 | 330 | 0,06 |
| | | 20.332 | 3,84 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Aisin Corp. (c) | 1.800 | 56 | 0,01 |
| Bridgestone Corp. | 6.300 | 229 | 0,04 |
| Cie Generale des Etablissements Michelin S.C.A. | 932 | 25 | 0,01 |
| Harvey Norman Holdings Ltd. | 30.450 | 78 | 0,02 |
| Haseko Corp. | 11.500 | 135 | 0,03 |
| Hennes & Mauritz AB 'B' | 1.360 | 16 | 0,00 |
| Home Depot, Inc. | 258 | 71 | 0,01 |
| Honda Motor Co. Ltd. | 15.300 | 368 | 0,07 |
| Isuzu Motors Ltd. | 10.900 | 120 | 0,02 |
| McDonald's Corp. | 299 | 74 | 0,01 |
| Mercedes-Benz Group AG | 1.356 | 79 | 0,02 |
| Newell Brands, Inc. | 717 | 14 | 0,00 |
| NGK Spark Plug Co. Ltd. | 1.500 | 27 | 0,01 |
| Persimmon PLC | 23.957 | 544 | 0,10 |
| Sankyo Co. Ltd. | 2.500 | 75 | 0,01 |
| Sekisui House Ltd. | 10.700 | 188 | 0,04 |
| Sumitomo Rubber Industries Ltd. | 8.900 | 76 | 0,01 |
| Wesfarmers Ltd. | 2.156 | 62 | 0,01 |
| Yamaha Motor Co. Ltd. | 4.300 | 79 | 0,02 |
| | | 2.316 | 0,44 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Altria Group, Inc. | 121.414 | 5.071 | 0,96 |
| British American Tobacco PLC | 60.295 | 2.578 | 0,49 |
| Coca-Cola Co. | 2.257 | 142 | 0,03 |
| Coles Group Ltd. | 3.551 | 44 | 0,01 |
| Danone S.A. | 2.665 | 149 | 0,03 |
| Essity AB 'B' | 682 | 18 | 0,00 |
| Imperial Brands PLC | 58.938 | 1.316 | 0,25 |
| Japan Tobacco, Inc. | 106.100 | 1.836 | 0,35 |
| Kellogg Co. | 1.205 | 86 | 0,01 |
| Kimberly-Clark Corp. | 225 | 30 | 0,01 |
| Kirin Holdings Co. Ltd. | 1.700 | 27 | 0,01 |
| Koninklijke Ahold Delhaize NV | 5.608 | 146 | 0,03 |
| Kraft Heinz Co. | 4.477 | 171 | 0,03 |
| METRO AG | 6.725 | 57 | 0,01 |
| Neiman Marcus Group Ltd. LLC (c)(k) | 8.644 | 1.494 | 0,28 |
| Nestle S.A. | 1.525 | 178 | 0,03 |
| PepsiCo, Inc. | 738 | 123 | 0,02 |
| Philip Morris International, Inc. | 21.569 | 2.130 | 0,40 |
| Procter & Gamble Co. | 623 | 90 | 0,02 |
| Seven & i Holdings Co. Ltd. | 2.300 | 89 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| Sonae SGPS S.A. | 17.282 | $ 21 | 0,00 |
| Walgreens Boots Alliance, Inc. | 15.131 | 573 | 0,11 |
| | | 16.369 | 3,10 |
| **ENERGIE** | | | |
| Baker Hughes Co. | 1.800 | 52 | 0,01 |
| BP PLC | 67.940 | 318 | 0,06 |
| Canadian Natural Resources Ltd. | 1.836 | 98 | 0,02 |
| Chevron Corp. | 44.623 | 6.461 | 1,22 |
| ConocoPhillips | 4.075 | 366 | 0,07 |
| Enbridge, Inc. | 26.064 | 1.098 | 0,21 |
| ENEOS Holdings, Inc. | 130.000 | 489 | 0,09 |
| Eni SpA | 50.260 | 595 | 0,11 |
| Euronav NV | 5.336 | 64 | 0,01 |
| Exxon Mobil Corp. | 81.943 | 7.017 | 1,34 |
| Galp Energia SGPS S.A. | 11.559 | 135 | 0,02 |
| Inpex Corp. | 13.200 | 141 | 0,03 |
| Keyera Corp. | 1.855 | 42 | 0,01 |
| Kinder Morgan, Inc. | 107.121 | 1.795 | 0,34 |
| Marathon Petroleum Corp. | 16.031 | 1.318 | 0,25 |
| Noble Corp. (c)(k) | 26.555 | 673 | 0,13 |
| OMV AG | 3.517 | 165 | 0,03 |
| ONEOK, Inc. | 16.295 | 904 | 0,17 |
| Pembina Pipeline Corp. | 1.846 | 65 | 0,01 |
| Phillips 66 | 15.881 | 1.302 | 0,25 |
| Repsol S.A. | 55.460 | 816 | 0,15 |
| SFL Corp. Ltd. | 10.587 | 101 | 0,02 |
| Suncor Energy, Inc. | 1.111 | 39 | 0,01 |
| TC Energy Corp. | 2.058 | 106 | 0,02 |
| TotalEnergies SE | 83.855 | 4.403 | 0,83 |
| Valaris Ltd. (c) | 1.324 | 56 | 0,01 |
| Valero Energy Corp. | 37.234 | 3.957 | 0,75 |
| Williams Cos., Inc. | 43.941 | 1.371 | 0,26 |
| Woodside Energy Group Ltd. | 36.378 | 797 | 0,15 |
| Woodside Energy Group Ltd. (c) | 3.335 | 71 | 0,01 |
| | | 34.815 | 6,59 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| ABN AMRO Bank NV | 19.813 | 222 | 0,04 |
| Ageas S.A. | 4.843 | 213 | 0,04 |
| Allstate Corp. | 375 | 48 | 0,01 |
| American International Group, Inc. | 1.165 | 60 | 0,01 |
| Aozora Bank Ltd. | 5.500 | 107 | 0,02 |
| Assicurazioni Generali SpA | 78.895 | 1.257 | 0,24 |
| Australia & New Zealand Banking Group Ltd. | 38.155 | 579 | 0,11 |
| Aviva PLC | 78.837 | 385 | 0,07 |
| AXA S.A. | 104.767 | 2.387 | 0,45 |
| Bank of Nova Scotia | 1.808 | 107 | 0,02 |
| Blackstone Group, Inc. | 504 | 46 | 0,01 |
| BNP Paribas S.A. | 1.804 | 86 | 0,02 |
| Cairo Mezz PLC (c) | 59.349 | 9 | 0,00 |
| Citigroup, Inc. | 3.947 | 182 | 0,03 |
| Citizens Financial Group, Inc. | 2.565 | 92 | 0,02 |
| Comerica, Inc. | 1.924 | 141 | 0,03 |
| Commonwealth Bank of Australia | 4.145 | 258 | 0,05 |
| Credit Agricole S.A. | 23.403 | 215 | 0,04 |
| Daiwa Securities Group, Inc. | 71.500 | 320 | 0,06 |
| Direct Line Insurance Group PLC | 45.406 | 139 | 0,03 |
| DNB Bank ASA | 1.222 | 22 | 0,00 |
| Eurobank Ergasias Services and Holdings S.A. 'A' (c) | 712.189 | 637 | 0,12 |
| Franklin Resources, Inc. | 2.484 | 58 | 0,01 |
| Gjensidige Forsikring ASA | 2.262 | $ 46 | 0,01 |
| Huntington Bancshares, Inc. | 3.003 | 36 | 0,01 |
| ING Groep NV | 19.104 | 188 | 0,04 |
| Intelsat Emergence S.A. (c)(k) | 54.795 | 1.534 | 0,29 |
| Japan Post Bank Co. Ltd. (c) | 2.300 | 18 | 0,00 |
| Japan Post Insurance Co. Ltd. (c) | 2.800 | 45 | 0,01 |
| JPMorgan Chase & Co. | 1.522 | 171 | 0,03 |
| KeyCorp. | 5.862 | 101 | 0,02 |
| Legal & General Group PLC | 66.774 | 195 | 0,04 |
| M&G PLC | 217.151 | 514 | 0,10 |
| M&T Bank Corp. | 657 | 105 | 0,02 |
| Mapfre S.A. | 107.897 | 190 | 0,04 |
| Medibank Pvt Ltd. | 15.620 | 35 | 0,01 |
| Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA (c) | 7.141 | 62 | 0,01 |
| MetLife, Inc. | 1.202 | 75 | 0,01 |
| Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. | 97.329 | 520 | 0,10 |
| Mizuho Financial Group, Inc. | 29.750 | 338 | 0,06 |
| MS&AD Insurance Group Holdings, Inc. | 12.000 | 367 | 0,07 |
| Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | 72 | 17 | 0,00 |
| National Australia Bank Ltd. | 8.626 | 163 | 0,03 |
| Navient Corp. | 7.481 | 105 | 0,02 |
| NN Group NV | 5.630 | 254 | 0,05 |
| Nomura Holdings, Inc. | 63.000 | 229 | 0,04 |
| Nordea Bank Abp | 98.306 | 867 | 0,16 |
| Old Republic International Corp. | 1.187 | 27 | 0,01 |
| ORIX Corp. | 11.200 | 187 | 0,04 |
| PNC Financial Services Group, Inc. | 164 | 26 | 0,00 |
| Power Corp. of Canada | 1.669 | 43 | 0,01 |
| Prudential Financial, Inc. | 5.688 | 544 | 0,10 |
| Regions Financial Corp. | 1.029 | 19 | 0,00 |
| Resona Holdings, Inc. | 57.200 | 214 | 0,04 |
| Sampo Oyj 'A' | 4.522 | 197 | 0,04 |
| Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A' | 13.194 | 130 | 0,02 |
| Sompo Holdings, Inc. | 2.400 | 106 | 0,02 |
| SpareBank 1 SR-Bank ASA | 1.345 | 15 | 0,00 |
| Stearns Holdings LLC 'B' (c) | 147.250 | 0 | 0,00 |
| Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. | 27.200 | 807 | 0,15 |
| Sumitomo Mitsui Trust Holdings, Inc. | 1.200 | 37 | 0,01 |
| Suncorp Group Ltd. | 43.954 | 334 | 0,06 |
| Swedbank AB 'A' | 26.136 | 331 | 0,06 |
| Swiss Re AG | 6.050 | 468 | 0,09 |
| Tokio Marine Holdings, Inc. (c) | 1.000 | 58 | 0,01 |
| Truist Financial Corp. | 600 | 28 | 0,01 |
| U.S. Bancorp | 3.479 | 160 | 0,03 |
| Unipol Gruppo SpA | 41.273 | 188 | 0,04 |
| UnipolSai Assicurazioni SpA | 10.614 | 25 | 0,00 |
| United Overseas Bank Ltd. | 1.800 | 34 | 0,01 |
| Unum Group | 4.391 | 149 | 0,03 |
| Voyager Aviation Holdings LLC (c) | 16 | 0 | 0,00 |
| Westpac Banking Corp. | 17.181 | 231 | 0,04 |
| Zurich Insurance Group AG | 724 | 315 | 0,06 |
| | | 18.418 | 3,48 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| AbbVie, Inc. | 15.257 | 2.337 | 0,44 |
| Amgen, Inc. | 2.379 | 579 | 0,11 |
| Astellas Pharma, Inc. | 2.600 | 40 | 0,01 |
| Bayer AG | 7.105 | $ 423 | 0,08 |
| Bristol-Myers Squibb Co. | 2.131 | 164 | 0,03 |
| Cardinal Health, Inc. | 5.789 | 303 | 0,06 |
| CVS Health Corp. | 2.014 | 187 | 0,04 |
| Gilead Sciences, Inc. | 21.075 | 1.303 | 0,25 |
| GlaxoSmithKline PLC | 20.213 | 435 | 0,08 |
| Johnson & Johnson | 4.502 | 799 | 0,15 |
| Merck & Co., Inc. | 14.314 | 1.305 | 0,25 |
| Novartis AG | 6.119 | 517 | 0,10 |
| Orion Oyj 'B' | 425 | 19 | 0,00 |
| Pfizer, Inc. | 52.691 | 2.762 | 0,52 |
| Roche Holding AG | 719 | 240 | 0,04 |
| Sanofi | 6.933 | 697 | 0,13 |
| Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. | 52.700 | 1.478 | 0,28 |
| | | 13.588 | 2,57 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| 3M Co. | 1.656 | 214 | 0,04 |
| ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A. | 20.368 | 495 | 0,09 |
| Adecco Group AG | 2.225 | 76 | 0,01 |
| ALD S.A. | 1.300 | 15 | 0,00 |
| Aurizon Holdings Ltd. | 182.507 | 478 | 0,09 |
| BAE Systems PLC | 38.889 | 393 | 0,07 |
| Bouygues S.A. | 23.975 | 738 | 0,14 |
| Caterpillar, Inc. | 134 | 24 | 0,01 |
| Daimler Truck Holding AG (c) | 439 | 12 | 0,00 |
| Deutsche Post AG | 3.799 | 143 | 0,03 |
| Eaton Corp. PLC | 249 | 31 | 0,01 |
| Emerson Electric Co. | 283 | 23 | 0,00 |
| Fletcher Building Ltd. | 4.588 | 14 | 0,00 |
| General Dynamics Corp. | 200 | 44 | 0,01 |
| ITOCHU Corp. | 1.400 | 38 | 0,01 |
| Kajima Corp. | 10.200 | 117 | 0,02 |
| ManpowerGroup, Inc. | 289 | 22 | 0,00 |
| Marubeni Corp. | 85.800 | 769 | 0,15 |
| Mitsubishi Corp. | 44.700 | 1.330 | 0,25 |
| Mitsubishi Electric Corp. | 3.500 | 38 | 0,01 |
| Mitsubishi Heavy Industries Ltd. | 5.700 | 199 | 0,04 |
| Mitsui & Co. Ltd. | 13.900 | 305 | 0,06 |
| Mitsui OSK Lines Ltd. | 19.300 | 443 | 0,08 |
| Nippon Yusen KK | 8.300 | 568 | 0,11 |
| NWS Holdings Ltd. | 19.000 | 18 | 0,00 |
| Obayashi Corp. (c) | 6.400 | 46 | 0,01 |
| Oesterreichische Post AG | 594 | 17 | 0,00 |
| Securitas AB 'B' | 4.500 | 39 | 0,01 |
| Sojitz Corp. | 3.440 | 49 | 0,01 |
| Sumitomo Corp. | 68.900 | 935 | 0,18 |
| Taisei Corp. | 3.300 | 103 | 0,02 |
| Union Pacific Corp. | 220 | 47 | 0,01 |
| United Parcel Service, Inc. 'B' | 215 | 39 | 0,01 |
| | | 7.822 | 1,48 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Broadcom, Inc. | 98 | 48 | 0,01 |
| Canon, Inc. | 41.400 | 937 | 0,18 |
| Cisco Systems, Inc. | 20.508 | 874 | 0,17 |
| Hewlett Packard Enterprise Co. | 19.513 | 259 | 0,05 |
| HP, Inc. | 4.594 | 151 | 0,03 |
| Intel Corp. | 4.825 | 180 | 0,03 |
| International Business Machines Corp. | 18.060 | 2.550 | 0,48 |
| Juniper Networks, Inc. | 1.704 | 49 | 0,01 |
| Konica Minolta, Inc. | 95.100 | 316 | 0,06 |
| Kyndryl Holdings, Inc. (c) | 1.600 | 16 | 0,00 |
| NetApp, Inc. | 768 | 50 | 0,01 |
| Nippon Electric Glass Co. Ltd. | 3.800 | 73 | 0,01 |
| SAP SE | 243 | 22 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| Seiko Epson Corp. | 8.100 | $ 114 | 0,02 |
| Texas Instruments, Inc. | 347 | 53 | 0,01 |
| Venture Corp. Ltd. | 2.200 | 26 | 0,01 |
| Western Union Co. | 5.526 | 91 | 0,02 |
| Xerox Holdings Corp. | 6.713 | 100 | 0,02 |
| | | 5.909 | 1,12 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Amcor PLC | 4.892 | 61 | 0,01 |
| Anglo American PLC | 1.037 | 37 | 0,01 |
| BASF SE | 39.091 | 1.706 | 0,32 |
| BHP Group Ltd. | 190.053 | 5.410 | 1,02 |
| Covestro AG | 334 | 12 | 0,00 |
| Daicel Corp. (c) | 2.900 | 18 | 0,00 |
| Dow, Inc. | 8.765 | 452 | 0,09 |
| Evonik Industries AG | 2.478 | 53 | 0,01 |
| Evraz PLC | 72.869 | 72 | 0,01 |
| Fortescue Metals Group Ltd. | 80.859 | 969 | 0,18 |
| International Paper Co. | 1.254 | 52 | 0,01 |
| JFE Holdings, Inc. | 14.900 | 157 | 0,03 |
| LyondellBasell Industries NV 'A' | 4.224 | 369 | 0,07 |
| Mitsubishi Chemical Holdings Corp. | 8.400 | 46 | 0,01 |
| Navigator Co. S.A. | 5.252 | 21 | 0,00 |
| Newmont Corp. | 1.086 | 65 | 0,01 |
| Nippon Light Metal Holdings Co. Ltd. (c) | 3.500 | 38 | 0,01 |
| Nippon Steel Corp. | 6.100 | 85 | 0,02 |
| Norsk Hydro ASA | 21.551 | 121 | 0,02 |
| Nucor Corp. | 190 | 20 | 0,00 |
| Nutrien Ltd. | 433 | 34 | 0,01 |
| Rio Tinto Ltd. | 27.333 | 1.943 | 0,37 |
| Rio Tinto PLC | 36.345 | 2.168 | 0,41 |
| Smurfit Kappa Group PLC | 379 | 13 | 0,00 |
| Sumitomo Metal Mining Co. Ltd. | 1.400 | 43 | 0,01 |
| Sylvamo Corp. | 200 | 7 | 0,00 |
| Toyo Seikan Group Holdings Ltd. (c) | 3.200 | 34 | 0,01 |
| UBE Corp. | 2.300 | 34 | 0,01 |
| UPM-Kymmene Oyj | 3.545 | 108 | 0,02 |
| Yara International ASA | 3.218 | 134 | 0,03 |
| | | 14.282 | 2,70 |
| **IMMOBILIEN** | | | |
| Daito Trust Construction Co. Ltd. | 1.500 | 130 | 0,03 |
| Daiwa House Industry Co. Ltd. | 2.000 | 47 | 0,01 |
| Vonovia SE | 438 | 13 | 0,00 |
| | | 190 | 0,04 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| AGL Energy Ltd. | 19.927 | $ 113 | 0,02 |
| Chubu Electric Power Co., Inc. (c) | 2.000 | 20 | 0,00 |
| Consolidated Edison, Inc. | 706 | 67 | 0,01 |
| Constellation Energy Corp. | 480 | 27 | 0,01 |
| Duke Energy Corp. | 1.425 | 153 | 0,03 |
| E.ON SE | 6.844 | 58 | 0,01 |
| Electric Power Development Co. Ltd. 'C' | 4.900 | 81 | 0,01 |
| Endesa S.A. | 26.758 | 505 | 0,10 |
| Enel SpA | 26.474 | 145 | 0,03 |
| Engie S.A. | 1.544 | 18 | 0,00 |
| Exelon Corp. | 4.127 | 187 | 0,03 |
| FirstEnergy Corp. | 3.641 | 140 | 0,03 |
| Iberdrola S.A. | 2.503 | 26 | 0,00 |
| Kansai Electric Power Co., Inc. (c) | 3.400 | 34 | 0,01 |
| Naturgy Energy Group S.A. | 10.881 | 314 | 0,06 |
| PPL Corp. | 17.453 | 473 | 0,09 |
| Public Service Enterprise Group, Inc. | 300 | 19 | 0,00 |
| Southern Co. | 7.147 | 510 | 0,10 |
| SSE PLC | 2.256 | 44 | 0,01 |
| Tohoku Electric Power Co., Inc. (c) | 5.200 | 28 | 0,01 |
| | | 2.962 | 0,56 |
| | | 137.003 | 25,92 |
| **RECHTE** | | | |
| Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp 05/12/2025 | 11.842 | 58 | 0,01 |
| **WARRANTS** | | | |
| Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31. Dezember 2060 | 706 | 0 | 0,00 |
| Intelsat Emergence S.A. - Exp. 17. Februar 2027 | 1.128 | 3 | 0,00 |
| Windstream Holdings II, LLC - Exp. 21. September 2055 | 2.586 | 55 | 0,01 |
| | | 58 | 0,01 |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| Nationwide Building Society 10,250 % | 6.220 | 1.107 | 0,21 |
| Porsche Automobil Holding SE 0,000 % | 343 | 23 | 0,00 |
| Volkswagen AG 0,000 % | 1.260 | 169 | 0,03 |
| Voyager Aviation Holdings LLC 9,500 % | 93 | 28 | 0,01 |
| | | 1.327 | 0,25 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS** | | | |
| AGNC Investment Corp. | 34.594 | $ 383 | 0,07 |
| Annaly Capital Management, Inc. | 66.041 | 390 | 0,07 |
| CBL & Associates Properties, Inc. | 378 | 9 | 0,00 |
| Iron Mountain, Inc. | 7.730 | 376 | 0,07 |
| Japan Metropolitan Fund Investment Corp. | 24 | 19 | 0,00 |
| New Residential Investment Corp. | 31.815 | 297 | 0,06 |
| Primaris Real Estate Investment Trust | 443 | 4 | 0,00 |
| Simon Property Group, Inc. | 2.791 | 265 | 0,05 |
| Uniti Group, Inc. | 2.036 | 19 | 0,00 |
| VICI Properties, Inc. | 114.584 | 3.413 | 0,65 |
| Vornado Realty Trust | 875 | 25 | 0,01 |
| | | 5.200 | 0,98 |

| | | PARI (000S) | | |
|---|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | | |
| 51,049 % fällig am 30.09.2022 (d)(e) | ARS | 156.100 | 523 | 0,10 |
| **U.S. TREASURY BILLS** | | | | |
| 0,819 % fällig am 21.07.2022 (d)(e)(l) | $ | 251 | 251 | 0,05 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 774 | 0,15 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **$ 590.326** | **111,64** |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h) | 3.738.693 | 37.193 | 7,03 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$ 37.193** | **7,03** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 805 | U.S. Treasury Notes 3,000% fällig am 30.06.2024 | $ (821) | $ 805 | $ 805 | 0,15 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (821)** | **$ 805** | **$ 805** | **0,15** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 103 | $ 56 | 0,01 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Long | 09.2022 | 106 | (358) | (0,07) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 42 | 178 | 0,03 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 45 | (28) | (0,01) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 1.038 | (905) | (0,18) |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Long | 09.2022 | 11 | (16) | 0,00 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 156 | 196 | 0,04 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2022 | 126 | 350 | 0,07 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09.2022 | 8 | 40 | 0,01 |
| | | | | $ (487) | (0,10) |

## VERKAUFSOPTIONEN

### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CME Kaufoptionen mit Ausübungskurs von @USD 98,000 auf 3-Month SOFR December Futures | $ 98,000 | 15.12.2023 | 8 | $ (7) | $ (6) | 0,00 |
| Call - CME Verkaufoptionen mit Ausübungskurs von @USD 96,500 auf 3-Month SOFR December Futures | 96,500 | 15.12.2023 | 8 | (7) | (10) | 0,00 |
| | | | | $ (14) | $ (16) | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ (503)** | **(0,10)** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Boeing Co. | 1,000 % | 20.06.2026 | $ 1.000 | $ (34) | (0,01) |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2023 | 300 | 16 | 0,01 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.12.2022 | € 1.400 | (29) | (0,01) |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.12.2025 | 1.000 | 9 | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.06.2027 | 800 | (50) | (0,01) |
| | | | | $ (88) | (0,02) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-28 5-Year Index | 1,000 % | 20.12.2022 | $ 1.880 | $ (68) | (0,01) |
| CDX.EM-29 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2023 | 940 | (57) | (0,01) |
| CDX.EM-30 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2023 | 3.478 | (142) | (0,03) |
| CDX.EM-31 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 1.034 | (47) | (0,01) |
| CDX.EM-32 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2024 | 558 | (25) | (0,01) |
| CDX.EM-34 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2025 | 2.400 | (223) | (0,04) |
| CDX.EM-36 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 10.600 | (950) | (0,18) |
| CDX.HY-36 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2026 | 2.277 | (226) | (0,04) |
| CDX.HY-37 5-Year Index | 5,000 | 20.12.2026 | 891 | (59) | (0,01) |
| CDX.HY-38 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2027 | 34.848 | (1.849) | (0,35) |
| CDX.IG-38 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 800 | (12) | 0,00 |
| iTraxx Asia Ex-Japan 37 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 400 | (6) | 0,00 |
| | | | | $ (3.664) | (0,69) |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 % | 16.03.2042 | £ 500 | $ 154 | 0,03 |
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2032 | 7.200 | 567 | 0,11 |
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2052 | 5.600 | 2.096 | 0,40 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000 | 15.03.2029 | ¥ 2.430.000 | 433 | 0,08 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,020 | 20.09.2028 | 2.950.000 | 461 | 0,09 |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,176 | 27.04.2027 | 160.000 | (2) | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,400 | 15.06.2032 | 410.000 | 24 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,500 | 15.03.2042 | 220.000 | 46 | 0,01 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,711 % | 27.04.2042 | ¥ 40.000 | $ 9 | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 | 15.06.2027 | $ 15.700 | (1.037) | (0,20) |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 | 15.06.2027 | 1.200 | 52 | 0,01 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 | 15.06.2029 | 2.770 | (222) | (0,04) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,250 | 15.12.2028 | 3.900 | (349) | (0,07) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,250 | 15.06.2032 | 5.950 | (384) | (0,07) |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2027 | 26.000 | (151) | (0,03) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 15.06.2032 | 2.720 | (124) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,817 | 05.04.2032 | 2.200 | (166) | (0,03) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,872 | 06.04.2032 | 1.100 | (77) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,928 | 25.03.2027 | 1.100 | (36) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,830 | 02.01.2023 | BRL 10.900 | (37) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,836 | 02.01.2023 | 8.500 | (28) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,855 | 02.01.2023 | 2.800 | (9) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 6,170 | 02.01.2023 | 74.400 | (671) | (0,13) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,140 | 02.01.2025 | 1.300 | (7) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,160 | 02.01.2025 | 800 | (4) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,220 | 04.01.2027 | 1.500 | (10) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,245 | 04.01.2027 | 700 | (5) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,260 | 04.01.2027 | 800 | (5) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,350 | 02.01.2025 | 1.000 | (5) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,700 | 04.01.2027 | 400 | (2) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,715 | 04.01.2027 | 1.700 | (7) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,870 | 04.01.2027 | 4.000 | (13) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,000 | 02.01.2025 | 2.800 | (6) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,080 | 02.01.2025 | 4.700 | (9) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,140 | 02.01.2025 | 2.300 | (4) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,145 | 02.01.2025 | 2.300 | (4) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,160 | 02.01.2025 | 4.700 | (8) | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,670 | 02.01.2023 | 3.800 | 3 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,690 | 02.01.2023 | 2.600 | 2 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,740 | 02.01.2023 | 6.500 | 4 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,750 | 02.01.2023 | 3.100 | 2 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,760 | 02.01.2023 | 6.400 | 4 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,900 | 02.01.2023 | 13.300 | 5 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,930 | 02.01.2023 | 1.700 | 1 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,939 | 02.01.2023 | 6.700 | 2 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,946 | 02.01.2023 | 16.700 | 6 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,960 | 02.01.2023 | 13.300 | 4 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,970 | 02.01.2023 | 21.900 | 7 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,500 | 16.06.2026 | $ 32.900 | 2.531 | 0,48 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,500 | 16.06.2028 | 26.200 | (2.211) | (0,42) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,750 | 15.12.2024 | 53.300 | (3.199) | (0,60) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,750 | 16.06.2031 | 13.442 | (1.189) | (0,22) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 0,750 | 16.06.2031 | 16.200 | 1.544 | 0,29 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 0,940 | 08.06.2026 | 2.000 | 158 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,000 | 16.12.2030 | 1.766 | 265 | 0,05 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,235 | 12.05.2028 | 700 | 70 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 15.12.2026 | 500 | 49 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 15.12.2026 | 33.800 | 3.118 | 0,59 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 17.06.2027 | 12.000 | (1.478) | (0,28) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 17.06.2030 | 47.620 | 4.015 | 0,76 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 16.06.2051 | 4.300 | (679) | (0,13) |
| Zahlung[3] | 3-Month USD-LIBOR | 1,270 | 04.11.2023 | 11.100 | (49) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,350 | 20.01.2027 | 3.400 | 234 | 0,04 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,360 | 20.07.2031 | 800 | 107 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,370 | 19.07.2031 | 500 | 67 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,380 | 04.01.2027 | 1.400 | (90) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,405 | 07.09.2031 | 1.300 | 176 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,425 | 18.01.2027 | 1.000 | (63) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,443 | 18.01.2027 | 1.100 | (68) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,450 | 17.02.2027 | 2.400 | 157 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,450 | 16.07.2031 | 1.200 | 154 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,491 | 21.01.2051 | 900 | (245) | (0,05) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 15.12.2028 | 7.130 | (792) | (0,15) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 12.01.2029 | 578 | 51 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 05.10.2031 | 600 | (74) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,535 | 15.10.2031 | 600 | (73) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,535 | 22.10.2031 | 400 | (49) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,545 | 26.10.2031 | 400 | (48) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,550 | 20.01.2027 | 15.100 | (845) | (0,16) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,570 | 11.01.2027 | 800 | (45) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,580 | 16.02.2027 | 900 | (51) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,590 | 09.02.2051 | 7.200 | (1.843) | (0,35) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,625 | 16.01.2050 | 3.100 | 793 | 0,15 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,625 | 03.02.2050 | 3.900 | 1.007 | 0,19 |
| Zahlung[3] | 3-Month USD-LIBOR | 1,700 | 06.03.2024 | 2.300 | (37) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,700 | 17.02.2027 | 9.600 | (481) | (0,09) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,700 | 12.01.2029 | 2.100 | (149) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,740 | 16.12.2026 | 1.100 | 67 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 | 15.01.2030 | 8.600 | 810 | 0,15 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 % | 22.01.2050 | $ | 7.600 | $ 1.793 | 0,34 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,768 | 02.02.2032 | | 300 | (30) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,785 | 12.08.2051 | | 700 | 168 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,875 | 07.02.2050 | | 400 | 84 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,895 | 18.10.2049 | | 700 | 161 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,910 | 17.10.2049 | | 700 | 158 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 18.02.2032 | | 900 | (70) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 15.01.2050 | | 1.400 | 263 | 0,05 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 15.12.2051 | | 6.500 | (1.699) | (0,32) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 11.12.2049 | | 7.100 | 1.018 | 0,19 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 12.03.2050 | | 3.400 | 465 | 0,09 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 18.12.2024 | | 6.000 | 368 | 0,07 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 20.12.2024 | | 10.900 | (195) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2024 | | 41.600 | 1.050 | 0,20 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2026 | | 32.300 | 678 | 0,13 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 4,915 | 01.02.2026 | ZAR | 5.200 | (27) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 5,020 | 11.02.2026 | | 2.000 | (11) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 5,970 | 10.03.2026 | | 600 | 2 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,250 | 19.09.2023 | | 86.800 | (10) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,750 | 19.09.2028 | | 78.300 | (159) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 8,000 | 15.03.2024 | | 5.100 | (7) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 8,250 | 15.03.2024 | | 22.800 | (15) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 2,750 | 17.06.2026 | AUD | 460 | (17) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 3,000 | 21.03.2027 | | 18.640 | (777) | (0,15) |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 3,250 | 17.12.2024 | | 1.600 | (72) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 3,500 | 17.06.2025 | | 19.492 | (1.097) | (0,21) |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 4,250 | 17.12.2024 | | 650 | (51) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 4,750 | 18.06.2024 | | 400 | (37) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,150 | 18.03.2030 | € | 6.200 | 902 | 0,17 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | | 4.300 | 421 | 0,08 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 18.03.2050 | | 2.300 | 787 | 0,15 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,329 | 30.12.2025 | | 100 | 7 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,363 | 30.06.2025 | | 200 | 12 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,395 | 30.12.2024 | | 100 | 5 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,425 | 28.06.2024 | | 200 | 7 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,453 | 29.12.2023 | | 200 | 6 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,160 | 06.06.2025 | MXN | 9.300 | (50) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,535 | 04.05.2027 | | 18.500 | (126) | (0,02) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,780 | 29.09.2022 | | 12.930 | 38 | 0,01 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,795 | 02.06.2023 | | 3.600 | 7 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,950 | 30.01.2026 | | 12.300 | 0 | 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 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,080 | 10.03.2026 | | 20.700 | (6) | 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 | (16) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,620 | 18.02.2030 | | 600 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,710 | 20.09.2029 | | 500 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,150 | 11.06.2027 | | 28.100 | (72) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,165 | 06.09.2032 | | 3.000 | (11) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,200 | 11.06.2027 | | 2.900 | (8) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,360 | 21.08.2037 | | 3.100 | (15) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,370 | 11.10.2027 | | 14.800 | (45) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,380 | 04.11.2026 | | 400 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,380 | 14.08.2037 | | 700 | 2 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,480 | 18.06.2037 | | 1.300 | (6) | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,495 | 14.01.2032 | | 8.100 | 3 | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,498 | 15.01.2032 | | 33.500 | 12 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,520 | 18.04.2023 | | 30.200 | (20) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,530 | 18.04.2023 | | 24.900 | (17) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,530 | 21.04.2023 | | 3.100 | (2) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,545 | 18.04.2023 | | 19.100 | (14) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,603 | 14.04.2025 | | 49.000 | (102) | (0,02) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,610 | 23.01.2023 | | 18.100 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,610 | 15.04.2025 | | 3.000 | (6) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,640 | 03.01.2023 | | 2.200 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,645 | 03.01.2023 | | 4.900 | (2) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,670 | 05.03.2025 | | 52.900 | (99) | (0,02) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,700 | 02.05.2023 | | 7.100 | (3) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,710 | 07.03.2025 | | 6.400 | (12) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,715 | 07.03.2025 | | 6.300 | (12) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,745 | 05.01.2023 | | 3.400 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,800 | 28.12.2027 | | 2.900 | 7 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,805 | 06.02.2023 | | 7.800 | (3) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,818 | 17.02.2027 | | 11.400 | (42) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,820 | 06.02.2023 | | 7.900 | (2) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,865 | 27.12.2022 | | 5.000 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,865 | 02.02.2027 | | 11.900 | (45) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,875 | 16.12.2022 | | 2.800 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,880 | 27.12.2022 | | 79.700 | (55) | (0,01) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,910 | 30.12.2027 | | 600 | 1 | 0,00 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,984 % | 10.12.2027 | MXN 6.800 | $ 14 | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,990 | 21.12.2027 | 100 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,005 | 21.12.2027 | 37.500 | 98 | 0,02 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,010 | 04.02.2027 | 5.200 | (21) | 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 | 6 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,090 | 15.01.2027 | 13.000 | (54) | (0,01) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,103 | 04.01.2038 | 5.600 | 16 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,120 | 15.01.2027 | 2.700 | (11) | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,410 | 31.03.2027 | 11.100 | 13 | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,660 | 04.04.2024 | 38.500 | 27 | 0,01 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,675 | 03.04.2024 | 92.600 | 65 | 0,01 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,701 | 31.03.2032 | 19.500 | 11 | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,730 | 06.04.2027 | 16.500 | 8 | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,732 | 30.03.2032 | 8.200 | 4 | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,750 | 05.04.2024 | 39.700 | 23 | 0,00 |
| Zahlung | UKRPI | 4,000 | 15.09.2031 | £ 300 | (28) | (0,01) |
| Zahlung | UKRPI | 4,020 | 15.10.2031 | 400 | (34) | (0,01) |
| Zahlung | UKRPI | 4,055 | 15.09.2031 | 400 | (36) | (0,01) |
| Zahlung | UKRPI | 4,066 | 15.09.2031 | 600 | (44) | (0,01) |
| Zahlung | UKRPI | 4,140 | 15.10.2031 | 1.000 | (70) | (0,01) |
| Zahlung | UKRPI | 4,250 | 15.11.2031 | 900 | (40) | (0,01) |
| Zahlung | UKRPI | 4,400 | 15.10.2031 | 400 | (18) | 0,00 |
| | | | | | $ 5.406 | 1,02 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 1.654** | **0,31** |

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

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

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

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

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

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 % | 20.07.2022 | 200 | $ (1) | $ 0 | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 800 | (1) | 0 | 0,00 |
| BRC | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 400 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,600 | 17.08.2022 | 300 | (1) | (1) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 300 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 600 | (1) | (1) | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,300 | 17.08.2022 | 700 | (2) | (1) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 95,000 | 17.08.2022 | 200 | (2) | (3) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,250 | 20.07.2022 | 400 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,350 | 17.08.2022 | 600 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ (12) | $ (8) | 0,00 |

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call -OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,150 % | 01.12.2023 | 1.100 | $ (3) | $ (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,650 | 01.12.2023 | 1.100 | (3) | (4) | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,310 | 19.08.2022 | 600 | (5) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,010 | 19.08.2022 | 600 | (5) | (6) | 0,00 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 26.08.2022 | 1.000 | (5) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,850 | 26.08.2022 | 1.000 | (5) | (10) | (0,01) |
| BPS | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 11.04.2023 | 500 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 11.04.2023 | 500 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 28.04.2023 | 1.300 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 28.04.2023 | 1.300 | (2) | (5) | 0,00 |
| CBK | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,690 | 02.04.2024 | 300 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,690 | 02.04.2024 | 300 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 01.09.2022 | 700 | (6) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 01.09.2022 | 700 | (6) | (7) | 0,00 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,755 | 30.09.2022 | 1.000 | (6) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,955 | 30.09.2022 | 1.000 | (7) | (10) | (0,01) |

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| DUB | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,920 % | 13.10.2023 | 1.000 | $ (6) | $ (7) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,920 | 13.10.2023 | 1.000 | (6) | (6) | 0,00 |
| | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 02.09.2022 | 500 | (3) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 02.09.2022 | 500 | (3) | (4) | 0,00 |
| FAR | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,688 | 02.04.2024 | 600 | (5) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,688 | 02.04.2024 | 600 | (5) | (4) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,781 | 05.04.2024 | 1.000 | (8) | (8) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,781 | 05.04.2024 | 1.000 | (8) | (6) | 0,00 |
| GLM | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,870 | 02.11.2022 | 41.600 | (83) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,270 | 02.11.2022 | 41.600 | (83) | (954) | (0,18) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,920 | 13.10.2023 | 700 | (4) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,920 | 13.10.2023 | 700 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,018 | 20.10.2023 | 500 | (3) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,018 | 20.10.2023 | 500 | (3) | (3) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,140 | 23.10.2023 | 500 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,140 | 23.10.2023 | 500 | (4) | (2) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,190 | 23.10.2023 | 500 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,190 | 23.10.2023 | 500 | (4) | (2) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,225 | 23.10.2023 | 500 | (3) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,225 | 23.10.2023 | 500 | (3) | (2) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,973 | 25.10.2023 | 600 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,973 | 25.10.2023 | 600 | (4) | (3) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,841 | 27.10.2023 | 600 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,841 | 27.10.2023 | 600 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,088 | 03.11.2023 | 600 | (4) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,088 | 03.11.2023 | 600 | (4) | (3) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,910 | 10.11.2023 | 600 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,910 | 10.11.2023 | 600 | (4) | (3) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 17.11.2023 | 1.100 | (4) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 17.11.2023 | 1.100 | (4) | (3) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,150 | 20.11.2023 | 1.100 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,650 | 20.11.2023 | 1.100 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 | 07.12.2023 | 1.100 | (3) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 07.12.2023 | 1.100 | (3) | (3) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,697 | 02.04.2024 | 1.200 | (9) | (9) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,697 | 02.04.2024 | 1.200 | (9) | (8) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,721 | 08.04.2024 | 600 | (5) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,721 | 08.04.2024 | 600 | (5) | (4) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 05.04.2023 | 1.400 | (3) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 05.04.2023 | 1.400 | (3) | (5) | 0,00 |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 11.04.2023 | 2.400 | (5) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 11.04.2023 | 2.400 | (5) | (9) | (0,01) |
| | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 24.04.2023 | 1.400 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put -OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 24.04.2023 | 1.400 | (4) | (5) | 0,00 |
| | Call -OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,700 | 26.04.2023 | 1.300 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put -OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,250 | 26.04.2023 | 1.300 | (2) | (4) | 0,00 |
| | Call -OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,550 | 15.05.2023 | 1.300 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put -OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 2,100 | 15.05.2023 | 1.300 | (2) | (5) | 0,00 |
| | Call -OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,400 | 17.08.2022 | 1.100 | (6) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,100 | 17.08.2022 | 1.100 | (6) | (6) | 0,00 |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,370 | 18.08.2022 | 600 | (4) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,070 | 18.08.2022 | 600 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 06.09.2022 | 500 | (3) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 06.09.2022 | 500 | (3) | (4) | 0,00 |
| | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 | 07.09.2022 | 500 | (3) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,100 | 07.09.2022 | 500 | (3) | (4) | 0,00 |
| MYC | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,993 | 11.10.2023 | 600 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,993 | 11.10.2023 | 600 | (4) | (3) | 0,00 |
| | | | | | | | $ (460) | $ (1.239) | (0,23) |

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call -OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | $ 93,563 | 07.09.2022 | 500 | $ (4) | $ (5) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | 94,438 | 07.09.2022 | 500 | (3) | (3) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | 94,703 | 07.09.2022 | 400 | (3) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 98,297 | 07.07.2022 | 500 | (3) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 99,141 | 07.07.2022 | 700 | (5) | (5) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01/08/2052 | 96,906 | 04.08.2022 | 500 | (2) | (6) | (0,01) |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,141 | 07.09.2022 | 500 | (2) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,156 | 07.09.2022 | 300 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,656 | 07.09.2022 | 500 | (2) | (4) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 101,141 | 07.09.2022 | 500 | (1) | (2) | 0,00 |
| SAL | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2052 | 94,688 | 07.09.2022 | 300 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 99,563 | 07.07.2022 | 500 | (2) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 98,234 | 07.09.2022 | 500 | (3) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,406 | 07.09.2022 | 500 | (2) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,656 | 07.09.2022 | 500 | (2) | (4) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 100,234 | 07.09.2022 | 500 | (2) | (4) | 0,00 |
| | | | | | $ (39) | $ (49) | (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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Turkey Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 400 | $ (29) | $ (14) | $ (43) | (0,01) |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 100 | (12) | (5) | (17) | 0,00 |
| BPS | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 200 | (10) | (7) | (17) | 0,00 |
| BRC | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 100 | (6) | 6 | 0 | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 300 | (14) | (6) | (20) | (0,01) |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 900 | (62) | (36) | (98) | (0,02) |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 400 | (36) | (21) | (57) | (0,01) |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 740 | (86) | (38) | (124) | (0,02) |
| CBK | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 5.140 | (169) | 186 | 17 | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 500 | (9) | 0 | (9) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 200 | (2) | 0 | (2) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 500 | 2 | (12) | (10) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 100 | (4) | (4) | (8) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 700 | (11) | 12 | 1 | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 100 | (10) | (7) | (17) | 0,00 |
| GST | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 600 | (9) | (1) | (10) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 200 | (7) | (10) | (17) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 800 | (7) | 6 | (1) | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 1.560 | (34) | (1.130) | (1.164) | (0,22) |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 100 | (5) | 4 | (1) | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 400 | (36) | (21) | (57) | (0,01) |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 900 | (101) | (50) | (151) | (0,03) |
| HUS | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 200 | (6) | 5 | (1) | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 1.300 | (38) | 27 | (11) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 3.200 | (50) | 61 | 11 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.09.2024 | 4 | (1) | (2) | (3) | 0,00 |
| JPM | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 100 | (3) | 3 | 0 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2026 | 300 | (2) | (3) | (5) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 800 | (44) | 34 | (10) | 0,00 |
| MYC | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 400 | (18) | (15) | (33) | (0,01) |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 600 | (5) | 4 | (1) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2025 | 100 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 1.100 | 3 | (31) | (28) | (0,01) |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 2.700 | (12) | (78) | (90) | (0,02) |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 1.100 | (24) | (797) | (821) | (0,16) |
| | | | | | $ (858) | $ (1.940) | $ (2.798) | (0,53) |

## 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 | ABX.HE.AAA.6-2 Index | 0,110 % | 25.05.2046 | $ 354 | $ (81) | $ 82 | $ 1 | 0,00 |
| DUB | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 400 | (7) | 6 | (1) | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.7 Index | 0,500 | 17.01.2047 | 389 | (18) | 19 | 1 | 0,00 |
| FBF | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 25 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.6 Index | 0,500 | 11.05.2063 | 229 | (4) | 4 | 0 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 | 17.10.2057 | 100 | (6) | 6 | 0 | 0,00 |
| GST | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 16.000 | (8) | (50) | (58) | (0,01) |
| | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18.11.2054 | 7.300 | (38) | (11) | (49) | (0,01) |
| | CMBX.NA.AAA.6 Index | 0,500 | 11.05.2063 | 229 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 | 17.10.2057 | 8.600 | (339) | 346 | 7 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.9 Index | 0,500 | 17.09.2058 | 299 | (12) | 12 | 0 | 0,00 |
| MEI | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 500 | (4) | (1) | (5) | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 | 17.10.2057 | 200 | (11) | 11 | 0 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.9 Index | 0,500 | 17.09.2058 | 598 | (47) | 46 | (1) | 0,00 |
| MYC | ABX.HE.AAA.6-2 Index | 0,110 | 25.05.2046 | 560 | (128) | 130 | 2 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 500 | (4) | (1) | (5) | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.6 Index | 0,500 | 11.05.2063 | 102 | (2) | 2 | 0 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 | 17.10.2057 | 100 | (6) | 6 | 0 | 0,00 |
| SAL | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 2.075 | 17 | (25) | (8) | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18.11.2054 | 1.200 | 6 | (14) | (8) | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 300 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.9 Index | 0,500 | 17.09.2058 | 15.442 | 15 | (29) | (14) | (0,01) |
| UAG | CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 | 17.10.2057 | 100 | (6) | 6 | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ (682) | $ 541 | $ (141) | (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.

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nenn-betrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlusspr ämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 1,044 % | $ 200 | 20.09.2022 | $ 0 | $ (9) | $ (9) | 0,00 |
| MYC | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 1,044 | 100 | 20.09.2022 | 0 | 1 | 1 | 0,00 |
| | | | | | | | $ 0 | $ (8) | $ (8) | 0,00 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | AUD | 241 | $ | 173 | $ 8 | $ 0 | $ 8 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 15.430 | | 19.509 | 770 | 0 | 770 | 0,14 |
| | 07.2022 | PEN | 2.929 | | 727 | 0 | (42) | (42) | (0,01) |
| | 07.2022 | $ | 545 | £ | 446 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 5 | PEN | 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 4.723 | $ | 308 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 4.808 | MXN | 97.612 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 778 | NOK | 7.409 | 0 | (28) | (28) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 464 | PEN | 1.791 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 24 | RUB | 3.685 | 41 | 0 | 41 | 0,01 |
| | 09.2022 | PEN | 2.059 | $ | 490 | 0 | (48) | (48) | (0,01) |
| | 11.2022 | ZAR | 4.550 | | 287 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 02.2023 | PEN | 1.791 | | 456 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | ¥ | 83.100 | | 643 | 31 | 0 | 31 | 0,01 |
| | 07.2022 | MXN | 5.646 | | 270 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 17.806 | € | 16.877 | 0 | (162) | (162) | (0,03) |
| | 07.2022 | | 602 | £ | 478 | 0 | (22) | (22) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 1.349 | ¥ | 181.700 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 915 | MXN | 18.397 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 14.367 | $ | 15.139 | 91 | 0 | 91 | 0,02 |
| | 08.2022 | $ | 883 | IDR | 13.017.844 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 08.2022 | ZAR | 17.676 | $ | 1.107 | 33 | 0 | 33 | 0,01 |
| | 09.2022 | MXN | 18.397 | | 902 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 9.779 | | 610 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | $ | 492 | £ | 400 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 968 | IDR | 14.322.578 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.363 | NOK | 13.333 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 3.460 | $ | 216 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | BRL | 39.463 | | 7.652 | 106 | 0 | 106 | 0,02 |
| | 07.2022 | £ | 583 | | 732 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 07.2022 | PEN | 9 | | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 8.123 | BRL | 39.463 | 0 | (576) | (576) | (0,11) |
| | 07.2022 | | 1.920 | € | 1.788 | 0 | (50) | (50) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 32 | PEN | 119 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN | 1.834 | $ | 454 | 0 | (27) | (27) | (0,01) |
| | 08.2022 | $ | 7.592 | BRL | 39.463 | 0 | (111) | (111) | (0,02) |
| | 08.2022 | | 399 | PEN | 1.502 | 1 | (6) | (5) | 0,00 |
| | 11.2022 | PEN | 7.115 | $ | 1.792 | 0 | (57) | (57) | (0,01) |
| | 12.2022 | | 957 | | 242 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 12.2022 | $ | 227 | PEN | 872 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03.2023 | | 247 | | 956 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | | 4 | | 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 2.025 | $ | 68 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 0 | RUB | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10.2022 | | 81 | | 7.790 | 43 | 0 | 43 | 0,01 |
| | 12.2022 | ZAR | 6.521 | $ | 415 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | 02.2023 | | 1.716 | | 103 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | MXN | 13.226 | | 640 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 23 | PEN | 88 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 1.688 | $ | 105 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 897 | PEN | 3.365 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 08.2022 | ZAR | 1.069 | $ | 69 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 10.2022 | $ | 203 | RUB | 19.226 | 107 | 0 | 107 | 0,02 |
| | 11.2022 | ZAR | 4.818 | $ | 300 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 05.2023 | | 3.016 | | 180 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPM | 08.2022 | TWD | 23.599 | | 801 | $ 6 | $ 0 | $ 6 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 325 | CNH | 2.185 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.294 | IDR | 19.028.462 | 0 | (23) | (23) | (0,01) |
| MBC | 07.2022 | AUD | 4.232 | $ | 3.011 | 101 | 0 | 101 | 0,02 |
| | 07.2022 | € | 18.919 | | 20.402 | 623 | 0 | 623 | 0,12 |
| | 07.2022 | $ | 3.208 | AUD | 4.610 | 0 | (38) | (38) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 3.053 | CAD | 3.855 | 0 | (65) | (65) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 264 | € | 254 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 7.054 | ¥ | 936.600 | 0 | (160) | (160) | (0,03) |
| | 08.2022 | MXN | 20.152 | $ | 982 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 931 | AUD | 1.351 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.136 | CLP | 952.170 | 0 | (127) | (127) | (0,02) |
| | 08.2022 | | 735 | CNH | 4.933 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 571 | IDR | 8.370.858 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 05.2023 | | 740 | CNH | 4.968 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | | 172 | € | 164 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | CNY | 7.962 | $ | 1.186 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 7.018 | | 238 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 1.092 | IDR | 16.112.312 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| RBC | 09.2022 | | 2.142 | MXN | 44.069 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 11 | PEN | 41 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNY | 12.744 | $ | 1.904 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 1.306 | CNH | 8.751 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09.2022 | ZAR | 5.946 | $ | 385 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 11.2022 | PEN | 386 | | 93 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | AUD | 137 | | 99 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.517 | CAD | 1.945 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | MXN | 12.827 | $ | 617 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.340 | £ | 1.098 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 379 | ZAR | 6.092 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 2.003 | MXN | 39.912 | 0 | (48) | (48) | (0,01) |
| | 11.2022 | ZAR | 13.974 | $ | 882 | 40 | 0 | 40 | 0,01 |
| | | | | | | $ 2.191 | $ (1.797) | $ 394 | 0,07 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend II, Class T EUR (Hedged) thesaurierend und Class T EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | € | 594 | $ | 639 | $ 18 | $ 0 | $ 18 | 0,00 |
| | 07.2022 | HKD | 8.254 | | 1.053 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 956 | AUD | 1.375 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 1.375 | $ | 956 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | € | 900 | | 943 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 3.992 | | 5.047 | 199 | 0 | 199 | 0,04 |
| | 07.2022 | INR | 15.342 | | 197 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | SGD | 1 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.630 | AUD | 2.348 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.115 | DKK | 7.840 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 136.018 | € | 126.899 | 0 | (3.351) | (3.351) | (0,63) |
| | 07.2022 | | 436 | SGD | 606 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 2.348 | $ | 1.630 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 7.824 | | 1.115 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 08.2022 | SGD | 606 | | 436 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CNY | 8 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 152.365 | | 160.269 | 980 | 0 | 980 | 0,19 |
| | 07.2022 | IDR | 6.181.724 | | 416 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | ¥ | 153 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1 | € | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 204 | ILS | 703 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 0 | ZAR | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | ILS | 701 | $ | 204 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 1 | CNY | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 158.554 | € | 150.471 | 0 | (953) | (953) | (0,18) |
| | 08.2022 | | 416 | IDR | 6.185.121 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | ILS | 703 | $ | 212 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.830 | € | 1.702 | 0 | (51) | (51) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 4.957 | ¥ | 672.434 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 671.342 | $ | 4.957 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | CAD | 5.477 | | 4.339 | 93 | 0 | 93 | 0,02 |
| | 07.2022 | € | 2.347 | | 2.515 | 61 | 0 | 61 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ | 8 | BRL | 39 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 424 | IDR | 6.176.754 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 275 | MXN | 5.498 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 19 | ZAR | 289 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | BRL | 39 | $ | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 4.413 | | 4.646 | 32 | 0 | 32 | 0,01 |
| | 07.2022 | SEK | 14.116 | | 1.446 | 69 | 0 | 69 | 0,01 |
| | 07.2022 | SGD | 0 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 234 | DKK | 1.645 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 1.642 | $ | 234 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 7 | BRL | 39 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RBC | 08.2022 | HKD | 8.248 | $ | 1.052 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | AUD | 4.033 | | 2.913 | 140 | 0 | 140 | 0,03 |
| | 07.2022 | CHF | 3.736 | | 3.895 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 4.348 | | 4.578 | 33 | (1) | 32 | 0,01 |
| | 07.2022 | MXN | 5.498 | | 272 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | SGD | 1.226 | | 897 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07.2022 | $ | 1 | CNY | 9 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 174.021 | € | 162.453 | 0 | (4.184) | (4.184) | (0,79) |
| | 07.2022 | ZAR | 290 | $ | 18 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 270 | MXN | 5.498 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 18 | ZAR | 291 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | ¥ | 968.586 | $ | 7.631 | 501 | 0 | 501 | 0,09 |
| | 07.2022 | $ | 1.980 | CAD | 2.539 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 2.539 | $ | 1.980 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | DKK | 9.487 | | 1.345 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 771 | | 817 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 07.2022 | HKD | 0 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | SGD | 67 | | 49 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | | $ 174.573 | € | 162.453 | 0 | (4.737) | (4.737) | (0,90) |
| | | | | | | $ 2.249 | $ (13.367) | $ (11.118) | (2,10) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **$ (14.967)** | **(2,83)** |

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Ginnie Mae, TBA**<br>4,500 % fällig am 01.08.2052 (j) | $ 4.500 | $ (4.551) | (0,86) |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA**<br>2,000 % fällig am 01.08.2052 | 10.600 | (9.191) | (1,74) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (13.742)** | **(2,60)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 600.766** | **113,60** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (71.922)** | **(13,60)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 528.844** | **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.**

**µ Bei diesem Betrag handelt es sich ganz oder teilweise um ungedeckte Darlehenszusagen. Der Zinssatz für den ungedeckten Teil wird zum Zeitpunkt der Finanzierung festgelegt.**

**(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

**(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

**(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

**(d) Nullkuponwertpapier.**

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

**(f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

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

**(h) Mit dem Fonds verbunden.**

**(i) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(j) Zum 30. Juni 2022 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.**

**(k) Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kauf-datum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|
| Intelsat Emergence S.A. | 19.06.2017 - 23.02.2022 | $ 5.147 | $ 1.534 | 0,29 |
| Morgan Stanley 0,000 % fällig am 02.04.2032 | 11.02.2020 | 606 | 437 | 0,08 |
| Neiman Marcus Group Ltd. LLC | 25.09.2020 | 278 | 1.494 | 0,28 |
| Noble Corp. | 05.02.2021 - 20.02.2021 | 333 | 673 | 0,13 |
| | | $ 6.364 | $ 4.138 | 0,78 |

**(l) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurde zum 30. Juni 2022 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von USD 251 und Barmittel in Höhe von USD 14.305 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von USD 14.302 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 70.943 | $ 513.596 | $ 5.787 | $ 590.326 |
| Investmentfonds | 37.193 | 0 | 0 | 37.193 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 805 | 0 | 805 |
| Finanzderivate[3] | (84) | (13.732) | 0 | (13.816) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (13.742) | 0 | (13.742) |
| **Summen** | **$ 108.052** | **$ 486.927** | **$ 5.787** | **$ 600.766** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 157.199 | $ 591.957 | $ 9.155 | $ 758.311 |
| Investmentfonds | 15.171 | 0 | 0 | 15.171 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 476 | 0 | 476 |
| Finanzderivate[3] | (174) | 263 | 0 | 89 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (32.833) | 0 | (32.833) |
| **Summen** | **$ 172.196** | **$ 559.863** | **$ 9.155** | **$ 741.214** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ 19 | $ 0 | $ 19 |
| BOA | (2.521) | 2.520 | (1) |
| BPS | (54) | 0 | (54) |
| BRC | (363) | 290 | (73) |
| CBK | (618) | 550 | (68) |
| DUB | 46 | (20) | 26 |
| FAR | (22) | 0 | (22) |
| GLM | (1.034) | 1.031 | (3) |
| GST | (1.502) | 1.311 | (191) |
| HUS | (4) | 0 | (4) |
| JPM | (51) | 0 | (51) |
| MBC | 316 | (190) | 126 |
| MEI | (6) | 0 | (6) |
| MYC | (984) | 884 | (100) |
| MYI | 84 | (26) | 58 |
| RBC | 17 | 0 | 17 |
| SAL | (49) | 0 | (49) |
| SCX | (3.985) | 3.590 | (395) |
| TOR | 497 | (540) | (43) |
| UAG | (4.753) | 4.300 | (453) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 54,65 | 69,92 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 51,36 | 47,30 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 5,63 | 5,11 |
| Investmentfonds | 7,03 | 2,45 |
| Pensionsgeschäfte | 0,15 | 0,08 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,10) | 0,01 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,31 | (0,72) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (2,83) | 0,72 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (2,60) | (5,30) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | k. A. | (0,30) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 3,51 | 3,82 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 19,48 | 25,35 |
| Wandelanleihen & Wechsel | k. A. | 0,00 |
| Kommunalanleihen und Wechsel | 0,19 | 0,42 |
| US-Regierungsbehörden | 22,78 | 27,41 |
| US-Schatzobligationen | 10,56 | 9,97 |
| Non-Agency-MBS | 6,17 | 6,35 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 17,65 | 15,46 |
| Staatsemissionen | 3,98 | 6,93 |
| Stammaktien | 25,92 | 25,12 |
| Bezugsrechte | 0,01 | k. A. |
| Optionsscheine | 0,01 | 0,01 |
| Vorzugswertpapiere | 0,25 | 0,33 |
| Real Estate Investment Trusts | 0,98 | 0,99 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,15 | 0,17 |
| Investmentfonds | 7,03 | 2,45 |
| Pensionsgeschäfte | 0,15 | 0,08 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,10) | 0,01 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | 0,00 | k. A. |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,02) | 0,03 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | (0,69) | 0,05 |
| Zinsswaps | 1,02 | (0,80) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Optionen auf Wertpapiere | k. A. | 0,00 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | 0,00 | 0,00 |
| Devisenoptionen | k. A. | (0,01) |
| Zinsswapoption | (0,23) | (0,03) |
| Optionen auf Wertpapiere | (0,01) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,53) | 0,02 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | (0,03) | 0,07 |
| Zinsswaps | k. A. | 0,02 |
| Total Return Swaps auf Indizes | 0,00 | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | 0,07 | (0,05) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (2,10) | 0,70 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (2,60) | (5,30) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (13,60) | (19,57) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 01.06.2027 | € | 9.000 | $ | 9.052 | 0,22 |
| **AIB Group PLC** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 04.04.2028 | | 4.400 | | 4.237 | 0,10 |
| 2,875 % fällig am 30.05.2031 | | 8.800 | | 8.350 | 0,21 |
| **alstria office REIT-AG** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 23.06.2026 | | 6.000 | | 5.347 | 0,13 |
| **Altarea S.C.A.** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 17.01.2028 | | 13.000 | | 10.832 | 0,27 |
| **American Tower Corp.** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.05.2024 | $ | 3.500 | | 3.451 | 0,08 |
| **Assicurazioni Generali SpA** | | | | | |
| 2,429 % fällig am 14.07.2031 | € | 1.800 | | 1.481 | 0,04 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 11.09.2025 | | 11.600 | | 11.115 | 0,27 |
| **AvalonBay Communities, Inc.** | | | | | |
| 3,200 % fällig am 15.01.2028 | $ | 4.100 | | 3.865 | 0,10 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.08.2025 | | 9.080 | | 8.640 | 0,21 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.01.2026 (d)(f) | € | 15.000 | | 14.302 | 0,35 |
| **Banco de Sabadell S.A.** | | | | | |
| 0,875 % fällig am 16.06.2028 | | 6.300 | | 5.406 | 0,13 |
| **Bank of America Corp.** | | | | | |
| 1,197 % fällig am 24.10.2026 | $ | 15.000 | | 13.444 | 0,33 |
| **Bank of Ireland Group PLC** | | | | | |
| 0,375 % fällig am 10.05.2027 | € | 12.300 | | 11.270 | 0,28 |
| **Banque Federative du Credit Mutuel S.A.** | | | | | |
| 0,250 % fällig am 29.06.2028 | | 500 | | 450 | 0,01 |
| 2,023 % fällig am 20.07.2023 | $ | 3.300 | | 3.312 | 0,08 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (f) | | 952 | | 962 | 0,02 |
| **Barclays PLC** | | | | | |
| 1,700 % fällig am 03.11.2026 | £ | 5.400 | | 5.976 | 0,15 |
| 2,852 % fällig am 07.05.2026 | $ | 2.400 | | 2.270 | 0,06 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | | |
| 2,219 % fällig am 09.06.2026 | | 13.300 | | 12.297 | 0,30 |
| **Boston Properties LP** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.12.2028 | | 1.900 | | 1.849 | 0,05 |
| **BPCE S.A.** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 14.01.2028 | € | 4.100 | | 3.761 | 0,09 |
| **CA Immobilien Anlagen AG** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 27.10.2025 | | 4.500 | | 4.131 | 0,10 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | | |
| 0,375 % fällig am 18.11.2026 | | 7.000 | | 6.606 | 0,16 |
| 0,750 % fällig am 26.05.2028 | | 2.100 | | 1.895 | 0,05 |
| **Castellum AB** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 04.09.2026 (i) | | 9.700 | | 8.108 | 0,20 |
| 2,125 % fällig am 20.11.2023 | | 4.500 | | 4.571 | 0,11 |
| **CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 27.01.2028 | | 13.300 | | 11.508 | 0,28 |
| 0,900 % fällig am 12.10.2029 | | 7.600 | | 6.295 | 0,15 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | | |
| 1,250 % fällig am 06.07.2026 | | 5.000 | | 4.980 | 0,12 |
| 2,572 % fällig am 03.06.2031 (h) | $ | 4.000 | | 3.366 | 0,08 |
| 2,876 % fällig am 24.07.2023 | | 3.280 | | 3.279 | 0,08 |
| 3,070 % fällig am 24.02.2028 | | 11.000 | | 10.212 | 0,25 |
| **Citycon Treasury BV** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 12.03.2028 | € | 15.000 | | 11.560 | 0,28 |
| **Clarion Funding PLC** | | | | | |
| 1,250 % fällig am 13.11.2032 | £ | 2.400 | | 2.323 | 0,06 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 14.01.2030 | € | 6.100 | | 4.520 | 0,11 |
| 2,750 % fällig am 12.05.2026 | | 27.100 | | 25.245 | 0,62 |
| 2,750 % fällig am 22.01.2028 | £ | 400 | | 376 | 0,01 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | | |
| 2,961 % fällig am 12.06.2024 | $ | 13.200 | | 13.222 | 0,33 |
| 3,750 % fällig am 26.03.2025 | | 3.070 | | 2.978 | 0,07 |
| 3,869 % fällig am 12.01.2029 | | 12.000 | | 10.795 | 0,27 |
| 7,125 % fällig am 29.07.2022 (d)(f) | | 200 | | 200 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **CTP NV** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 21.06.2025 | € | 1.400 | $ | 1.249 | 0,03 |
| 0,875 % fällig am 20.01.2026 | | 10.200 | | 8.931 | 0,22 |
| 1,500 % fällig am 27.09.2031 | | 4.700 | | 2.980 | 0,07 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 19.11.2025 | | 17.200 | | 16.973 | 0,42 |
| 1,375 % fällig am 10.06.2026 | | 4.450 | | 4.507 | 0,11 |
| 1,625 % fällig am 20.01.2027 | | 7.400 | | 6.937 | 0,17 |
| 1,750 % fällig am 19.11.2030 | | 14.200 | | 12.260 | 0,30 |
| 1,875 % fällig am 23.02.2028 | | 4.000 | | 3.777 | 0,09 |
| 2,625 % fällig am 16.12.2024 | £ | 9.000 | | 10.414 | 0,26 |
| 2,625 % fällig am 12.02.2026 | € | 600 | | 604 | 0,01 |
| 3,300 % fällig am 16.11.2022 | $ | 13.900 | | 13.899 | 0,34 |
| 3,961 % fällig am 26.11.2025 | | 6.800 | | 6.577 | 0,16 |
| **Digital Dutch Finco BV** | | | | | |
| 0,625 % fällig am 15.07.2025 | € | 4.600 | | 4.434 | 0,11 |
| 1,000 % fällig am 15.01.2032 | | 1.000 | | 746 | 0,02 |
| **Digital Euro Finco LLC** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 16.01.2026 | | 6.100 | | 6.144 | 0,15 |
| **Digital Intrepid Holding BV** | | | | | |
| 0,625 % fällig am 15.07.2031 | | 10.300 | | 7.618 | 0,19 |
| **Digital Realty Trust LP** | | | | | |
| 3,600 % fällig am 01.07.2029 | $ | 2.900 | | 2.624 | 0,06 |
| **Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.11.2024 | | 1.077 | | 1.068 | 0,03 |
| **EQT AB** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 06.04.2028 | € | 10.000 | | 9.546 | 0,23 |
| 2,875 % fällig am 06.04.2032 | | 7.400 | | 6.537 | 0,16 |
| **Equinix, Inc.** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 15.09.2025 | $ | 8.600 | | 7.714 | 0,19 |
| **Essex Portfolio LP** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.04.2026 | | 1.000 | | 967 | 0,02 |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.11.2024 | £ | 9.700 | | 11.350 | 0,28 |
| **Europäische Union** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.10.2028 (b) | € | 1.678 | | 1.577 | 0,04 |
| **Federal Realty OP LP** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.07.2027 | $ | 600 | | 565 | 0,01 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | | |
| 1,744 % fällig am 19.07.2024 | € | 7.600 | | 7.359 | 0,18 |
| 2,748 % fällig am 14.06.2024 | £ | 4.600 | | 5.167 | 0,13 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.05.2023 | $ | 4.900 | | 4.918 | 0,12 |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** | | | | | |
| 2,950 % fällig am 29.07.2026 | € | 7.100 | | 5.974 | 0,15 |
| **GLP Capital LP** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.01.2030 | $ | 2.600 | | 2.281 | 0,06 |
| 5,300 % fällig am 15.01.2029 | | 2.000 | | 1.915 | 0,05 |
| **Goodman HK Finance** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 19.06.2024 | | 5.045 | | 5.074 | 0,12 |
| **Goodman U.S. Finance Four LLC** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.10.2037 | | 6.900 | | 6.387 | 0,16 |
| **GSPA Monetization Trust** | | | | | |
| 6,422 % fällig am 09.10.2029 | | 11.008 | | 10.958 | 0,27 |
| **Host Hotels & Resorts LP** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.02.2026 | | 7.800 | | 7.674 | 0,19 |
| **Indian Railway Finance Corp. Ltd.** | | | | | |
| 3,835 % fällig am 13.12.2027 | | 3.300 | | 3.139 | 0,08 |
| **ING Groep NV** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 07.12.2028 | £ | 9.100 | | 9.260 | 0,23 |
| 2,125 % fällig am 23.05.2026 | € | 4.200 | | 4.278 | 0,11 |
| **International Development Association** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 21.09.2028 | £ | 11.000 | | 12.041 | 0,30 |
| 1,750 % fällig am 05.05.2037 | € | 11.100 | | 10.632 | 0,26 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 04.12.2024 | | 1.100 | | 1.103 | 0,03 |
| 0,750 % fällig am 16.03.2028 | | 10.200 | | 9.052 | 0,22 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | | |
| 3,900 % fällig am 15.07.2025 | $ | 1.700 | | 1.705 | 0,04 |
| **KBC Group NV** | | | | | |
| 0,250 % fällig am 01.03.2027 | € | 3.000 | | 2.814 | 0,07 |
| 0,375 % fällig am 16.06.2027 | | 3.200 | | 3.025 | 0,07 |
| **Kojamo Oyj** | | | | | |
| 0,875 % fällig am 28.05.2029 | | 500 | | 348 | 0,01 |
| 1,875 % fällig am 27.05.2027 | | 2.700 | | 2.441 | 0,06 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Kookmin Bank** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.02.2029 (f) | $ | 8.200 | $ | 8.105 | 0,20 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | | |
| 0,250 % fällig am 23.02.2026 | € | 15.000 | | 14.032 | 0,35 |
| **Lendlease Finance Ltd.** | | | | | |
| 3,400 % fällig am 27.10.2027 | AUD | 24.900 | | 15.303 | 0,38 |
| 3,700 % fällig am 31.03.2031 | | 4.800 | | 2.722 | 0,07 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 22.03.2028 | $ | 1.200 | | 1.167 | 0,03 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 15.07.2027 | € | 1.100 | | 995 | 0,02 |
| 2,000 % fällig am 17.01.2034 | | 11.600 | | 8.559 | 0,21 |
| 2,250 % fällig am 13.05.2025 | | 13.000 | | 12.983 | 0,32 |
| 3,250 % fällig am 13.11.2028 | | 12.600 | | 11.904 | 0,29 |
| **Mid-America Apartments LP** | | | | | |
| 4,300 % fällig am 15.10.2023 | $ | 2.200 | | 2.214 | 0,05 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | | |
| 0,978 % fällig am 09.06.2024 | € | 3.200 | | 3.284 | 0,08 |
| 1,412 % fällig am 17.07.2025 | $ | 11.200 | | 10.299 | 0,25 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | | |
| 0,849 % fällig am 08.09.2024 | | 17.100 | | 16.448 | 0,40 |
| 1,979 % fällig am 10.07.2024 | | 8.600 | | 8.568 | 0,21 |
| 3,752 % fällig am 19.07.2023 | AUD | 10.400 | | 7.128 | 0,18 |
| **MPT Operating Partnership LP** | | | | | |
| 2,550 % fällig am 05.12.2023 | £ | 1.300 | | 1.517 | 0,04 |
| **NatWest Group PLC** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.11.2025 | € | 15.000 | | 14.920 | 0,37 |
| 0,780 % fällig am 26.02.2030 | | 10.000 | | 8.501 | 0,21 |
| **NE Property BV** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 09.10.2026 | | 10.700 | | 9.405 | 0,23 |
| 3,375 % fällig am 14.07.2027 | | 8.800 | | 7.934 | 0,20 |
| **New Immo Holding S.A.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 26.11.2026 (i) | | 8.800 | | 8.040 | 0,20 |
| **Nissan Motor Acceptance Co. LLC** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 21.09.2023 | $ | 3.500 | | 3.478 | 0,09 |
| **Nomura Holdings, Inc.** | | | | | |
| 2,679 % fällig am 16.07.2030 | | 7.300 | | 5.978 | 0,15 |
| **OneMain Finance Corp.** | | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.03.2025 | | 1.800 | | 1.710 | 0,04 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2023 | | 6.800 | | 6.777 | 0,17 |
| **Piper Sandler Cos.** | | | | | |
| 5,200 % fällig am 15.10.2023 | | 8.500 | | 8.383 | 0,21 |
| **Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski S.A. Via PKO Finance AB** | | | | | |
| 4,630 % fällig am 26.09.2022 | | 18.900 | | 18.933 | 0,47 |
| **Prologis Euro Finance LLC** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 08.02.2034 | € | 1.200 | | 956 | 0,02 |
| **Prologis International Funding S.A.** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 17.06.2032 | | 1.000 | | 826 | 0,02 |
| 3,125 % fällig am 01.06.2031 | | 10.000 | | 9.837 | 0,24 |
| **RCI Banque S.A.** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 11.07.2024 | | 18.600 | | 19.088 | 0,47 |
| **Reliance Standard Life Global Funding** | | | | | |
| 3,850 % fällig am 19.09.2023 | $ | 6.950 | | 6.949 | 0,17 |
| **Sagax AB** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 30.01.2027 | € | 11.700 | | 10.301 | 0,25 |
| **Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 12.08.2027 | | 8.100 | | 5.481 | 0,13 |
| 1,125 % fällig am 04.09.2026 | | 12.600 | | 8.848 | 0,22 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | | |
| 2,421 % fällig am 17.01.2029 | £ | 800 | | 866 | 0,02 |
| **SATO Oyj** | | | | | |
| 1,375 % fällig am 24.02.2028 | € | 2.600 | | 2.162 | 0,05 |
| **SBB Treasury Oyj** | | | | | |
| 0,129 % fällig am 08.02.2024 | | 3.200 | | 2.757 | 0,07 |
| 1,125 % fällig am 26.11.2029 | | 1.000 | | 630 | 0,02 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | | |
| 1,488 % fällig am 14.12.2026 | $ | 14.100 | | 12.459 | 0,31 |
| 4,677 % fällig am 15.06.2027 | | 6.700 | | 6.663 | 0,16 |
| **Society of Lloyd's** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.10.2024 | £ | 19.600 | | 23.671 | 0,58 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | | |
| 0,800 % fällig am 17.11.2029 | € | 3.600 | | 3.101 | 0,08 |
| 1,456 % fällig am 14.01.2027 | $ | 15.800 | | 13.952 | 0,34 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Starwood Property Trust, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 31.12.2024 | $ | 1.200 | $ 1.094 | 0,03 |
| 4,375 % fällig am 15.01.2027 | | 800 | 696 | 0,02 |
| **Stifel Financial Corp.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.05.2030 | | 12.900 | 11.999 | 0,30 |
| **Tesco Property Finance PLC** | | | | |
| 5,744 % fällig am 13.04.2040 | £ | 4.839 | 6.200 | 0,15 |
| 5,801 % fällig am 13.10.2040 | | 2.171 | 2.788 | 0,07 |
| **UBS AG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (f) | $ | 21.200 | 21.196 | 0,52 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 29.07.2026 (d)(f) | | 1.300 | 1.169 | 0,03 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 2,200 % fällig am 22.07.2027 | € | 9.700 | 9.267 | 0,23 |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | $ | 26.900 | 27.866 | 0,69 |
| **Unipol Gruppo SpA** | | | | |
| 3,250 % fällig am 23.09.2030 | € | 20.900 | 20.041 | 0,49 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 1,032 % fällig am 01.08.2022 | | 1.300 | 1.360 | 0,03 |
| 1,875 % fällig am 31.01.2024 | | 7.500 | 7.796 | 0,19 |
| **Volkswagen Financial Services NV** | | | | |
| 1,125 % fällig am 18.09.2023 | £ | 11.600 | 13.622 | 0,34 |
| 1,625 % fällig am 30.11.2022 | | 3.400 | 4.104 | 0,10 |
| 1,875 % fällig am 03.12.2024 | | 3.800 | 4.382 | 0,11 |
| **Vonovia SE** | | | | |
| 1,375 % fällig am 28.01.2026 | € | 9.900 | 9.603 | 0,24 |
| 2,375 % fällig am 25.03.2032 | | 2.100 | 1.809 | 0,04 |
| **Workspace Group PLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 11.03.2028 | £ | 7.600 | 7.600 | 0,19 |
| **Yorkshire Building Society** | | | | |
| 3,511 % fällig am 11.10.2030 | | 2.400 | 2.681 | 0,07 |
| | | | 1.048.489 | 25,80 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **Amdocs Ltd.** | | | | |
| 2,538 % fällig am 15.06.2030 | $ | 5.800 | 4.891 | 0,12 |
| **Amgen, Inc.** | | | | |
| 2,600 % fällig am 19.08.2026 | | 4.850 | 4.596 | 0,11 |
| **Arrow Electronics, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2023 | | 7.300 | 7.329 | 0,18 |
| **ASTM SpA** | | | | |
| 1,000 % fällig am 25.11.2026 | € | 3.500 | 3.216 | 0,08 |
| 1,500 % fällig am 25.01.2030 | | 8.300 | 6.703 | 0,16 |
| 2,375 % fällig am 25.11.2033 | | 9.400 | 7.222 | 0,18 |
| **Atlantia SpA** | | | | |
| 1,875 % fällig am 12.02.2028 | | 26.700 | 21.801 | 0,54 |
| **Babcock International Group PLC** | | | | |
| 1,375 % fällig am 13.09.2027 (i) | | 8.300 | 7.679 | 0,19 |
| **Bacardi Ltd.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 15.05.2025 | $ | 13.000 | 12.884 | 0,32 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** | | | | |
| 2,839 % fällig am 15.12.2023 | | 8.000 | 7.960 | 0,20 |
| **Boardwalk Pipelines LP** | | | | |
| 3,400 % fällig am 15.02.2031 | | 7.700 | 6.575 | 0,16 |
| **Boeing Co.** | | | | |
| 1,167 % fällig am 04.02.2023 | | 8.800 | 8.703 | 0,21 |
| 2,750 % fällig am 01.02.2026 | | 11.000 | 10.231 | 0,25 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | |
| 4,150 % fällig am 15.11.2030 | | 2.173 | 1.993 | 0,05 |
| 4,300 % fällig am 15.11.2032 | | 4.800 | 4.366 | 0,11 |
| **Campbell Soup Co.** | | | | |
| 4,150 % fällig am 15.03.2028 | | 1.600 | 1.573 | 0,04 |
| **Centene Corp.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.12.2029 | | 5.000 | 4.677 | 0,11 |
| **Chanel Ceres PLC** | | | | |
| 0,500 % fällig am 31.07.2026 | € | 15.539 | 14.896 | 0,37 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 4,908 % fällig am 23.07.2025 | $ | 17.900 | 17.966 | 0,44 |
| **Cheniere Corpus Christi Holdings LLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.06.2027 | | 8.700 | 8.739 | 0,21 |
| **Choice Hotels International, Inc.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 01.12.2029 | | 1.500 | 1.352 | 0,03 |
| **CVS Health Corp.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.08.2024 | | 5.300 | 5.186 | 0,13 |
| 3,000 % fällig am 15.08.2026 | | 3.600 | 3.448 | 0,08 |
| **D.R. Horton, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.02.2023 | $ | 4.900 | $ 4.931 | 0,12 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 5,450 % fällig am 15.06.2023 | | 4.587 | 4.635 | 0,11 |
| **Delta Air Lines Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,000 % fällig am 10.12.2029 | | 3.258 | 2.845 | 0,07 |
| **Emory University** | | | | |
| 2,143 % fällig am 01.09.2030 | | 10.400 | 9.121 | 0,22 |
| **Energy Transfer LP** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.04.2024 | | 5.300 | 5.306 | 0,13 |
| **Entergy Louisiana LLC** | | | | |
| 2,350 % fällig am 15.06.2032 | | 14.000 | 11.718 | 0,29 |
| **Expedia Group, Inc.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.02.2028 | | 3.790 | 3.458 | 0,08 |
| **GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.** | | | | |
| 4,418 % fällig am 15.11.2035 | | 1.700 | 1.590 | 0,04 |
| **General Motors Co.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 01.10.2025 (h) | | 3.200 | 3.313 | 0,08 |
| **Global Switch Finance BV** | | | | |
| 1,375 % fällig am 07.10.2030 | € | 1.700 | 1.447 | 0,04 |
| **Gray Oak Pipeline LLC** | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.10.2027 | $ | 12.600 | 11.538 | 0,28 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.03.2027 | | 9.200 | 8.367 | 0,21 |
| **Hyundai Capital America** | | | | |
| 1,000 % fällig am 17.09.2024 | | 9.350 | 8.687 | 0,21 |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 26.07.2024 | | 12.000 | 11.629 | 0,29 |
| **Informa PLC** | | | | |
| 2,125 % fällig am 06.10.2025 | € | 15.300 | 15.537 | 0,38 |
| **International Flavors & Fragrances, Inc.** | | | | |
| 2,300 % fällig am 01.11.2030 | $ | 7.400 | 6.088 | 0,15 |
| 3,200 % fällig am 01.05.2023 | | 5.400 | 5.382 | 0,13 |
| **Kansas City Southern** | | | | |
| 3,125 % fällig am 01.06.2026 | | 7.050 | 6.810 | 0,17 |
| **Lendlease Europe Finance PLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 02.12.2033 | £ | 7.300 | 6.943 | 0,17 |
| **Marks & Spencer PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 19.05.2026 | | 7.500 | 8.018 | 0,20 |
| **Motorola Solutions, Inc.** | | | | |
| 2,300 % fällig am 15.11.2030 | $ | 12.400 | 9.714 | 0,24 |
| **NetApp, Inc.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 22.06.2025 | | 2.954 | 2.758 | 0,07 |
| 2,700 % fällig am 22.06.2030 | | 5.200 | 4.388 | 0,11 |
| **Netflix, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.05.2029 | € | 1.700 | 1.681 | 0,04 |
| **Nissan Motor Co. Ltd.** | | | | |
| 4,345 % fällig am 17.09.2027 | $ | 2.500 | 2.297 | 0,06 |
| 4,810 % fällig am 17.09.2030 | | 15.600 | 13.874 | 0,34 |
| **NXP BV** | | | | |
| 3,875 % fällig am 18.06.2026 | | 9.900 | 9.549 | 0,23 |
| **Pearson Funding PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 04.06.2030 | £ | 4.500 | 5.190 | 0,13 |
| **Rexel S.A.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.12.2028 | € | 14.200 | 11.541 | 0,28 |
| **Royalty Pharma PLC** | | | | |
| 1,200 % fällig am 02.09.2025 | $ | 3.000 | 2.678 | 0,07 |
| **SEB S.A.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 16.06.2025 | € | 5.000 | 5.019 | 0,12 |
| **Siemens Financieringsmaatschappij NV** | | | | |
| 1,200 % fällig am 11.03.2026 | $ | 2.200 | 1.995 | 0,05 |
| **Sprint Spectrum Co. LLC** | | | | |
| 4,738 % fällig am 20.09.2029 | | 2.011 | 2.013 | 0,05 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 3,375 % fällig am 16.04.2026 | € | 7.000 | 7.231 | 0,18 |
| **Tesco Corporate Treasury Services PLC** | | | | |
| 0,375 % fällig am 27.07.2029 | | 7.400 | 5.995 | 0,15 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.04.2024 | $ | 5.700 | 5.629 | 0,14 |
| **Thames Water Utilities Finance PLC** | | | | |
| 0,875 % fällig am 31.01.2028 | € | 2.100 | 1.913 | 0,05 |
| **Tornator Oyj** | | | | |
| 1,250 % fällig am 14.10.2026 | | 5.600 | 5.544 | 0,14 |
| **United Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,875 % fällig am 07.04.2030 | $ | 3.353 | $ 3.066 | 0,08 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 13.11.2028 | | 3.000 | 2.987 | 0,07 |
| | | | 416.411 | 10,24 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 1,650 % fällig am 01.02.2028 | | 9.500 | 8.227 | 0,20 |
| **Avangrid, Inc.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 01.06.2029 | | 2.615 | 2.449 | 0,06 |
| **DTE Energy Co.** | | | | |
| 1,050 % fällig am 01.06.2025 | | 2.600 | 2.394 | 0,06 |
| **Duke Energy Progress LLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 01.09.2023 | | 100 | 100 | 0,00 |
| **Edison International** | | | | |
| 3,550 % fällig am 15.11.2024 | | 8.060 | 7.871 | 0,19 |
| **EDP Finance BV** | | | | |
| 1,710 % fällig am 24.01.2028 | | 12.700 | 10.895 | 0,27 |
| **Enel Finance International NV** | | | | |
| 0,375 % fällig am 28.05.2029 | € | 3.400 | 2.911 | 0,07 |
| 0,875 % fällig am 28.09.2034 | | 9.800 | 7.131 | 0,18 |
| 1,125 % fällig am 17.10.2034 | | 11.000 | 8.421 | 0,21 |
| 2,875 % fällig am 11.04.2029 | £ | 10.000 | 11.178 | 0,28 |
| **Evergy, Inc.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 15.09.2024 | $ | 12.600 | 12.125 | 0,30 |
| **Ipalco Enterprises, Inc.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 01.09.2024 | | 5.500 | 5.443 | 0,13 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,200 % fällig am 02.12.2026 | AUD | 2.000 | 1.218 | 0,03 |
| 3,954 % fällig am 15.06.2067 | $ | 791 | 594 | 0,01 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | | |
| 2,100 % fällig am 01.08.2027 | | 3.200 | 2.685 | 0,07 |
| 3,150 % fällig am 01.01.2026 | | 12.500 | 11.462 | 0,28 |
| 3,300 % fällig am 15.03.2027 ^ | | 2.800 | 2.511 | 0,06 |
| 3,300 % fällig am 01.12.2027 ^ | | 4.800 | 4.195 | 0,10 |
| 3,400 % fällig am 15.08.2024 ^ | | 5.700 | 5.483 | 0,14 |
| 3,500 % fällig am 15.06.2025 ^ | | 3.600 | 3.413 | 0,08 |
| 4,250 % fällig am 01.08.2023 | | 1.300 | 1.293 | 0,03 |
| 4,650 % fällig am 01.08.2028 | | 2.400 | 2.226 | 0,06 |
| 4,750 % fällig am 15.02.2044 ^ | | 1.700 | 1.306 | 0,03 |
| 5,450 % fällig am 15.06.2027 | | 4.000 | 3.875 | 0,10 |
| **San Diego Gas & Electric Co.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 01.09.2023 | | 100 | 101 | 0,00 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.11.2022 | | 2.900 | 2.921 | 0,07 |
| **Sprint Corp.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.09.2023 | | 3.400 | 3.516 | 0,09 |
| **TDC Net A/S** | | | | |
| 5,056 % fällig am 31.05.2028 | € | 5.100 | 4.996 | 0,12 |
| **Telefonica Chile S.A.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 12.10.2022 | $ | 19.300 | 19.344 | 0,48 |
| **VTR Comunicaciones SpA** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.01.2028 | | 798 | 577 | 0,01 |
| **WEC Energy Group, Inc.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 15.10.2027 | | 5.000 | 4.337 | 0,11 |
| | | | 155.198 | 3,82 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 1.620.098 | 39,86 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Chicago, Illinois General Obligation Bonds, Series 2015** | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.01.2042 | | 901 | 965 | 0,02 |
| **Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2020** | | | | |
| 3,301 % fällig am 01.06.2033 | | 7.125 | 6.113 | 0,15 |
| **University of California Revenue Notes, Series 2020** | | | | |
| 0,883 % fällig am 15.05.2025 | | 5.500 | 5.124 | 0,13 |
| | | | 12.202 | 0,30 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 1,001 % fällig am 25.07.2037 | | 199 | 194 | 0,01 |
| 1,066 % fällig am 25.12.2036 | | 43 | 43 | 0,00 |
| 1,356 % fällig am 25.09.2042 | | 474 | 468 | 0,01 |
| 1,511 % fällig am 01.12.2034 | | 25 | 26 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| 1,522 % fällig am 01.11.2035 | $ 29 | $ 28 | 0,00 |
| 1,524 % fällig am 01.10.2044 | 14 | 14 | 0,00 |
| 1,724 % fällig am 01.10.2040 | 9 | 9 | 0,00 |
| 1,744 % fällig am 25.03.2034 | 306 | 302 | 0,01 |
| 1,906 % fällig am 01.09.2035 | 7 | 7 | 0,00 |
| 1,913 % fällig am 01.09.2035 | 51 | 51 | 0,00 |
| 1,951 % fällig am 01.09.2034 | 9 | 9 | 0,00 |
| 1,957 % fällig am 01.09.2035 | 14 | 14 | 0,00 |
| 2,084 % fällig am 25.05.2035 | 31 | 31 | 0,00 |
| 2,246 % fällig am 01.03.2036 | 9 | 9 | 0,00 |
| 2,287 % fällig am 01.04.2033 | 6 | 6 | 0,00 |
| 2,299 % fällig am 01.11.2025 | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,323 % fällig am 01.03.2036 | 9 | 9 | 0,00 |
| 2,332 % fällig am 01.09.2039 | 13 | 13 | 0,00 |
| 2,352 % fällig am 01.05.2038 | 3.131 | 3.226 | 0,08 |
| 2,393 % fällig am 01.01.2036 | 9 | 9 | 0,00 |
| 2,430 % fällig am 01.11.2034 | 33 | 35 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.04.2032 | 13 | 13 | 0,00 |
| 2,569 % fällig am 01.06.2035 | 285 | 296 | 0,01 |
| 2,705 % fällig am 01.07.2035 | 12 | 12 | 0,00 |
| 3,095 % fällig am 01.07.2035 | 12 | 12 | 0,00 |
| 3,150 % fällig am 01.08.2027 | 976 | 966 | 0,02 |
| 3,679 % fällig am 01.05.2037 | 115 | 119 | 0,00 |
| 4,898 % fällig am 25.12.2042 | 63 | 63 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 25.04.2033 - 25.06.2043 | 179 | 186 | 0,01 |
| 5,019 % fällig am 01.09.2034 | 173 | 182 | 0,01 |
| 5,900 % fällig am 25.07.2042 | 37 | 39 | 0,00 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 0,650 % fällig am 22.10.2025 | 83.800 | 76.971 | 1,89 |
| 0,800 % fällig am 28.10.2026 | 13.600 | 12.222 | 0,30 |
| 1,285 % fällig am 25.08.2022 (a) | 34.006 | 1 | 0,00 |
| 1,524 % fällig am 25.02.2045 | 54 | 55 | 0,00 |
| 1,618 % fällig am 01.09.2035 | 27 | 27 | 0,00 |
| 1,676 % fällig am 25.10.2044 | 21 | 22 | 0,00 |
| 1,876 % fällig am 25.07.2044 | 121 | 126 | 0,00 |
| 2,051 % fällig am 01.11.2035 | 45 | 45 | 0,00 |
| 2,250 % fällig am 01.07.2032 | 4 | 4 | 0,00 |
| 2,369 % fällig am 01.09.2028 | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,423 % fällig am 01.01.2028 | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,694 % fällig am 01.07.2027 | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,750 % fällig am 15.09.2040 | 316 | 307 | 0,01 |
| 2,783 % fällig am 01.07.2030 | 0 | 0 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 01.10.2029 - 01.10.2047 | 911 | 919 | 0,02 |
| 4,500 % fällig am 01.04.2029 - 01.07.2033 | 133 | 135 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 01.06.2035 - 01.06.2039 | 2.128 | 2.287 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 01.10.2027 - 01.05.2040 | 4.966 | 5.390 | 0,13 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2028 | 44 | 47 | 0,00 |
| 7,402 % fällig am 15.03.2044 | 9.277 | 8.745 | 0,22 |
| **Ginnie Mae** | | | |
| 0,908 % fällig am 20.09.2065 | 1.566 | 1.553 | 0,04 |
| 1,117 % fällig am 20.11.2067 | 6.478 | 6.430 | 0,16 |
| 1,323 % fällig am 20.08.2062 | 1.229 | 1.223 | 0,03 |
| 1,403 % fällig am 20.08.2065 | 20.287 | 20.145 | 0,50 |
| 1,603 % fällig am 20.01.2066 | 10.213 | 10.162 | 0,25 |
| 1,625 % fällig am 20.07.2025 - 20.07.2034 | 50 | 50 | 0,00 |
| 1,750 % fällig am 20.12.2034 | 26 | 26 | 0,00 |
| 1,875 % fällig am 20.04.2030 | 5 | 5 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 20.10.2026 | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,625 % fällig am 20.02.2028 - 20.01.2032 | 26 | 26 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 15.10.2049 | 1.049 | 991 | 0,02 |
| 3,379 % fällig am 20.06.2067 | 3.444 | 3.434 | 0,09 |
| 5,000 % fällig am 15.03.2034 - 15.07.2048 | 1.119 | 1.177 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 20.09.2038 | 3 | 3 | 0,00 |
| 8,000 % fällig am 20.05.2031 | 7 | 8 | 0,00 |
| **Ginnie Mae, TBA** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.07.2052 | 5.500 | 4.886 | 0,12 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 13.000 | 13.050 | 0,32 |
| 5,000 % fällig am 01.07.2052 | 13.000 | 13.459 | 0,33 |
| **Small Business Administration** | | | |
| 5,870 % fällig am 01.07.2028 | 11 | 11 | 0,00 |
| 6,220 % fällig am 01.12.2028 | 573 | 608 | 0,02 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.03.2028 - 01.03.2029 | 12 | 12 | 0,00 |
| 3,500 % fällig am 01.01.2047 | $ 141 | $ 138 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 01.03.2023 - 01.04.2049 | 24.067 | 24.339 | 0,60 |
| 4,500 % fällig am 01.04.2023 - 01.11.2041 | 955 | 978 | 0,02 |
| 5,000 % fällig am 01.10.2031 - 01.04.2039 | 126 | 133 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 01.06.2023 - 01.03.2049 | 3.407 | 3.613 | 0,09 |
| 6,000 % fällig am 01.05.2024 - 01.02.2041 | 1.617 | 1.753 | 0,04 |
| 6,500 % fällig am 01.07.2034 - 01.03.2037 | 86 | 94 | 0,00 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 | 14.900 | 13.404 | 0,33 |
| 3,000 % fällig am 01.07.2052 | 580.700 | 540.787 | 13,31 |
| 3,500 % fällig am 01.07.2052 | 290.630 | 279.312 | 6,87 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 208.500 | 205.502 | 5,06 |
| 4,500 % fällig am 01.07.2037 - 01.08.2052 | 4.300 | 4.310 | 0,11 |
| 5,500 % fällig am 01.07.2052 | 200 | 208 | 0,01 |
| | | 1.265.528 | 31,14 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | |
| 1,375 % fällig am 15.11.2040 | 163.600 | 117.888 | 2,90 |
| 1,375 % fällig am 15.08.2050 | 73.400 | 48.348 | 1,19 |
| 1,625 % fällig am 15.11.2050 | 50.900 | 35.822 | 0,88 |
| 1,750 % fällig am 15.08.2041 | 19.500 | 14.841 | 0,36 |
| 1,875 % fällig am 15.02.2041 | 2.400 | 1.883 | 0,05 |
| 2,000 % fällig am 15.02.2050 | 21.700 | 16.826 | 0,41 |
| 2,500 % fällig am 15.02.2045 | 6.100 | 5.178 | 0,13 |
| 2,875 % fällig am 15.08.2045 | 5.200 | 4.728 | 0,12 |
| 3,000 % fällig am 15.05.2042 | 2.900 | 2.721 | 0,07 |
| 3,000 % fällig am 15.11.2044 | 138.800 | 128.753 | 3,17 |
| 3,125 % fällig am 15.11.2041 | 15.300 | 14.698 | 0,36 |
| 3,125 % fällig am 15.02.2043 | 5.600 | 5.326 | 0,13 |
| 3,125 % fällig am 15.08.2044 | 23.500 | 22.281 | 0,55 |
| 3,375 % fällig am 15.05.2044 | 47.300 | 46.725 | 1,15 |
| 3,625 % fällig am 15.02.2044 | 24.700 | 25.364 | 0,62 |
| 3,750 % fällig am 15.08.2041 | 18.600 | 19.558 | 0,48 |
| 3,750 % fällig am 15.11.2043 | 5.000 | 5.235 | 0,13 |
| 4,375 % fällig am 15.11.2039 | 10.100 | 11.677 | 0,29 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | |
| 1,750 % fällig am 30.06.2024 | 16.700 | 16.302 | 0,40 |
| 1,875 % fällig am 28.02.2027 | 16.700 | 15.853 | 0,39 |
| 2,875 % fällig am 15.05.2032 | 25.000 | 24.723 | 0,61 |
| | | 584.730 | 14,39 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | |
| 1,984 % fällig am 25.12.2046 | 134 | 117 | 0,00 |
| 4,086 % fällig am 25.02.2045 | 1 | 1 | 0,00 |
| 4,196 % fällig am 25.02.2044 | 197 | 216 | 0,01 |
| **Angel Oak Mortgage Trust** | | | |
| 1,469 % fällig am 25.06.2065 | 1.345 | 1.290 | 0,03 |
| **Ashford Hospitality Trust** | | | |
| 2,325 % fällig am 15.06.2035 | 11.700 | 11.352 | 0,28 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | |
| 2,574 % fällig am 20.09.2035 ^ | 950 | 840 | 0,02 |
| 2,966 % fällig am 25.05.2035 | 1.585 | 1.555 | 0,04 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | |
| 3,066 % fällig am 25.07.2035 ^ | 234 | 221 | 0,01 |
| 3,538 % fällig am 25.07.2034 | 200 | 191 | 0,01 |
| **BankUnited Trust** | | | |
| 2,224 % fällig am 25.09.2045 | 919 | 850 | 0,02 |
| **Barclays Commercial Mortgage Securities Trust** | | | |
| 4,314 % fällig am 15.12.2051 | 8.000 | 8.014 | 0,20 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 2,371 % fällig am 25.01.2034 | 160 | 158 | 0,00 |
| 2,512 % fällig am 25.04.2033 | 13 | 14 | 0,00 |
| 2,699 % fällig am 25.04.2034 | 185 | 175 | 0,00 |
| 2,714 % fällig am 25.04.2034 | 210 | 185 | 0,00 |
| 2,778 % fällig am 25.11.2030 | 2 | 2 | 0,00 |
| 2,817 % fällig am 25.02.2034 | 71 | 68 | 0,00 |
| 3,076 % fällig am 25.04.2034 | 93 | 89 | 0,00 |
| 3,374 % fällig am 25.12.2035 | 109 | 107 | 0,00 |
| 3,899 % fällig am 25.07.2034 | 6 | 6 | 0,00 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | |
| 1,944 % fällig am 25.02.2034 | 48 | 44 | 0,00 |
| 2,752 % fällig am 25.05.2035 | $ 431 | $ 414 | 0,01 |
| 3,074 % fällig am 25.09.2035 ^ | 438 | 291 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,470 % fällig am 25.10.2035 | 39 | 38 | 0,00 |
| 3,396 % fällig am 25.09.2037 ^ | 108 | 98 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | |
| 2,190 % fällig am 25.09.2035 | 1.058 | 1.051 | 0,03 |
| **Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 3,144 % fällig am 10.03.2048 | 5.293 | 5.247 | 0,13 |
| 3,545 % fällig am 10.02.2036 | 11.300 | 10.741 | 0,26 |
| 3,590 % fällig am 10.11.2047 | 12.200 | 12.034 | 0,30 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,074 % fällig am 25.08.2037 | 9.795 | 3.244 | 0,08 |
| 3,084 % fällig am 25.11.2035 | 7.598 | 7.081 | 0,17 |
| 5,500 % fällig am 25.02.2036 | 3.261 | 2.791 | 0,07 |
| 5,500 % fällig am 25.05.2036 ^ | 2.071 | 1.819 | 0,05 |
| 5,750 % fällig am 25.02.2037 | 3.392 | 2.098 | 0,05 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2036 | 4.903 | 3.333 | 0,08 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 ^ | 197 | 107 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 ^ | 6.371 | 4.585 | 0,11 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036 ^ | 268 | 176 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | 4.105 | 2.765 | 0,07 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 1,985 % fällig am 20.02.2036 ^ | 63 | 53 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.04.2046 | 955 | 842 | 0,02 |
| 2,125 % fällig am 19.07.2031 | 0 | 0 | 0,00 |
| 2,520 % fällig am 20.02.2035 | 117 | 118 | 0,00 |
| 2,680 % fällig am 20.10.2035 | 1.880 | 1.844 | 0,05 |
| 2,711 % fällig am 25.11.2034 | 424 | 409 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 ^ | 254 | 146 | 0,00 |
| **Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust** | | | |
| 1,964 % fällig am 25.06.2035 | 143 | 141 | 0,00 |
| 4,377 % fällig am 25.01.2034 ^ | 16 | 14 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2034 ^ | 30 | 29 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | |
| 2,857 % fällig am 25.06.2033 | 3 | 3 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.11.2035 ^ | 2.349 | 851 | 0,02 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | |
| 2,502 % fällig am 26.04.2038 | 1.259 | 1.256 | 0,03 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust** | | | |
| 5,750 % fällig am 25.04.2036 ^ | 783 | 477 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 ^ | 1.934 | 1.271 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | 598 | 275 | 0,01 |
| **Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,954 % fällig am 25.08.2037 ^ | 2.808 | 2.460 | 0,06 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,699 % fällig am 19.07.2044 | 11 | 11 | 0,00 |
| **Eurohome UK Mortgages PLC** | | | |
| 1,739 % fällig am 15.06.2044 | £ 2.622 | 3.105 | 0,08 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | |
| 2,572 % fällig am 25.10.2034 | $ 105 | 105 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 | 1.144 | 521 | 0,01 |
| **FirstMac Mortgage Funding Trust** | | | |
| 1,960 % fällig am 08.03.2049 | 131 | 131 | 0,00 |
| **GS Mortgage Securities Trust** | | | |
| 2,773 % fällig am 10.11.2045 | 7.871 | 7.857 | 0,19 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,867 % fällig am 25.01.2036 ^ | 1.402 | 1.390 | 0,03 |
| 2,938 % fällig am 25.09.2035 | 1.820 | 1.772 | 0,04 |
| 3,037 % fällig am 25.06.2034 | 57 | 56 | 0,00 |
| 3,093 % fällig am 25.06.2034 | 29 | 27 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.01.2037 ^ | 14 | 25 | 0,00 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,872 % fällig am 19.03.2037 | 3.515 | 3.164 | 0,08 |
| 2,052 % fällig am 19.05.2035 | 168 | 154 | 0,00 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | |
| 1,703 % fällig am 25.05.2053 | £ 30.738 | 37.261 | 0,92 |
| **IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 1,544 % fällig am 25.01.2032 | $ 1 | 1 | 0,00 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,864 % fällig am 25.06.2037 | 1.138 | 1.037 | 0,03 |
| **JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust** | | | |
| 3,358 % fällig am 15.11.2048 | 13.768 | 13.615 | 0,34 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,994 % fällig am 15.12.2049 | $ | 10.712 | $ 10.458 | 0,26 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,710 % fällig am 15.06.2035 | | 10.951 | 10.674 | 0,26 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | | |
| 2,947 % fällig am 25.07.2035 | | 139 | 134 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 339 | 191 | 0,00 |
| **Landmark Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 1,439 % fällig am 17.04.2044 | £ | 8.171 | 9.167 | 0,23 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 1,824 % fällig am 25.03.2047 | $ | 11.459 | 11.011 | 0,27 |
| 1,984 % fällig am 25.12.2036 | | 4.348 | 4.309 | 0,11 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | | |
| 2,398 % fällig am 25.01.2036 | | 13 | 13 | 0,00 |
| 3,052 % fällig am 21.11.2034 | | 2.007 | 1.920 | 0,05 |
| **MASTR Reperforming Loan Trust** | | | | |
| 7,000 % fällig am 25.05.2035 | | 605 | 476 | 0,01 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 2,124 % fällig am 25.11.2035 | | 292 | 278 | 0,01 |
| 2,820 % fällig am 25.02.2035 | | 795 | 764 | 0,02 |
| 3,466 % fällig am 25.06.2035 | | 381 | 369 | 0,01 |
| **Metlife Securitization Trust** | | | | |
| 3,750 % fällig am 25.03.2057 | | 7.258 | 7.087 | 0,17 |
| **Mortgage Equity Conversion Asset Trust** | | | | |
| 3,280 % fällig am 25.05.2042 | | 4.773 | 4.668 | 0,12 |
| **MortgageIT Trust** | | | | |
| 2,184 % fällig am 25.10.2035 | | 875 | 836 | 0,02 |
| **NAAC Reperforming Loan REMIC Trust** | | | | |
| 7,000 % fällig am 25.10.2034 ^ | | 501 | 457 | 0,01 |
| 7,500 % fällig am 25.03.2034 ^ | | 660 | 603 | 0,02 |
| **NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates** | | | | |
| 6,500 % fällig am 25.02.2035 ^ | | 2.184 | 2.022 | 0,05 |
| **New Residential Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,500 % fällig am 25.12.2057 | | 6.776 | 6.630 | 0,16 |
| **Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,694 % fällig am 25.02.2035 | | 502 | 500 | 0,01 |
| **Paragon Mortgages PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.11.2038 | € | 721 | 716 | 0,02 |
| **Pepper Residential Securities Trust** | | | | |
| 2,193 % fällig am 16.09.2059 | AUD | 8.789 | 6.030 | 0,15 |
| **Precise Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 12.12.2055 (b) | £ | 0 | 4.718 | 0,12 |
| **Prime Mortgage Trust** | | | | |
| 2,024 % fällig am 25.02.2034 | $ | 86 | 85 | 0,00 |
| **Primrose Residential DAC** | | | | |
| 0,238 % fällig am 24.03.2061 | € | 14.372 | 14.816 | 0,36 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 1,406 % fällig am 25.05.2037 ^ | $ | 2.635 | 2.048 | 0,05 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 | | 2.800 | 2.505 | 0,06 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 2.509 | 1.051 | 0,03 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 705 | 308 | 0,01 |
| **Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust** | | | | |
| 4,850 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 132 | 113 | 0,00 |
| **RESIMAC Bastille Trust** | | | | |
| 1,682 % fällig am 05.12.2059 | | 961 | 959 | 0,02 |
| **Resloc UK PLC** | | | | |
| 1,749 % fällig am 15.12.2043 | £ | 4.210 | 4.708 | 0,12 |
| **Ripon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,351 % fällig am 28.08.2056 | | 16.948 | 20.380 | 0,50 |
| **Stratton Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2060 | | 18.760 | 22.605 | 0,56 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,699 % fällig am 25.02.2036 ^ | $ | 1.705 | 1.551 | 0,04 |
| 2,701 % fällig am 25.04.2034 | | 2.000 | 1.994 | 0,05 |
| 2,716 % fällig am 25.09.2034 | | 278 | 279 | 0,01 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 1,844 % fällig am 25.09.2047 | | 11.802 | 10.099 | 0,25 |
| 2,075 % fällig am 19.04.2035 | | 314 | 296 | 0,01 |
| 2,095 % fällig am 19.07.2035 | | 226 | 214 | 0,01 |
| 2,175 % fällig am 19.05.2034 | | 207 | 197 | 0,01 |
| 2,184 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 732 | 673 | 0,02 |
| 2,255 % fällig am 19.09.2032 | | 28 | 27 | 0,00 |
| 2,474 % fällig am 25.05.2047 | | 7.774 | 6.517 | 0,16 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 7,500 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 690 | 448 | 0,01 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 3,394 % fällig am 25.06.2033 | $ | 3 | $ 3 | 0,00 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,397 % fällig am 25.09.2037 | | 2.912 | 2.836 | 0,07 |
| 4,783 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 2.090 | 1.722 | 0,04 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2045 | £ | 23.823 | 28.893 | 0,71 |
| 1,605 % fällig am 20.10.2051 | | 14.222 | 17.217 | 0,42 |
| **Trinity Square PLC** | | | | |
| 1,300 % fällig am 15.07.2059 | | 13.295 | 16.043 | 0,40 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | |
| 1,902 % fällig am 12.06.2053 | | 10.170 | 12.355 | 0,30 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,164 % fällig am 25.07.2045 | $ | 371 | 355 | 0,01 |
| 2,204 % fällig am 25.10.2045 | | 3.792 | 3.629 | 0,09 |
| 2,244 % fällig am 25.01.2045 | | 153 | 149 | 0,00 |
| 2,264 % fällig am 25.01.2045 | | 1.820 | 1.730 | 0,04 |
| 2,532 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 1.229 | 1.090 | 0,03 |
| 2,943 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 4.308 | 3.892 | 0,10 |
| 3,325 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 705 | 671 | 0,02 |
| **Warwick Finance Residential Mortgages PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.12.2049 (b) | £ | 0 | 445 | 0,01 |
| 1,742 % fällig am 21.12.2049 | | 12.787 | 15.517 | 0,38 |
| 2,442 % fällig am 21.12.2049 | | 2.030 | 2.460 | 0,06 |
| 2,942 % fällig am 21.12.2049 | | 1.015 | 1.226 | 0,03 |
| 3,442 % fällig am 21.12.2049 | | 580 | 700 | 0,02 |
| 3,942 % fällig am 21.12.2049 | | 580 | 699 | 0,02 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,074 % fällig am 25.05.2035 ^ | $ | 615 | 526 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 545 | 447 | 0,01 |
| **Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 1,770 % fällig am 25.02.2031 | | 1 | 1 | 0,00 |
| | | | 452.339 | 11,13 |

## FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,014 % fällig am 25.04.2036 | | 971 | 965 | 0,02 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,744 % fällig am 25.10.2036 | | 241 | 104 | 0,00 |
| 1,784 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 6.359 | 1.799 | 0,04 |
| **Ameriquest Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,209 % fällig am 25.03.2036 | | 645 | 640 | 0,02 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,269 % fällig am 25.01.2036 | | 401 | 401 | 0,01 |
| 2,329 % fällig am 25.01.2036 | | 3.539 | 3.521 | 0,09 |
| 2,554 % fällig am 25.05.2035 | | 5.726 | 5.692 | 0,14 |
| 2,644 % fällig am 25.10.2034 | | 1.918 | 1.898 | 0,05 |
| 2,734 % fällig am 25.03.2035 | | 4.705 | 4.606 | 0,11 |
| **Armada Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.07.2031 | € | 12.000 | 12.223 | 0,30 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | |
| 2,324 % fällig am 25.06.2034 | $ | 99 | 95 | 0,00 |
| **Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.12.2036 | | 2.766 | 2.711 | 0,07 |
| **Atlas Senior Loan Fund Ltd.** | | | | |
| 2,194 % fällig am 16.01.2030 | | 14.968 | 14.816 | 0,36 |
| **Avoca CLO DAC** | | | | |
| 0,690 % fällig am 15.07.2030 | € | 13.774 | 14.196 | 0,35 |
| 0,820 % fällig am 15.10.2032 | | 5.200 | 5.302 | 0,13 |
| **Barings CLO Ltd.** | | | | |
| 1,863 % fällig am 20.01.2028 | $ | 10.324 | 10.211 | 0,25 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,224 % fällig am 25.02.2036 | | 1.143 | 1.139 | 0,03 |
| 2,269 % fällig am 25.12.2035 | | 1.499 | 1.494 | 0,04 |
| 2,599 % fällig am 25.05.2035 | | 191 | 190 | 0,00 |
| 2,624 % fällig am 25.10.2037 | | 51 | 51 | 0,00 |
| 2,824 % fällig am 25.01.2045 | | 265 | 265 | 0,01 |
| **Black Diamond CLO DAC** | | | | |
| 0,980 % fällig am 15.05.2032 | € | 12.000 | 12.260 | 0,30 |
| **Blackrock European CLO DAC** | | | | |
| 0,620 % fällig am 15.10.2031 | | 13.000 | 13.143 | 0,32 |
| **BlueMountain CLO Ltd.** | | | | |
| 2,316 % fällig am 22.10.2030 | $ | 1.078 | 1.066 | 0,03 |
| **BlueMountain Fuji EUR CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 15.07.2030 | € | 2.369 | $ 2.439 | 0,06 |
| **BNPP AM Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,820 % fällig am 22.07.2032 | | 12.000 | 12.178 | 0,30 |
| **Bosphorus CLO DAC** | | | | |
| 0,820 % fällig am 15.12.2030 | | 300 | 307 | 0,01 |
| **Bridgepoint CLO DAC** | | | | |
| 1,210 % fällig am 15.01.2034 | | 1.000 | 1.027 | 0,03 |
| **Cairn CLO DAC** | | | | |
| 0,600 % fällig am 30.04.2031 | | 12.993 | 13.406 | 0,33 |
| 0,650 % fällig am 20.10.2028 | | 952 | 989 | 0,02 |
| **Carlyle Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 15.08.2030 | | 9.726 | 9.970 | 0,25 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,614 % fällig am 25.06.2035 | $ | 1.026 | 1.000 | 0,02 |
| **CIFC Funding Ltd.** | | | | |
| 2,224 % fällig am 16.11.2030 | | 1.400 | 1.381 | 0,03 |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,974 % fällig am 25.10.2037 | | 2.639 | 2.628 | 0,06 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,944 % fällig am 25.09.2036 | | 4.941 | 3.784 | 0,09 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 1,874 % fällig am 25.03.2037 | | 2.014 | 1.768 | 0,04 |
| **Commonbond Student Loan Trust** | | | | |
| 2,474 % fällig am 25.05.2041 | | 742 | 739 | 0,02 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 1.851 | 1.692 | 0,04 |
| 1,844 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 1.347 | 1.384 | 0,03 |
| 1,854 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 1.000 | 854 | 0,02 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.** | | | | |
| 2,479 % fällig am 25.08.2034 | | 216 | 212 | 0,01 |
| 2,524 % fällig am 25.10.2034 | | 957 | 918 | 0,02 |
| 3,424 % fällig am 25.08.2034 | | 511 | 509 | 0,01 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC** | | | | |
| 1,934 % fällig am 25.05.2046 | | 1.843 | 1.603 | 0,04 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | | |
| 1,684 % fällig am 25.11.2036 | | 124 | 62 | 0,00 |
| **CVC Cordatus Loan Fund DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 15.09.2031 | € | 13.000 | 13.287 | 0,33 |
| **FBR Securitization Trust** | | | | |
| 2,329 % fällig am 25.11.2035 | $ | 5.721 | 5.593 | 0,14 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,734 % fällig am 25.12.2037 | | 4.752 | 4.541 | 0,11 |
| 2,299 % fällig am 25.03.2034 | | 427 | 413 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.07.2034 | | 239 | 239 | 0,01 |
| 2,899 % fällig am 25.07.2034 | | 797 | 785 | 0,02 |
| **GE-WMC Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 1,704 % fällig am 25.08.2036 | | 35 | 17 | 0,00 |
| **Griffith Park CLO DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 21.11.2031 | € | 12.000 | 12.282 | 0,30 |
| **Grosvenor Place CLO BV** | | | | |
| 0,720 % fällig am 30.10.2029 | | 2.064 | 2.149 | 0,05 |
| **GSAMP Trust** | | | | |
| 1,764 % fällig am 25.12.2036 | $ | 12.630 | 7.232 | 0,18 |
| 1,864 % fällig am 25.01.2037 | | 439 | 283 | 0,01 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | € | 480 | 500 | 0,01 |
| 0,850 % fällig am 15.01.2032 | | 13.700 | 13.941 | 0,34 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 2,224 % fällig am 25.07.2036 | $ | 6.928 | 6.292 | 0,16 |
| 2,659 % fällig am 25.08.2035 | | 176 | 172 | 0,00 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | | |
| 2,164 % fällig am 25.12.2035 | | 3.374 | 3.345 | 0,08 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 2,059 % fällig am 25.05.2036 | | 4.000 | 3.772 | 0,09 |
| **Jubilee CLO DAC** | | | | |
| 0,610 % fällig am 15.04.2030 | € | 20.000 | 20.655 | 0,51 |
| **KVK CLO Ltd.** | | | | |
| 1,938 % fällig am 14.01.2028 | $ | 263 | 264 | 0,01 |
| **LCM LP** | | | | |
| 2,103 % fällig am 20.10.2027 | | 2.535 | 2.520 | 0,06 |
| **LoanCore Issuer Ltd.** | | | | |
| 2,454 % fällig am 15.05.2028 | | 860 | 858 | 0,02 |
| **Madison Park Euro Funding DAC** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.01.2032 | € | 12.300 | 12.451 | 0,31 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Man GLG Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,690 % fällig am 15.12.2031 | € | 11.100 | $ 11.356 | 0,28 |
| **Massachusetts Educational Financing Authority** | | | | |
| 2,134 % fällig am 25.04.2038 | $ | 7 | 7 | 0,00 |
| **Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,874 % fällig am 25.10.2037 | | 10.287 | 9.288 | 0,23 |
| **MF1 Ltd.** | | | | |
| 2,692 % fällig am 16.10.2036 | | 7.000 | 6.720 | 0,17 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.09.2036 | | 8.024 | 3.775 | 0,09 |
| 1,804 % fällig am 25.05.2037 | | 598 | 530 | 0,01 |
| 1,824 % fällig am 25.09.2036 | | 982 | 396 | 0,01 |
| 1,854 % fällig am 25.11.2036 | | 1.006 | 642 | 0,02 |
| 1,924 % fällig am 25.07.2036 | | 8.057 | 3.462 | 0,09 |
| 2,329 % fällig am 25.01.2035 | | 1.476 | 1.387 | 0,03 |
| 2,599 % fällig am 25.04.2035 | | 324 | 323 | 0,01 |
| **Mountain View CLO Ltd.** | | | | |
| 1,841 % fällig am 13.10.2027 | | 3.786 | 3.771 | 0,09 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,984 % fällig am 25.05.2036 | | 62 | 60 | 0,00 |
| 2,344 % fällig am 25.10.2035 | | 4.913 | 4.817 | 0,12 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.10.2031 | € | 11.700 | 11.982 | 0,30 |
| **Palmerston Park CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 18.04.2030 | | 7.176 | 7.388 | 0,18 |
| **Park Place Securities, Inc.** | | | | |
| 2,329 % fällig am 25.09.2035 | $ | 1.001 | 1.014 | 0,03 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,344 % fällig am 25.08.2035 | | 371 | 382 | 0,01 |
| **Purple Finance CLO DAC** | | | | |
| 0,800 % fällig am 25.01.2031 | € | 1.149 | 1.181 | 0,03 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,824 % fällig am 25.11.2034 | $ | 156 | 140 | 0,00 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 2,304 % fällig am 25.11.2035 | | 404 | 404 | 0,01 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 1,864 % fällig am 25.11.2036 | | 6.045 | 2.043 | 0,05 |
| 1,904 % fällig am 25.05.2036 | | 465 | 273 | 0,01 |
| **Starwood Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 2,528 % fällig am 15.07.2038 | | 9.711 | 9.638 | 0,24 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 2,004 % fällig am 25.03.2036 | $ | 888 | $ 865 | 0,02 |
| 2,389 % fällig am 25.08.2035 | | 598 | 580 | 0,01 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,779 % fällig am 25.09.2036 | | 7.738 | 5.579 | 0,14 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | |
| 2,163 % fällig am 20.01.2029 | | 19.145 | 18.961 | 0,47 |
| **WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust** | | | | |
| 1,984 % fällig am 25.04.2037 | | 5.133 | 2.190 | 0,05 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.10.2034 | | 1.054 | 1.021 | 0,03 |
| | | | 389.404 | 9,58 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Action Logement Services** | | | | |
| 0,500 % fällig am 30.10.2034 | € | 7.600 | 6.314 | 0,16 |
| **Canada Government International Bond** | | | | |
| 2,250 % fällig am 01.12.2029 | CAD | 38.600 | 28.168 | 0,69 |
| **Development Bank of Japan, Inc.** | | | | |
| 0,010 % fällig am 15.10.2024 | € | 6.600 | 6.668 | 0,17 |
| 0,875 % fällig am 10.10.2025 | | 4.300 | 4.374 | 0,11 |
| **Emirate of Abu Dhabi Government International Bond** | | | | |
| 3,125 % fällig am 16.04.2030 | $ | 10.000 | 9.507 | 0,23 |
| **Hungary Government International Bond** | | | | |
| 1,750 % fällig am 05.06.2035 | € | 10.000 | 7.396 | 0,18 |
| **Israel Government International Bond** | | | | |
| 3,800 % fällig am 13.05.2060 | $ | 18.400 | 15.378 | 0,38 |
| **Japan Finance Organization for Municipalities** | | | | |
| 0,010 % fällig am 02.02.2028 | € | 9.900 | 9.283 | 0,23 |
| **Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap** | | | | |
| 0,875 % fällig am 21.03.2046 | | 10.000 | 7.128 | 0,18 |
| **Paraguay Government International Bond** | | | | |
| 4,950 % fällig am 28.04.2031 | $ | 2.300 | 2.131 | 0,05 |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | PEN | 4.000 | 962 | 0,02 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 57.300 | 13.341 | 0,33 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 | | 46.400 | 11.515 | 0,28 |
| 8,200 % fällig am 12.08.2026 | | 12.900 | 3.550 | 0,09 |
| **Province of Ontario** | | | | |
| 1,850 % fällig am 01.02.2027 | CAD | 7.000 | 5.039 | 0,12 |
| **Province of Quebec** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.12.2022 | | 10.100 | 7.860 | 0,19 |
| **Romania Government International Bond** | | | | |
| 3,000 % fällig am 27.02.2027 | $ | 12.000 | $ 10.609 | 0,26 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 0,875 % fällig am 31.07.2033 | £ | 1.300 | 1.350 | 0,03 |
| | | | 150.573 | 3,70 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **ISRAEL TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,013) % fällig am 03.08.2022 (b)(c) | ILS | 54.380 | 15.528 | 0,38 |
| 0,000 % fällig am 02.11.2022 (b)(c) | | 35.200 | 10.031 | 0,25 |
| 0,860 % fällig am 03.05.2023 (b)(c) | | 17.820 | 5.033 | 0,12 |
| 0,886 % fällig am 03.05.2023 (b)(c) | | 24.000 | 6.779 | 0,17 |
| 1,181 % fällig am 02.03.2023 (b)(c) | | 35.600 | 10.078 | 0,25 |
| 1,203 % fällig am 02.03.2023 (b)(c) | | 7.400 | 2.095 | 0,05 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 49.544 | 1,22 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **$ 4.524.418** | **111,32** |
| | | **AKTIEN** | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (e)** | | 9.261.488 | 92.152 | 2,27 |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)** | | 19.533.432 | 194.318 | 4,78 |
| **Summe Investmentfonds** | | | **$ 286.470** | **7,05** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CIB | 1,450 % | 29.06.2022 | 06.07.2022 | $ 100.000 | U.S. Treasury Notes 0,500 % fällig am 30.04.2027 | $ (103.103) | $ 100.000 | $ 100.028 | 2,46 |
| FICC | 0,400 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 9.439 | U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | (9.628) | 9.439 | 9.439 | 0,23 |
| RCY | 1,480 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 90.500 | U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2024 | (92.428) | 90.500 | 90.504 | 2,23 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (205.159)** | **$ 199.939** | **$ 199.971** | **4,92** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 90-Day Eurodollar March Futures | Long | 03.2024 | 1.039 | $ (3.455) | (0,08) |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09.2022 | 1.633 | (10.614) | (0,26) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 2.469 | 3.353 | 0,08 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 207 | 1.525 | 0,04 |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 712 | 1.584 | 0,04 |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 137 | 597 | 0,02 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 2.208 | 1.378 | 0,03 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 3.930 | 395 | 0,01 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2022 | 363 | 859 | 0,02 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 40 | 50 | 0,00 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Long | 09.2022 | 287 | 582 | 0,01 |
| | | | | $ (3.746) | (0,09) |

## VERKAUFSOPTIONEN

### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CME Kaufoptionen mit Ausübungskurs von @USD 98,000 auf 3-Month SOFR December Futures | $ 98,000 | 15.12.2023 | 70 | $ (57) | $ (56) | 0,00 |
| Call - CME Verkaufoptionen mit Ausübungskurs von @USD 96,500 auf 3-Month SOFR December Futures | 96,500 | 15.12.2023 | 70 | (65) | (87) | (0,01) |
| | | | | $ (122) | $ (143) | (0,01) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ (3.889)** | **(0,10)** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag(3) | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 7.300 | $ (86) | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2023 | 8.300 | 442 | 0,01 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2024 | 4.700 | 28 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2024 | 5.500 | 85 | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.06.2025 | € 14.500 | 1.441 | 0,04 |
| Ryder System, Inc. | 1,000 | 20.12.2023 | $ 1.500 | 24 | 0,00 |
| | | | | $ 1.934 | 0,05 |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[2]

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag(3) | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-35 5-Year Index | (5,000) % | 20.12.2025 | $ 9.504 | $ 716 | 0,02 |
| CDX.HY-36 5-Year Index | (5,000 ) | 20.06.2026 | 5.346 | 554 | 0,01 |
| CDX.HY-38 5-Year Index | (5,000 ) | 20.06.2027 | 87.912 | (15) | 0,00 |
| CDX.IG-38 5-Year Index | (1,000 ) | 20.06.2027 | 370.300 | 693 | 0,02 |
| iTraxx Europe Main 37 10-Year Index | (1,000 ) | 20.06.2027 | € 50.000 | 67 | 0,00 |
| | | | | $ 2.015 | 0,05 |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag(3) | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Crossover 37 5-Year Index | 5,000 % | 20.06.2027 | € 67.900 | $ (6.174) | (0,15) |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 % | 21.09.2032 | £ 27.000 | $ (554) | (0,01) |
| Erhalt[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2052 | 108.300 | 15.451 | 0,38 |
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,800 | 10.03.2032 | 17.800 | (2.468) | (0,06) |
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,800 | 11.03.2032 | 17.800 | (2.946) | (0,07) |
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,800 | 15.03.2032 | 42.100 | (5.471) | (0,13) |
| Erhalt | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,900 | 10.03.2052 | 6.600 | 1.779 | 0,04 |
| Erhalt | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,900 | 11.03.2052 | 6.600 | 2.270 | 0,06 |
| Erhalt | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,900 | 15.03.2052 | 15.600 | 3.818 | 0,09 |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,062 | 18.09.2026 | ¥ 3.550.000 | (351) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,063 | 19.09.2026 | 7.000 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,064 | 19.09.2026 | 877.000 | (88) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,380 | 18.06.2028 | 5.170.000 | (159) | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,500 | 15.03.2042 | 4.651.000 | 994 | 0,02 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,662 | 19.04.2042 | 260.000 | 74 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,705 | 31.10.2038 | 1.180.000 | 74 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,750 | 20.03.2038 | 436.000 | (28) | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,750 | 20.12.2038 | 1.947.000 | 121 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,785 | 12.11.2038 | 600.000 | 20 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,800 | 22.10.2038 | 400.000 | 6 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,800 | 15.06.2052 | 4.070.000 | 1.870 | 0,05 |
| Zahlung[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,320 | 21.12.2023 | $ 74.825 | (1.025) | (0,03) |
| Zahlung[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,400 | 07.12.2024 | 152.700 | (2.020) | (0,05) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,573 | 28.02.2027 | 5.500 | (261) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,635 | 18.04.2027 | 30.000 | (1.399) | (0,03) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,690 | 19.04.2027 | 30.000 | (1.318) | (0,03) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,730 | 24.02.2032 | 14.800 | (1.203) | (0,03) |
| Erhalt[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,750 | 21.12.2052 | 53.300 | (1.171) | (0,03) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,765 | 16.03.2032 | 45.000 | (3.545) | (0,09) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,783 | 22.04.2027 | 16.200 | (643) | (0,02) |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,943 % | 21.04.2032 | $ | 27.800 | $ (1.776) | (0,04) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,150 | 15.06.2027 | | 88.100 | (2.221) | (0,05) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,200 | 15.06.2024 | | 88.100 | (1.149) | (0,03) |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,436 | 08.06.2032 | | 12.500 | 256 | 0,01 |
| Zahlung[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,130 | 21.06.2025 | | 205.500 | 986 | 0,02 |
| Zahlung[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,300 | 21.12.2023 | | 136.200 | 16 | 0,00 |
| Zahlung[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 3,530 | 21.06.2024 | | 196.200 | 949 | 0,02 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 7,900 | 02.01.2024 | BRL | 8.600 | 20 | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,838 | 02.01.2025 | | 385.800 | (2.476) | (0,06) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,023 | 02.01.2025 | | 364.200 | (2.063) | (0,05) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,065 | 02.01.2024 | | 115.000 | (579) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,371 | 02.01.2025 | | 144.500 | (668) | (0,02) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,030 | 02.01.2024 | | 202.300 | 631 | 0,02 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,195 | 02.01.2025 | | 68.200 | (108) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,275 | 02.01.2025 | | 41.300 | (55) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,590 | 02.01.2025 | | 49.300 | (15) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,235 | 04.03.2025 | CAD | 15.700 | (719) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month NZD-BBR | 3,750 | 15.06.2027 | NZD | 39.100 | 193 | 0,00 |
| Zahlung[4] | 3-Month NZD-BBR | 4,000 | 14.06.2024 | | 59.800 | 209 | 0,01 |
| Zahlung[4] | 3-Month USD-LIBOR | 1,270 | 04.11.2023 | $ | 449.500 | (1.989) | (0,05) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,800 | 22.08.2023 | | 134.700 | 3.550 | 0,09 |
| Zahlung[4] | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 4,500 | 20.06.2024 | AUD | 66.200 | 230 | 0,01 |
| Zahlung[4] | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 4,500 | 21.09.2027 | | 9.700 | 136 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,650 | 12.04.2027 | € | 25.000 | (1.150) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,750 | 15.06.2032 | | 269.850 | (20.590) | (0,51) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 13.05.2027 | | 21.000 | (678) | (0,02) |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,580 | 24.05.2024 | | 239.500 | (384) | (0,01) |
| | | | | | | $ (27.618) | (0,68) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | | **$ (29.843)** | **(0,73)** |

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

(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 Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,770 % | 04.08.2022 | 8.500 | $ 78 | $ 131 | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,013 | 04.08.2022 | 6.100 | 67 | 42 | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,043 | 04.08.2022 | 1.300 | 14 | 8 | 0,00 |
| BPS | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,000 | 15.03.2023 | 13.500 | 1.521 | 6.372 | 0,16 |
| | | | | | | | $ 1.680 | $ 6.553 | 0,16 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC AUD versus USD | $ 0,722 | 08.07.2022 | 27.700 | $ (144) | $ (1) | 0,00 |
| BRC | Call - OTC AUD versus USD | 0,738 | 11.08.2022 | 10.200 | (59) | (6) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC USD versus NOK | NOK 9,390 | 14.07.2022 | 17.900 | (158) | (5) | 0,00 |
| DUB | Call - OTC USD versus BRL | BRL 5,720 | 12.08.2022 | 4.410 | (72) | (25) | 0,00 |
| | Put - OTC USD versus NOK | NOK 9,245 | 13.07.2022 | 16.600 | (132) | (1) | 0,00 |
| MBC | Call - OTC USD versus BRL | BRL 5,615 | 09.08.2022 | 14.500 | (225) | (109) | (0,01) |
| | Put - OTC USD versus NOK | NOK 9,315 | 08.07.2022 | 14.200 | (117) | 0 | 0,00 |
| MYI | Call - OTC USD versus BRL | BRL 5,555 | 08.07.2022 | 17.660 | (248) | (11) | 0,00 |
| | Call - OTC USD versus BRL | 5,620 | 18.07.2022 | 27.110 | (405) | (56) | 0,00 |
| | Call - OTC USD versus BRL | 5,365 | 26.07.2022 | 7.100 | (113) | (92) | 0,00 |
| | | | | | $ (1.673) | $ (306) | (0,01) |

## ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,150 % | 01.12.2023 | 68.600 | $ (213) | $ (270) | (0,01) |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,650 | 01.12.2023 | 68.600 | (213) | (228) | (0,01) |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,680 | 07.07.2022 | 31.600 | (436) | (383) | (0,01) |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,690 | 07.07.2022 | 31.600 | (442) | (362) | (0,01) |
| BPS | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,175 | 15.03.2023 | 40.500 | (1.490) | (9.728) | (0,23) |
| DUB | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,350 | 08.08.2022 | 4.000 | (15) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,550 | 08.08.2022 | 4.000 | (16) | (80) | 0,00 |
| GLM | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,450 | 06.09.2022 | 6.800 | (43) | (39) | 0,00 |
| | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 06.09.2022 | 6.800 | (43) | (56) | 0,00 |
| | | | | | | | $ (2.911) | $ (11.146) | (0,27) |

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | $ 98,297 | 07.07.2022 | 3.500 | $ (22) | $ (5) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 99,141 | 07.07.2022 | 6.111 | (42) | (38) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2052 | 97,625 | 04.08.2022 | 18.200 | (102) | (83) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2052 | 97,695 | 04.08.2022 | 30.500 | (181) | (145) | (0,01) |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2052 | 97,820 | 04.08.2022 | 10.200 | (62) | (52) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2052 | 99,250 | 04.08.2022 | 12.200 | (61) | (41) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2052 | 99,367 | 04.08.2022 | 20.000 | (125) | (74) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2052 | 100,313 | 04.08.2022 | 17.000 | (53) | (122) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.07.2052 | 92,906 | 07.07.2022 | 14.800 | (123) | (39) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 98,516 | 07.09.2022 | 25.000 | (117) | (124) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,141 | 07.09.2022 | 8.000 | (30) | (53) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,156 | 07.09.2022 | 13.900 | (49) | (92) | 0,00 |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 101,141 | 07.09.2022 | 8.000 | (20) | (33) | 0,00 |
| MSC | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2052 | 93,098 | 04.08.2022 | 22.200 | (173) | (208) | (0,01) |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2052 | 97,859 | 04.08.2022 | 16.300 | (104) | (86) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2052 | 98,344 | 04.08.2022 | 19.000 | (94) | (135) | (0,01) |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 100,344 | 07.07.2022 | 4.800 | (23) | (12) | 0,00 |
| SAL | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 97,305 | 07.07.2022 | 12.000 | (75) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | 99,156 | 07.07.2022 | 10.889 | (78) | (69) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 99,078 | 07.07.2022 | 2.500 | (12) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2052 | 99,563 | 07.07.2022 | 3.000 | (16) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2052 | 99,281 | 04.08.2022 | 2.600 | (12) | (9) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2052 | 99,773 | 04.08.2022 | 40.400 | (107) | (199) | (0,01) |
| | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2052 | 101,281 | 04.08.2022 | 2.600 | (8) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 97,750 | 07.09.2022 | 13.700 | (86) | (48) | 0,00 |
| | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2052 | 99,406 | 07.09.2022 | 11.300 | (40) | (84) | 0,00 |
| | | | | | $ (1.815) | $ (1.759) | (0,04) |

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag(2) | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2027 | $ 2.000 | $ (96) | $ (70) | $ (166) | (0,01) |
| BRC | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 2.325 | (108) | (52) | (160) | (0,01) |
| CBK | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 700 | (25) | (33) | (58) | 0,00 |
| GST | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 4.400 | (187) | (178) | (365) | (0,01) |
| JPM | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 2.275 | (104) | (52) | (156) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 400 | (15) | (18) | (33) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 100 | (5) | 3 | (2) | 0,00 |
| MYC | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 6.500 | (308) | (231) | (539) | (0,01) |
| | | | | | $ (848) | $ (631) | $ (1.479) | (0,04) |

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

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

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | £ | 1.342 | $ | 1.683 | $ 53 | $ 0 | $ 53 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 6.677 | € | 6.256 | 0 | (137) | (137) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 989 | £ | 810 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 440 | BRL | 2.327 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 2.515 | ¥ | 333.600 | 0 | (53) | (53) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 20.837 | NOK | 198.398 | 0 | (739) | (739) | (0,02) |
| | 08.2022 | | 4.329 | PEN | 16.565 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 03.2023 | ILS | 7.339 | $ | 2.163 | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| | 05.2023 | PEN | 16.565 | | 4.222 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | AUD | 101.148 | | 70.176 | 622 | 0 | 622 | 0,02 |
| | 07.2022 | € | 20.216 | | 21.701 | 567 | 0 | 567 | 0,01 |
| | 07.2022 | £ | 1.286 | | 1.561 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | NZD | 493 | | 308 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 95.833 | € | 90.624 | 0 | (1.090) | (1.090) | (0,03) |
| | 07.2022 | | 15.376 | £ | 12.440 | 17 | (286) | (269) | (0,01) |
| | 08.2022 | INR | 3.367 | $ | 43 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09.2022 | TWD | 1.208 | | 43 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | £ | 2.076 | | 2.534 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 6.169 | £ | 5.028 | 0 | (63) | (63) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 3.883 | ¥ | 515.200 | 0 | (81) | (81) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 14.364 | NOK | 140.553 | 0 | (125) | (125) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | PEN | 22.321 | $ | 5.643 | 0 | (224) | (224) | (0,01) |
| | 07.2022 | $ | 6.958 | BRL | 36.088 | 0 | (82) | (82) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 35.775 | € | 33.447 | 0 | (808) | (808) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 4.573 | NOK | 44.826 | 0 | (35) | (35) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.429 | PEN | 5.359 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 08.2022 | ILS | 54.387 | $ | 16.604 | 1.051 | 0 | 1.051 | 0,03 |
| | 08.2022 | PEN | 16.565 | | 4.097 | 0 | (248) | (248) | (0,01) |
| | 08.2022 | $ | 440 | BRL | 2.326 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 2.268 | ¥ | 294.000 | 0 | (99) | (99) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 3.958 | PEN | 14.793 | 0 | (78) | (78) | 0,00 |
| | 09.2022 | PEN | 10.603 | $ | 2.750 | 0 | (23) | (23) | 0,00 |
| | 11.2022 | | 8.490 | | 2.139 | 0 | (68) | (68) | 0,00 |
| | 12.2022 | | 30.029 | | 7.562 | 18 | (243) | (225) | (0,01) |
| | 05.2023 | ILS | 41.467 | | 12.431 | 340 | 0 | 340 | 0,01 |
| DUB | 07.2022 | $ | 4.189 | NOK | 40.323 | 0 | (107) | (107) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 822 | PEN | 3.016 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 50 | PLN | 219 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | BRL | 4.662 | $ | 880 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03.2023 | ILS | 35.310 | | 10.411 | 155 | 0 | 155 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | $ | 779 | PEN | 2.919 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 2.836 | CLP | 2.453.181 | 0 | (242) | (242) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 5.729 | PEN | 21.495 | 0 | (94) | (94) | 0,00 |
| | 09.2022 | HKD | 13.315 | $ | 1.700 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11.2022 | ILS | 35.200 | | 11.368 | 1.230 | 0 | 1.230 | 0,03 |
| IND | 08.2022 | NOK | 196.230 | | 19.537 | 0 | (342) | (342) | (0,01) |
| JPM | 07.2022 | CZK | 5.140 | | 219 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 52.722 | | 7.840 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 08.2022 | ¥ | 1.041.547 | | 7.973 | 286 | 0 | 286 | 0,01 |
| | 08.2022 | NOK | 197.110 | | 19.875 | 0 | (93) | (93) | 0,00 |
| | 08.2022 | SGD | 286 | | 208 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 516 | | 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 2.944 | BRL | 15.382 | 0 | (35) | (35) | 0,00 |
| | 09.2022 | TWD | 1.431 | $ | 51 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | € | 1.040.508 | | 1.121.670 | 33.870 | 0 | 33.870 | 0,83 |
| | 07.2022 | £ | 2.248 | | 2.764 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 69.763 | AUD | 101.148 | 0 | (208) | (208) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 7.310 | CAD | 9.229 | 0 | (155) | (155) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 980.850 | € | 932.420 | 38 | (6.088) | (6.050) | (0,15) |
| | 07.2022 | | 3.182 | £ | 2.553 | 0 | (82) | (82) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 98.111 | $ | 67.578 | 98 | 0 | 98 | 0,00 |
| | 08.2022 | BRL | 15.368 | | 2.944 | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| | 08.2022 | CLP | 14.659.223 | | 17.494 | 1.956 | 0 | 1.956 | 0,05 |
| | 08.2022 | CNH | 119.929 | | 17.860 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 08.2022 | € | 920.371 | | 969.991 | 6.012 | 0 | 6.012 | 0,15 |
| | 08.2022 | ¥ | 4.831.400 | | 36.268 | 611 | 0 | 611 | 0,01 |
| | 05.2023 | CNH | 58.919 | | 8.779 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | BRL | 47.848 | | 9.117 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | CHF | 52 | | 55 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | € | 305 | | 321 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 1.463 | | 1.767 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07.2022 | SGD | 61 | | 44 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 3 | € | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 266 | £ | 219 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | INR | 5.655 | $ | 72 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | TWD | 219 | | 7 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08.2022 | $ | 4.498 | CLP | 3.939.168 | $ 0 | $ (333) | $ (333) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 11 | KRW | 13.618 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | TWD | 584 | $ | 21 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| RBC | 07.2022 | $ | 9.177 | CAD | 11.799 | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 11.800 | $ | 9.177 | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| RYL | 08.2022 | NOK | 90.880 | | 9.165 | 0 | (41) | (41) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | $ | 1.798 | BRL | 9.393 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 146 | ILS | 493 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 283 | PEN | 1.068 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | CNH | 212.739 | $ | 31.758 | 40 | 0 | 40 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 2.688 | ¥ | 349.000 | 0 | (112) | (112) | 0,00 |
| | 11.2022 | PEN | 54.303 | $ | 13.100 | 0 | (992) | (992) | (0,02) |
| | 12.2022 | | 53.438 | | 12.763 | 0 | (1.101) | (1.101) | (0,03) |
| SOG | 07.2022 | $ | 357.659 | £ | 293.885 | 0 | (749) | (749) | (0,02) |
| | 08.2022 | £ | 293.885 | $ | 357.825 | 744 | 0 | 744 | 0,02 |
| | 08.2022 | $ | 22.069 | NOK | 216.437 | 0 | (143) | (143) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | BRL | 7.148 | $ | 1.382 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 07.2022 | CAD | 64.752 | | 50.696 | 499 | 0 | 499 | 0,01 |
| | 07.2022 | £ | 305.033 | | 384.562 | 14.113 | 0 | 14.113 | 0,35 |
| | 07.2022 | $ | 27.697 | CAD | 35.632 | 5 | (80) | (75) | 0,00 |
| | 08.2022 | CAD | 35.634 | $ | 27.697 | 79 | (5) | 74 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 1.371 | BRL | 7.148 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | NOK | 85.223 | $ | 8.762 | 134 | 0 | 134 | 0,00 |
| | 07.2022 | NZD | 415 | | 267 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.798 | BRL | 9.398 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 9.779 | CLP | 8.549.214 | 0 | (739) | (739) | (0,02) |
| | 09.2022 | HKD | 4.829 | $ | 617 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | MXN | 2.194 | | 110 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | | | | | | $ 62.746 | $ (16.461) | $ 46.285 | 1,14 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | CAD | 167 | $ | 129 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 5.753 | CAD | 7.301 | 0 | (93) | (93) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CAD | 171 | $ | 133 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 280 | CAD | 355 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | | 182 | | 229 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | CAD | 109 | $ | 85 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RBC | 07.2022 | | 4.356 | | 3.388 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 3.388 | CAD | 4.357 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | | 5.799 | | 7.336 | 0 | (112) | (112) | (0,01) |
| TOR | 07.2022 | CAD | 5.723 | $ | 4.452 | 16 | (1) | 15 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 5.313 | CAD | 6.786 | 0 | (52) | (52) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 4.452 | | 5.723 | 1 | (16) | (15) | 0,00 |
| | | | | | | $ 28 | $ (294) | $ (266) | (0,01) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | CHF | 112 | $ | 112 | $ 0 | $ (5) | $ (5) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 6.103 | CHF | 5.832 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | CHF | 9 | $ | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 190 | CHF | 182 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | | 6.092 | | 5.831 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | CHF | 5.454 | $ | 5.741 | 45 | 0 | 45 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 5.855 | CHF | 5.616 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 5.741 | | 5.444 | 0 | (44) | (44) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | CHF | 260 | $ | 273 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 21 | CHF | 20 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | CHF | 84 | $ | 85 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 2 | CHF | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 57 | $ (63) | $ (6) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class R EUR (Hedged) thesaurierend und Class T EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | $ 3.415 | € 3.197 | $ 0 | $ (73) | $ (73) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | € 386.996 | $ 407.046 | 2.461 | 0 | 2.461 | 0,06 |
| | 07.2022 | $ 19.903 | € 18.685 | 0 | (369) | (369) | (0,01) |
| | 08.2022 | 402.325 | 381.815 | 0 | (2.419) | (2.419) | (0,06) |
| CBK | 07.2022 | € 23 | $ 24 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 17.623 | € 16.413 | 0 | (463) | (463) | (0,01) |
| MBC | 07.2022 | € 391.092 | $ 411.424 | 2.569 | (12) | 2.557 | 0,06 |
| | 07.2022 | $ 422.214 | € 391.566 | 0 | (12.852) | (12.852) | (0,32) |
| | 08.2022 | 402.399 | 381.815 | 0 | (2.494) | (2.494) | (0,06) |
| SOG | 07.2022 | 416.375 | 387.395 | 0 | (11.373) | (11.373) | (0,28) |
| UAG | 07.2022 | 345.693 | 321.694 | 0 | (9.378) | (9.378) | (0,23) |
| | | | | $ 5.031 | $ (39.433) | $ (34.402) | (0,85) |

Zum 30. Juni 2022 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 Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | £ 61 | $ 77 | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 17.607 | £ 13.949 | 0 | (666) | (666) | (0,02) |
| BPS | 07.2022 | £ 518 | $ 630 | 2 | (1) | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 1.657 | £ 1.316 | 0 | (59) | (59) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | £ 40 | $ 49 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 16.306 | £ 12.927 | 0 | (608) | (608) | (0,01) |
| MBC | 07.2022 | £ 19 | $ 23 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 21 | £ 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | 26 | 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | £ 83 | $ 101 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | 13.171 | 16.029 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 16.036 | £ 13.171 | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | 16.639 | 13.198 | 0 | (611) | (611) | (0,02) |
| | | | | $ 40 | $ (1.978) | $ (1.938) | (0,05) |

Zum 30. Juni 2022 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 Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | SGD 7.871 | $ 5.664 | $ 8 | $ 0 | $ 8 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 12.123 | SGD 16.610 | 0 | (188) | (188) | 0,00 |
| | 08.2022 | 5.664 | 7.871 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | SGD 15.929 | $ 11.466 | 20 | 0 | 20 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ 37 | SGD 50 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | 11.362 | 15.786 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | SGD 145 | $ 104 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 37 | SGD 51 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | 372 | 510 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 12.754 | 17.430 | 0 | (230) | (230) | (0,01) |
| UAG | 07.2022 | SGD 487 | $ 350 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 13.204 | SGD 18.080 | 0 | (212) | (212) | (0,01) |
| | | | | $ 30 | $ (663) | $ (633) | (0,01) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **$ 903** | **0,02** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.07.2052 | $ 16.100 | $ (13.977) | (0,34) |
| 2,000 % fällig am 01.08.2052 | 16.200 | (14.048) | (0,35) |
| 2,500 % fällig am 01.07.2052 (g) | 55.000 | (49.479) | (1,22) |
| 2,500 % fällig am 14.07.2052 | 9.600 | (8.636) | (0,21) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (86.140)** | **(2,12)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 4.891.858** | **120,36** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (827.438)** | **(20,36)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 4.064.420** | **100,00** |

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Nullkuponwertpapier.

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

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

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Zum 30. Juni 2022 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

(h) Eingeschränkte Wertpapiere:

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeits-datum | Kauf-datum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Citigroup, Inc. | 2,572 % | 03.06.2031 | 26.05.2020 | $ 4.000 | $ 3.366 | 0,08 |
| General Motors Co. | 6,125 | 01.10.2025 | 07.05.2020 - 28.05.2020 | 3.287 | 3.313 | 0,08 |
| | | | | $ 7.287 | $ 6.679 | 0,16 |

(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 9.632 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 90.576 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 38.412 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 4.524.418 | $ 0 | $ 4.524.418 |
| Investmentfonds | 286.470 | 0 | 0 | 286.470 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 199.939 | 0 | 199.939 |
| Finanzderivate[3] | (2.973) | (29.856) | 0 | (32.829) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (86.140) | 0 | (86.140) |
| **Summen** | **$ 283.497** | **$ 4.608.361** | **$ 0** | **$ 4.891.858** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 5.405.196 | $ 0 | $ 5.405.196 |
| Investmentfonds | 423.494 | 0 | 0 | 423.494 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 7.152 | 0 | 7.152 |
| Finanzderivate[3] | 11.552 | (9.935) | 0 | 1.617 |
| **Summen** | **$ 435.046** | **$ 5.402.413** | **$ 0** | **$ 5.837.459** |

(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 2022:**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | (1,750) % | 23.05.2022 | TBD[1] | € (7.430) | $ (7.758) | (0,19) |
| | (1,200) | 18.05.2022 | TBD[1] | (536) | (559) | (0,01) |
| | (1,150) | 02.11.2021 | 11.01.2023 | (1.504) | (1.560) | (0,04) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (9.877)** | **(0,24)** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (3.517) | $ 4.220 | $ 703 |
| BPS | (4.076) | 4.290 | 214 |
| BRC | (1.029) | 690 | (339) |
| CBK | (1.048) | 1.361 | 313 |
| DUB | (79) | 290 | 211 |
| GLM | 787 | (630) | 157 |
| GST | (365) | 260 | (105) |
| IND | (342) | 510 | 168 |
| JPM | (386) | 640 | 254 |
| MBC | 23.178 | (21.040) | 2.138 |
| MSC | (441) | 800 | 359 |
| MYC | (539) | 470 | (69) |
| MYI | (501) | 616 | 115 |
| RYL | (41) | 0 | (41) |
| SAL | (417) | 590 | 173 |
| SCX | (2.519) | 2.615 | 96 |
| SOG | (11.520) | 11.910 | 390 |
| TOR | 13.947 | (14.560) | (613) |
| UAG | (10.189) | 9.150 | (1.039) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 56,68 | 66,72 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 53,54 | 41,50 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 1,10 | 1,09 |
| Investmentfonds | 7,05 | 8,56 |
| Pensionsgeschäfte | 4,92 | 0,14 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,10) | 0,28 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,73) | 0,12 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,02 | (0,36) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (2,12) | k. A. |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (0,24) | (4,57) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 39,86 | 48,35 |
| Kommunalanleihen und Wechsel | 0,30 | 0,62 |
| US-Regierungsbehörden | 31,14 | 19,94 |
| US-Schatzobligationen | 14,39 | 15,86 |
| Non-Agency-MBS | 11,13 | 10,80 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 9,58 | 8,48 |
| Staatsemissionen | 3,70 | 3,77 |
| Kurzfristige Instrumente | 1,22 | 1,49 |
| Investmentfonds | 7,05 | 8,56 |
| Pensionsgeschäfte | 4,92 | 0,14 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,09) | 0,28 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | (0,01) | 0,00 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,05 | 0,06 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | 0,05 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | (0,15) | 0,00 |
| Zinsswaps | (0,68) | 0,06 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoption | 0,16 | 0,08 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Devisenoptionen | (0,01) | k. A. |
| Zinsswapoption | (0,27) | (0,15) |
| Optionen auf Wertpapiere | (0,04) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,04) | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | 1,14 | (0,62) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (0,92) | 0,33 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (2,12) | k. A. |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (20,36) | (18,05) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **American Express Co.** | | | | |
| 1,896 % fällig am 01.08.2022 | $ | 570 | $ 570 | 0,46 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 31.01.2023 | | 1.000 | 1.000 | 0,81 |
| **Aozora Bank Ltd.** | | | | |
| 1,050 % fällig am 09.09.2024 | | 500 | 467 | 0,38 |
| **Athene Global Funding** | | | | |
| 2,192 % fällig am 01.07.2022 | | 300 | 300 | 0,24 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 0,875 % fällig am 18.09.2023 | | 1.000 | 965 | 0,78 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 2,401 % fällig am 05.03.2024 | | 100 | 99 | 0,08 |
| 3,004 % fällig am 20.12.2023 | | 900 | 897 | 0,73 |
| **Bank of Nova Scotia** | | | | |
| 2,406 % fällig am 11.03.2024 | | 500 | 498 | 0,40 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 3,505 % fällig am 15.06.2023 | AUD | 500 | 346 | 0,28 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 10.01.2024 | $ | 1.000 | 994 | 0,80 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 2,544 % fällig am 17.05.2024 | | 300 | 298 | 0,24 |
| 2,876 % fällig am 24.07.2023 | | 800 | 800 | 0,65 |
| **CK Hutchison International Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 11.04.2024 | | 1.000 | 996 | 0,80 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 2,235 % fällig am 26.05.2023 | AUD | 1.000 | 689 | 0,56 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 2,997 % fällig am 14.12.2023 | $ | 400 | 397 | 0,32 |
| **Danske Bank A/S** | | | | |
| 2,781 % fällig am 12.09.2023 | | 300 | 300 | 0,24 |
| 5,375 % fällig am 12.01.2024 | | 900 | 909 | 0,73 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,898 % fällig am 28.05.2024 (d) | | 1.000 | 938 | 0,76 |
| 3,950 % fällig am 27.02.2023 | | 300 | 299 | 0,24 |
| **Fidelity National Financial, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.09.2022 | | 1.000 | 1.004 | 0,81 |
| **First Abu Dhabi Bank PJSC** | | | | |
| 2,221 % fällig am 08.08.2023 | | 500 | 500 | 0,40 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 3,350 % fällig am 01.11.2022 | | 400 | 398 | 0,32 |
| 4,250 % fällig am 20.09.2022 | | 300 | 300 | 0,24 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 05.01.2023 | | 1.200 | 1.198 | 0,97 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 02.05.2024 | AUD | 1.300 | 900 | 0,73 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 3,033 % fällig am 22.11.2023 | $ | 1.500 | 1.493 | 1,21 |
| **Huntington National Bank** | | | | |
| 2,419 % fällig am 16.05.2025 | | 1.100 | 1.090 | 0,88 |
| **ING Bank Australia Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 26.05.2025 | AUD | 1.600 | 1.083 | 0,88 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,969 % fällig am 23.06.2025 | $ | 1.000 | 936 | 0,76 |
| 2,414 % fällig am 24.10.2023 | | 100 | 100 | 0,08 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 2,907 % fällig am 07.11.2023 | | 1.000 | 997 | 0,81 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | |
| 1,974 % fällig am 25.07.2022 | | 300 | 300 | 0,24 |
| 3,837 % fällig am 17.04.2026 | | 500 | 494 | 0,40 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 3,766 % fällig am 08.03.2024 | | 1.000 | 998 | 0,81 |
| **Nissan Motor Acceptance Co. LLC** | | | | |
| 1,671 % fällig am 13.07.2022 | | 300 | 300 | 0,24 |
| 2,305 % fällig am 08.03.2024 | | 700 | 683 | 0,55 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | | |
| 2,924 % fällig am 28.09.2022 | | 1.000 | 997 | 0,81 |
| **Nordea Bank Abp** | | | | |
| 2,538 % fällig am 30.08.2023 | | 1.000 | 999 | 0,81 |
| **Santander Holdings USA, Inc.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 18.01.2023 | | 1.000 | 999 | 0,81 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 1,319 % fällig am 14.10.2023 | $ | 800 | $ 794 | 0,64 |
| 2,209 % fällig am 23.11.2025 | | 200 | 195 | 0,16 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | |
| 2,436 % fällig am 07.03.2023 | AUD | 1.200 | 826 | 0,67 |
| **Toronto-Dominion Bank** | | | | |
| 2,332 % fällig am 08.03.2024 | $ | 200 | 199 | 0,16 |
| **UBS AG** | | | | |
| 1,619 % fällig am 09.08.2024 | | 1.200 | 1.192 | 0,96 |
| | | | 30.737 | 24,85 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **7-Eleven, Inc.** | | | | |
| 0,625 % fällig am 10.02.2023 | | 500 | 491 | 0,40 |
| **Amazon.com, Inc.** | | | | |
| 2,730 % fällig am 13.04.2024 | | 1.000 | 993 | 0,80 |
| **Ausgrid Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 30.10.2024 | AUD | 1.000 | 675 | 0,55 |
| **Barry Callebaut Services NV** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.06.2023 | $ | 1.000 | 1.006 | 0,81 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | |
| 3,222 % fällig am 15.08.2024 | | 1.000 | 973 | 0,79 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** | | | | |
| 2,839 % fällig am 15.12.2023 | | 800 | 796 | 0,64 |
| **Boeing Co.** | | | | |
| 1,167 % fällig am 04.02.2023 | | 600 | 593 | 0,48 |
| 4,508 % fällig am 01.05.2023 | | 500 | 501 | 0,40 |
| **CNH Industrial NV** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.08.2023 | | 1.000 | 1.009 | 0,82 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 5,450 % fällig am 15.06.2023 | | 1.007 | 1.018 | 0,82 |
| **Discovery Communications LLC** | | | | |
| 2,950 % fällig am 20.03.2023 | | 1.000 | 994 | 0,80 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2024 | | 500 | 503 | 0,41 |
| **Hyundai Capital America** | | | | |
| 2,850 % fällig am 01.11.2022 | | 400 | 399 | 0,32 |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 26.07.2024 | | 700 | 678 | 0,55 |
| **Nissan Motor Co. Ltd.** | | | | |
| 3,043 % fällig am 15.09.2023 | | 300 | 295 | 0,24 |
| **Panasonic Holdings Corp.** | | | | |
| 2,536 % fällig am 19.07.2022 | | 1.220 | 1.220 | 0,99 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.04.2023 | | 1.000 | 1.010 | 0,82 |
| **SK Broadband Co. Ltd.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 13.08.2023 | | 1.000 | 1.005 | 0,81 |
| **SK Hynix, Inc.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 19.01.2024 | | 600 | 573 | 0,46 |
| **Stellantis NV** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.04.2023 | | 1.000 | 1.009 | 0,82 |
| **Thermo Fisher Scientific, Inc.** | | | | |
| 1,225 % fällig am 18.04.2023 | | 600 | 597 | 0,48 |
| **Time Warner Entertainment Co. LP** | | | | |
| 8,375 % fällig am 15.03.2023 | | 400 | 412 | 0,33 |
| **TWDC Enterprises Corp.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 13.09.2022 | | 500 | 500 | 0,40 |
| | | | 17.250 | 13,94 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 2,301 % fällig am 15.02.2023 | | 400 | 400 | 0,32 |
| **Atmos Energy Corp.** | | | | |
| 2,070 % fällig am 09.03.2023 | | 1.100 | 1.098 | 0,89 |
| **Chugoku Electric Power Co., Inc.** | | | | |
| 2,401 % fällig am 27.08.2024 | | 1.000 | 968 | 0,78 |
| **Duke Energy Corp.** | | | | |
| 1,688 % fällig am 10.06.2023 | | 500 | 496 | 0,40 |
| **Engie S.A.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 10.10.2022 | | 1.000 | 998 | 0,81 |
| **Hydro One, Inc.** | | | | |
| 0,710 % fällig am 16.01.2023 | CAD | 300 | 229 | 0,19 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,066 % fällig am 21.03.2024 | $ | 500 | 496 | 0,40 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | | |
| 1,700 % fällig am 15.11.2023 | $ | 600 | $ 578 | 0,47 |
| | | | 5.263 | 4,26 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 53.250 | 43,05 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **California Infrastructure & Economic Development Bank Revenue Bonds, Series 2020** | | | | |
| 0,850 % fällig am 01.01.2050 | | 1.000 | 987 | 0,80 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Ginnie Mae** | | | | |
| 1,633 % fällig am 20.08.2066 | | 549 | 548 | 0,44 |
| 3,096 % fällig am 20.09.2066 | | 561 | 579 | 0,47 |
| | | | 1.127 | 0,91 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **DBWF Mortgage Trust** | | | | |
| 2,625 % fällig am 19.12.2030 | | 500 | 486 | 0,39 |
| **Dilosk RMBS DAC** | | | | |
| 0,382 % fällig am 20.02.2060 | € | 362 | 376 | 0,30 |
| **Sage AR Funding PLC** | | | | |
| 1,858 % fällig am 17.11.2030 | £ | 200 | 241 | 0,20 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,605 % fällig am 20.10.2051 | | 245 | 297 | 0,24 |
| **Towd Point Mortgage Trust** | | | | |
| 2,224 % fällig am 25.02.2057 | $ | 130 | 129 | 0,10 |
| **Trinity Square PLC** | | | | |
| 1,300 % fällig am 15.07.2059 | £ | 161 | 194 | 0,16 |
| **Tudor Rose Mortgages** | | | | |
| 1,390 % fällig am 20.06.2048 | | 412 | 494 | 0,40 |
| | | | 2.217 | 1,79 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Carlyle Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,890 % fällig am 15.08.2032 | € | 300 | 304 | 0,24 |
| **EFS Volunteer LLC** | | | | |
| 2,034 % fällig am 25.10.2035 | $ | 185 | 184 | 0,15 |
| **Euro-Galaxy CLO DAC** | | | | |
| 0,620 % fällig am 24.04.2034 | € | 250 | 255 | 0,21 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 26.06.2030 | | 247 | 254 | 0,20 |
| **Oak Hill European Credit Partners DAC** | | | | |
| 0,740 % fällig am 20.10.2031 | | 300 | 305 | 0,25 |
| **SLM Private Credit Student Loan Trust** | | | | |
| 2,119 % fällig am 15.06.2039 | $ | 446 | 422 | 0,34 |
| | | | 1.724 | 1,39 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Emirate of Abu Dhabi Government International Bond** | | | | |
| 0,750 % fällig am 02.09.2023 | | 1.500 | 1.453 | 1,18 |
| **Export-Import Bank of India** | | | | |
| 2,505 % fällig am 21.08.2022 | | 300 | 301 | 0,24 |
| **Israel Government International Bond** | | | | |
| 0,750 % fällig am 31.07.2022 | ILS | 360 | 103 | 0,08 |
| **Korea Expressway Corp.** | | | | |
| 1,956 % fällig am 02.09.2023 | AUD | 1.000 | 687 | 0,56 |
| **Korea National Oil Corp.** | | | | |
| 1,919 % fällig am 16.07.2023 | $ | 800 | 804 | 0,65 |
| | | | 3.348 | 2,71 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | | |
| **Mizuho Bank, Ltd.** | | | | |
| 1,181 % fällig am 15.07.2022 | | 1.200 | 1.199 | 0,97 |
| **AUSTRALIA TREASURY BILLS** | | | | |
| 0,150 % fällig am 08.07.2022 (a)(b) | AUD | 2.200 | 1.513 | 1,22 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ISRAEL TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,020) % fällig am 07.12.2022 (a)(b) | ILS | 300 | $85 | 0,07 |
| (0,005) % fällig am 03.08.2022 (a)(b) | | 4.100 | 1.171 | 0,95 |
| 1,203 % fällig am 02.03.2023 (a)(b) | | 350 | 99 | 0,08 |
| | | | 1.355 | 1,10 |
| **U.S. TREASURY BILLS** | | | | |
| 0,589 % fällig am 12.07.2022 (a)(b) | $ | 2.800 | 2.799 | 2,26 |
| 0,672 % fällig am 07.07.2022 (a)(b) | | 1.200 | 1.200 | 0,97 |
| 2,106 % fällig am 25.10.2022 (a)(b) | | 9.100 | 9.041 | 7,31 |
| | | | 13.040 | 10,54 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 17.107 | 13,83 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **$ 79.760** | **64,48** |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (c)** | 1.026.238 | $ 10.209 | 8,26 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (c)** | 20.400 | 2.019 | 1,63 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$ 12.228** | **9,89** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| NOM | 1,480 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 19.200 | U.S. Treasury Bonds 2,250 % fällig am 15.11.2025 | $ (19.635) | $ 19.200 | $ 19.201 | 15,53 |
| SSB | 0,400 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 575 | U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026 | (587) | 575 | 575 | 0,46 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (20.222)** | **$ 19.775** | **$ 19.776** | **15,99** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month Canada Bankers' Acceptance September Futures | Short | 09.2023 | 59 | $ (20) | (0,02) |
| 3-Month Euribor September Futures | Short | 09.2023 | 96 | 209 | 0,17 |
| 3-Month SOFR September Futures | Short | 12.2023 | 62 | (50) | (0,04) |
| Amsterdam Index July Futures | Short | 07.2022 | 2 | 0 | 0,00 |
| Australia Government 3-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 36 | (36) | (0,03) |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 67 | 1 | 0,00 |
| BIST 30 Index August Futures | Long | 08.2022 | 1.017 | (111) | (0,09) |
| CAC 40 Index July Futures | Short | 07.2022 | 5 | 4 | 0,00 |
| DAX Index September Futures | Short | 09.2022 | 1 | 13 | 0,01 |
| E-mini NASDAQ 100 Index September Futures | Short | 09.2022 | 7 | 4 | 0,00 |
| E-mini Russell 2000 Index September Futures | Short | 09.2022 | 9 | 36 | 0,03 |
| E-mini S&P 500 Index September Futures | Short | 09.2022 | 3 | (2) | 0,00 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09.2022 | 26 | 6 | 0,00 |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 19 | 83 | 0,07 |
| FTSE 100 Index September Futures | Short | 09.2022 | 8 | 3 | 0,00 |
| FTSE China A50 Index July Futures | Short | 07.2022 | 92 | (30) | (0,02) |
| FTSE Taiwan Index July Futures | Short | 07.2022 | 46 | 108 | 0,09 |
| FTSE/JSE Index September Futures | Short | 09.2022 | 34 | 4 | 0,00 |
| FTSE/MIB Index September Futures | Short | 09.2022 | 3 | 9 | 0,01 |
| Hang Seng China Enterprises Index July Futures | Long | 07.2022 | 1 | (2) | 0,00 |
| Hang Seng China Enterprises Index July Futures | Short | 07.2022 | 17 | 15 | 0,01 |
| IBEX 35 Index July Futures | Short | 07.2022 | 3 | (1) | 0,00 |
| MSCI Singapore Index July Futures | Short | 07.2022 | 72 | 60 | 0,05 |
| Nikkei 225 Index September Futures | Short | 09.2022 | 6 | (1) | 0,00 |
| OMX Stockholm 30 Index July Futures | Short | 07.2022 | 44 | 19 | 0,02 |
| S&P CNX Nifty Index July Futures | Short | 07.2022 | 128 | 34 | 0,03 |
| S&P/Toronto Stock Exchange 60 September Futures | Short | 09.2022 | 5 | 47 | 0,04 |
| SPI 200 Index September Futures | Short | 09.2022 | 24 | 40 | 0,03 |
| Swiss Market September Futures | Short | 09.2022 | 29 | 13 | 0,01 |
| Topix Index September Futures | Short | 09.2022 | 13 | (32) | (0,03) |
| United Kingdom Long Gilt June Futures | Short | 09.2023 | 108 | (52) | (0,04) |
| Volatility S&P 500 Index July Futures | Short | 07.2022 | 12 | (13) | (0,01) |
| VSTOXX Mini July Futures | Short | 07.2022 | 29 | (12) | (0,01) |
| WIG20 Index September Futures | Short | 09.2022 | 367 | (9) | (0,01) |
| | | | | $ 337 | 0,27 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 337** | **0,27** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag(3) | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-37 5-Year Index | (1,000) % | 20.06.2027 | $ 14.500 | $ 371 | 0,30 |
| CDX.HY-38 5-Year Index | (5,000) | 20.06.2027 | 3.960 | 174 | 0,14 |
| iTraxx Crossover 37 5-Year Index | (5,000) | 20.06.2027 | € 3.400 | 192 | 0,16 |
| | | | | $ 737 | 0,60 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag(3) | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-35 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2026 | $ 100 | $ (9) | (0,01) |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt[4] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 % | 21.09.2032 | £ 5.800 | $ (25) | (0,02) |
| Erhalt | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 4,175 | 16.09.2025 | INR 33.800 | 19 | 0,02 |
| Zahlung | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 4,313 | 16.12.2025 | 200 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 4,710 | 17.03.2026 | 50.700 | 33 | 0,03 |
| Zahlung | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 5,250 | 15.09.2026 | 727.500 | 121 | 0,10 |
| Erhalt | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 5,260 | 15.09.2026 | 242.200 | (38) | (0,03) |
| Erhalt | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 5,400 | 17.03.2026 | 85.500 | 64 | 0,05 |
| Erhalt | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 5,400 | 16.06.2026 | 15.300 | 12 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 5,500 | 15.12.2026 | 1.400 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 5,500 | 16.03.2027 | 762.900 | (133) | (0,11) |
| Zahlung | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 5,750 | 16.03.2027 | 141.100 | (67) | (0,05) |
| Erhalt | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 6,000 | 15.06.2027 | 84.600 | (9) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 7,000 | 15.06.2027 | 113.900 | (14) | (0,01) |
| Erhalt[4] | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 7,000 | 21.09.2027 | 175.050 | (9) | (0,01) |
| Erhalt[4] | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,250 | 14.09.2032 | ¥ 1.460.000 | (18) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 0,750 | 15.09.2026 | SGD 10.000 | (76) | (0,06) |
| Erhalt | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 1,000 | 15.12.2026 | 26.990 | 224 | 0,18 |
| Zahlung | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 1,250 | 16.03.2027 | 12.400 | (93) | (0,07) |
| Erhalt | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 1,500 | 16.03.2027 | 2.800 | 23 | 0,02 |
| Erhalt | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 2,000 | 15.06.2027 | 4.600 | 15 | 0,01 |
| Erhalt[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,500 | 21.09.2052 | $ 1.200 | (36) | (0,03) |
| Erhalt[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,750 | 21.09.2027 | 2.200 | (51) | (0,04) |
| Erhalt[4] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,750 | 21.09.2032 | 800 | (22) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,338 | 02.01.2025 | BRL 14.100 | (142) | (0,12) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,580 | 02.01.2025 | 10.300 | (181) | (0,15) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,770 | 02.01.2025 | 3.300 | (62) | (0,05) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,840 | 02.01.2025 | 11.400 | (214) | (0,17) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 5,877 | 02.01.2025 | 3.000 | (56) | (0,05) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,620 | 02.01.2025 | 5.500 | 102 | 0,08 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,630 | 02.01.2025 | 4.900 | 91 | 0,07 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,840 | 02.01.2025 | 16.800 | 358 | 0,29 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 7,010 | 02.01.2025 | 7.900 | 162 | 0,13 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 7,328 | 02.01.2025 | 20.000 | 379 | 0,31 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 7,715 | 02.01.2025 | 7.800 | (143) | (0,12) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 7,733 | 02.01.2025 | 8.200 | 142 | 0,12 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 8,180 | 02.01.2025 | 14.600 | 239 | 0,19 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 8,550 | 02.01.2025 | 700 | (12) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 8,730 | 02.01.2025 | 21.700 | 306 | 0,25 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 8,985 | 02.01.2025 | 10.900 | 141 | 0,11 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 9,525 | 02.01.2025 | 13.300 | 143 | 0,12 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 9,630 | 02.01.2025 | 4.500 | 45 | 0,04 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 10,295 | 04.01.2027 | 6.000 | 12 | 0,01 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,445 | 04.01.2027 | 20.100 | (215) | (0,17) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,813 | 02.01.2025 | 10.500 | (60) | (0,05) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 11,043 | 04.01.2027 | 10.400 | 78 | 0,06 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,070 | 04.01.2027 | 8.900 | (66) | (0,05) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,180 | 04.01.2027 | 17.900 | (123) | (0,10) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 11,665 | 04.01.2027 | 9.100 | 40 | 0,03 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 11,945 | 04.01.2027 | 21.800 | 62 | 0,05 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,140 | 04.01.2027 | 6.000 | 12 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,195 | 04.01.2027 | 16.200 | 27 | 0,02 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,455 | 04.01.2027 | 7.900 | 3 | 0,00 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 12,718 | 04.01.2027 | 35.400 | (30) | (0,02) |
| Erhalt[4] | 3-Month CAD Bank Bill | 3,250 | 21.09.2032 | CAD 6.900 | (133) | (0,11) |
| Erhalt | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,268 | 16.09.2025 | CNY 3.000 | (6) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,295 | 16.09.2025 | 17.900 | (35) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,345 | 16.09.2025 | 6.000 | (11) | (0,01) |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,500 % | 15.09.2026 | CNY | 14.100 | $ 6 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,500 | 15.12.2026 | | 28.900 | (25) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,500 | 16.03.2027 | | 54.900 | 39 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,500 | 15.06.2027 | | 50.500 | (90) | (0,07) |
| Erhalt[4] | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,500 | 21.09.2027 | | 21.680 | 13 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,630 | 16.12.2025 | | 2.400 | 3 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,645 | 16.12.2025 | | 8.600 | 12 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,645 | 16.12.2025 | | 7.400 | (10) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,663 | 17.03.2026 | | 4.200 | 6 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,700 | 17.03.2026 | | 7.000 | 9 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,718 | 16.12.2025 | | 2.900 | (4) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,725 | 16.09.2025 | | 3.000 | (4) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,750 | 15.09.2026 | | 81.800 | (58) | (0,05) |
| Erhalt[4] | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,750 | 21.09.2027 | | 92.600 | (29) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,760 | 17.03.2026 | | 12.500 | (15) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,780 | 16.12.2025 | | 15.900 | (19) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,790 | 17.03.2026 | | 2.800 | 3 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,800 | 16.06.2026 | | 55.700 | 84 | 0,07 |
| Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,823 | 17.03.2026 | | 4.500 | 5 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,828 | 17.03.2026 | | 4.300 | (5) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,900 | 17.03.2026 | | 20.900 | (43) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,903 | 17.03.2026 | | 5.500 | (5) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 2,993 | 17.03.2026 | | 8.300 | (7) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 3,034 | 13.01.2026 | COP | 2.305.800 | (107) | (0,09) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 3,220 | 11.12.2025 | | 1.542.400 | 42 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 3,295 | 09.10.2025 | | 1.638.900 | (46) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 3,400 | 28.08.2025 | | 1.571.400 | 43 | 0,04 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 3,850 | 24.04.2025 | | 2.558.800 | (73) | (0,06) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 3,940 | 05.03.2026 | | 4.713.300 | 191 | 0,15 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,110 | 23.03.2026 | | 6.908.300 | 272 | 0,22 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,240 | 16.04.2026 | | 4.566.900 | 181 | 0,15 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,350 | 27.03.2025 | | 625.600 | 18 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,360 | 30.03.2025 | | 836.600 | 24 | 0,02 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,490 | 30.04.2026 | | 3.271.600 | (123) | (0,10) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,660 | 11.06.2026 | | 1.410.500 | 52 | 0,04 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,880 | 07.05.2026 | | 3.283.600 | (114) | (0,09) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,150 | 13.03.2025 | | 121.800 | 4 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,980 | 14.10.2026 | | 4.816.400 | (135) | (0,11) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 6,190 | 05.11.2026 | | 9.002.000 | 233 | 0,19 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 6,360 | 19.11.2026 | | 5.335.800 | (131) | (0,11) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 6,410 | 08.11.2026 | | 5.252.200 | 146 | 0,12 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 6,950 | 04.02.2027 | | 6.498.500 | 128 | 0,10 |
| Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,900 | 08.04.2027 | | 4.251.300 | (45) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,494 | 27.05.2027 | | 5.817.600 | 33 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,850 | 06.05.2027 | | 6.000.000 | 11 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 9,160 | 20.05.2027 | | 8.106.600 | (7) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month HKD-HIBOR | 0,500 | 17.03.2026 | HKD | 26.700 | (282) | (0,23) |
| Zahlung | 3-Month HKD-HIBOR | 0,508 | 17.03.2026 | | 4.700 | (54) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month HKD-HIBOR | 0,550 | 16.12.2025 | | 4.700 | 52 | 0,04 |
| Zahlung | 3-Month HKD-HIBOR | 0,560 | 17.03.2026 | | 3.200 | (37) | (0,03) |
| Zahlung | 3-Month HKD-HIBOR | 0,565 | 16.12.2025 | | 7.800 | (86) | (0,07) |
| Erhalt | 3-Month HKD-HIBOR | 0,568 | 17.03.2026 | | 6.300 | 73 | 0,06 |
| Zahlung | 3-Month HKD-HIBOR | 0,583 | 16.12.2025 | | 7.900 | (88) | (0,07) |
| Erhalt | 3-Month HKD-HIBOR | 0,607 | 17.03.2026 | | 9.400 | 110 | 0,09 |
| Erhalt | 3-Month HKD-HIBOR | 0,608 | 17.03.2026 | | 7.900 | 92 | 0,07 |
| Zahlung | 3-Month HKD-HIBOR | 0,618 | 16.09.2025 | | 7.800 | (82) | (0,07) |
| Erhalt | 3-Month HKD-HIBOR | 0,670 | 17.03.2026 | | 12.600 | 140 | 0,11 |
| Zahlung | 3-Month HKD-HIBOR | 0,680 | 16.12.2025 | | 3.200 | (36) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month HKD-HIBOR | 0,698 | 16.12.2025 | | 3.100 | 35 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month HKD-HIBOR | 0,700 | 16.09.2025 | | 11.100 | 119 | 0,10 |
| Erhalt | 3-Month HKD-HIBOR | 0,750 | 15.09.2026 | | 39.600 | 25 | 0,02 |
| Zahlung | 3-Month HKD-HIBOR | 0,790 | 16.09.2025 | | 4.700 | (51) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month HKD-HIBOR | 0,867 | 17.03.2026 | | 31.700 | 323 | 0,26 |
| Zahlung | 3-Month HKD-HIBOR | 0,883 | 15.09.2026 | | 7.800 | (89) | (0,07) |
| Erhalt | 3-Month HKD-HIBOR | 1,000 | 17.03.2026 | | 11.100 | 110 | 0,09 |
| Zahlung | 3-Month HKD-HIBOR | 1,000 | 16.06.2026 | | 43.400 | (477) | (0,38) |
| Erhalt | 3-Month HKD-HIBOR | 1,085 | 16.09.2025 | | 11.200 | 128 | 0,10 |
| Erhalt | 3-Month HKD-HIBOR | 1,100 | 16.06.2026 | | 12.700 | 119 | 0,10 |
| Erhalt | 3-Month HKD-HIBOR | 1,120 | 17.06.2025 | | 3.200 | 35 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month HKD-HIBOR | 1,250 | 15.12.2026 | | 48.800 | 38 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month HKD-HIBOR | 1,340 | 18.03.2025 | | 8.000 | (86) | (0,07) |
| Zahlung | 3-Month HKD-HIBOR | 1,500 | 16.03.2027 | | 48.910 | (321) | (0,26) |
| Zahlung | 3-Month HKD-HIBOR | 1,600 | 17.06.2025 | | 5.900 | (70) | (0,06) |
| Zahlung | 3-Month HKD-HIBOR | 1,715 | 18.03.2025 | | 10.800 | (123) | (0,10) |
| Erhalt | 3-Month HKD-HIBOR | 1,750 | 16.03.2027 | | 9.800 | 81 | 0,07 |
| Erhalt | 3-Month HKD-HIBOR | 2,000 | 16.03.2027 | | 11.500 | 81 | 0,07 |
| Zahlung | 3-Month HKD-HIBOR | 2,750 | 16.03.2027 | | 18.400 | (46) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month HKD-HIBOR | 3,000 | 15.06.2027 | | 3.900 | 2 | 0,00 |
| Erhalt[4] | 3-Month HKD-HIBOR | 3,500 | 21.09.2027 | | 15.740 | (15) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,520 | 26.07.2026 | ILS | 24.300 | (541) | (0,44) |
| Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,601 | 05.07.2026 | | 2.800 | 62 | 0,05 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,628 % | 25.06.2026 | ILS | 5.600 | $ (123) | (0,10) |
| Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,692 | 13.09.2026 | | 48.400 | 1.009 | 0,82 |
| Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,728 | 04.06.2026 | | 4.100 | (89) | (0,07) |
| Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,730 | 21.05.2026 | | 3.500 | 72 | 0,06 |
| Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,750 | 10.12.2026 | | 34.100 | (750) | (0,61) |
| Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,900 | 07.10.2026 | | 9.000 | (166) | (0,13) |
| Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,905 | 25.11.2026 | | 8.100 | (172) | (0,14) |
| Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,965 | 14.01.2027 | | 10.600 | 209 | 0,17 |
| Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 1,040 | 28.10.2026 | | 10.400 | (187) | (0,15) |
| Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 1,049 | 12.11.2026 | | 12.000 | 206 | 0,17 |
| Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 1,105 | 21.01.2027 | | 16.900 | 302 | 0,24 |
| Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 1,178 | 04.02.2027 | | 13.800 | 236 | 0,19 |
| Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 2,183 | 06.05.2027 | | 7.500 | 36 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 2,390 | 27.05.2027 | | 11.400 | 35 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 2,825 | 10.06.2027 | | 10.900 | 24 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 3,210 | 17.06.2027 | | 1.900 | (3) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 0,830 | 16.09.2025 | KRW | 950.500 | (37) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month KRW-KORIBOR | 0,888 | 16.12.2025 | | 509.100 | 21 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month KRW-KORIBOR | 0,910 | 16.09.2025 | | 737.100 | 29 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month KRW-KORIBOR | 0,994 | 16.12.2025 | | 450.000 | 19 | 0,02 |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,000 | 16.12.2025 | | 907.600 | (39) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,120 | 17.03.2026 | | 4.208.600 | 200 | 0,16 |
| Erhalt | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,400 | 17.03.2026 | | 5.001.700 | 258 | 0,21 |
| Erhalt | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,500 | 16.06.2026 | | 3.925.900 | 217 | 0,18 |
| Erhalt | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,500 | 15.09.2026 | | 9.830.000 | 102 | 0,08 |
| Erhalt | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,625 | 15.09.2026 | | 900.700 | 9 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,750 | 16.03.2027 | | 6.778.400 | 215 | 0,17 |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 2,000 | 15.12.2026 | | 6.833.600 | (74) | (0,06) |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 2,500 | 16.03.2027 | | 3.811.300 | (147) | (0,12) |
| Erhalt | 3-Month KRW-KORIBOR | 2,500 | 15.06.2027 | | 123.300 | 2 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 2,750 | 15.06.2027 | | 4.069.700 | (110) | (0,09) |
| Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 3,000 | 15.06.2027 | | 2.600.000 | (41) | (0,03) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 4,900 | 12.11.2025 | ZAR | 3.400 | (18) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 4,938 | 18.09.2025 | | 7.000 | 39 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 5,120 | 02.09.2025 | | 500 | 3 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 5,330 | 13.05.2025 | | 8.300 | (47) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 5,375 | 27.05.2025 | | 7.800 | (45) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 5,601 | 09.06.2026 | | 31.050 | (149) | (0,12) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 5,680 | 08.06.2026 | | 41.150 | (197) | (0,16) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 5,739 | 28.07.2026 | | 72.100 | (330) | (0,27) |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 5,780 | 03.03.2026 | | 36.600 | 147 | 0,12 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 5,860 | 23.06.2026 | | 75.600 | 327 | 0,26 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 5,950 | 17.03.2026 | | 1.200 | 4 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 5,980 | 22.09.2026 | | 43.900 | 194 | 0,16 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 6,023 | 01.07.2026 | | 28.100 | 102 | 0,08 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 6,200 | 22.04.2025 | | 7.800 | (50) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 6,231 | 29.09.2026 | | 55.400 | 216 | 0,18 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 6,300 | 23.12.2026 | | 30.900 | (125) | (0,10) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 6,320 | 23.04.2025 | | 5.600 | (36) | (0,03) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 6,400 | 30.12.2026 | | 33.600 | (129) | (0,10) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 6,540 | 04.01.2027 | | 37.100 | (117) | (0,09) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 6,540 | 23.02.2027 | | 64.600 | (232) | (0,19) |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 6,670 | 12.01.2027 | | 73.700 | 216 | 0,17 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 6,690 | 04.11.2026 | | 2.000 | 6 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 6,835 | 28.08.2024 | | 100 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 6,855 | 03.11.2026 | | 22.830 | (54) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,049 | 09.03.2027 | | 70.000 | 171 | 0,14 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,489 | 18.05.2027 | | 42.900 | 59 | 0,05 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,600 | 19.06.2024 | | 7.100 | 49 | 0,04 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,750 | 20.03.2024 | | 9.180 | (61) | (0,05) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,800 | 19.12.2023 | | 3.100 | (19) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,130 | 31.07.2025 | CLP | 332.000 | (37) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,190 | 14.08.2025 | | 6.000 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,310 | 23.10.2025 | | 4.700 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,750 | 12.02.2026 | | 901.600 | 182 | 0,15 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 1,915 | 09.03.2025 | | 325.300 | (44) | (0,04) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,280 | 14.02.2025 | | 317.700 | (46) | (0,04) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,290 | 09.03.2026 | | 1.057.700 | 193 | 0,16 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 2,525 | 22.03.2026 | | 755.000 | 114 | 0,09 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,170 | 21.06.2026 | | 791.600 | 112 | 0,09 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,245 | 19.07.2026 | | 1.399.300 | 222 | 0,18 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,570 | 09.07.2026 | | 1.279.600 | (181) | (0,15) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,728 | 20.08.2026 | | 2.239.800 | 306 | 0,25 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,220 | 19.11.2026 | | 2.363.300 | (167) | (0,13) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,420 | 28.10.2026 | | 1.284.200 | 85 | 0,07 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,620 | 22.10.2026 | | 1.673.000 | 95 | 0,08 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 5,975 | 18.01.2027 | | 1.912.300 | 78 | 0,06 |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,207 | 31.05.2027 | | 1.836.600 | (49) | (0,04) |
| Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,230 | 27.05.2027 | | 1.675.600 | (43) | (0,03) |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 6,885 | 13.05.2027 | | 1.642.400 | (5) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,161 | 17.06.2027 | | 2.386.300 | (38) | (0,03) |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | 7,174 % | 17.06.2027 | CLP | 1.432.400 | $ (23) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 0,421 | 15.05.2025 | CZK | 900 | (5) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 0,590 | 26.03.2025 | | 10.900 | (60) | (0,05) |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 0,637 | 24.07.2025 | | 7.700 | (47) | (0,04) |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 0,665 | 22.09.2025 | | 5.100 | (30) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 0,690 | 04.05.2025 | | 4.100 | (23) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 0,710 | 30.03.2025 | | 100 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 0,776 | 20.08.2025 | | 7.900 | (48) | (0,04) |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,100 | 31.12.2025 | | 57.000 | 358 | 0,29 |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,124 | 13.03.2025 | | 12.000 | (72) | (0,06) |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,570 | 09.03.2026 | | 59.800 | 365 | 0,30 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,580 | 19.03.2026 | | 51.600 | 297 | 0,24 |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,715 | 23.07.2026 | | 100.200 | (601) | (0,49) |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,775 | 04.06.2026 | | 57.900 | (342) | (0,28) |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,934 | 02.07.2026 | | 95.200 | 540 | 0,44 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,972 | 07.07.2026 | | 55.500 | 321 | 0,26 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 2,015 | 10.08.2026 | | 132.200 | 684 | 0,55 |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 3,770 | 11.02.2027 | | 72.000 | (224) | (0,18) |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 4,300 | 18.03.2027 | | 80.900 | 166 | 0,13 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 5,185 | 24.05.2027 | | 64.000 | 31 | 0,03 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 5,285 | 20.05.2027 | | 83.300 | 25 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 5,640 | 10.06.2027 | | 3.400 | (1) | 0,00 |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | € | 4.000 | (23) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month HUF-BBR | 1,085 | 14.08.2025 | HUF | 186.300 | 103 | 0,08 |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 1,115 | 08.01.2026 | | 1.131.600 | (706) | (0,57) |
| Erhalt | 6-Month HUF-BBR | 1,220 | 15.01.2026 | | 559.700 | 352 | 0,28 |
| Erhalt | 6-Month HUF-BBR | 1,230 | 15.01.2026 | | 872.700 | 550 | 0,44 |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 1,920 | 16.04.2026 | | 426.000 | (257) | (0,21) |
| Erhalt | 6-Month HUF-BBR | 1,958 | 19.03.2026 | | 1.746.000 | 1.025 | 0,83 |
| Erhalt | 6-Month HUF-BBR | 1,980 | 09.03.2026 | | 646.300 | 380 | 0,31 |
| Erhalt | 6-Month HUF-BBR | 2,499 | 05.07.2026 | | 78.800 | 42 | 0,03 |
| Erhalt | 6-Month HUF-BBR | 2,558 | 06.08.2026 | | 1.156.900 | 603 | 0,49 |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 5,060 | 18.02.2027 | | 885.100 | (297) | (0,24) |
| Erhalt | 6-Month HUF-BBR | 5,500 | 04.03.2027 | | 627.800 | 183 | 0,15 |
| Erhalt | 6-Month HUF-BBR | 6,100 | 11.03.2027 | | 498.000 | 120 | 0,10 |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 7,480 | 03.06.2027 | | 700.700 | 18 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month HUF-BBR | 7,640 | 13.05.2027 | | 721.400 | 59 | 0,05 |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 0,481 | 11.08.2025 | PLN | 3.400 | (142) | (0,11) |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 0,560 | 17.04.2025 | | 1.900 | (75) | (0,06) |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 0,580 | 11.01.2026 | | 8.500 | (390) | (0,32) |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 0,585 | 22.09.2025 | | 6.000 | (256) | (0,21) |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 0,635 | 08.05.2025 | | 1.100 | (45) | (0,04) |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 0,730 | 05.02.2026 | | 6.500 | 299 | 0,24 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 0,890 | 12.02.2026 | | 20.900 | 941 | 0,76 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 1,188 | 19.03.2026 | | 17.800 | 743 | 0,60 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 1,229 | 09.03.2026 | | 7.000 | 299 | 0,24 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 1,405 | 10.08.2026 | | 27.100 | 1.118 | 0,90 |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 1,450 | 05.07.2026 | | 5.300 | (226) | (0,18) |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 1,465 | 07.06.2026 | | 2.400 | 102 | 0,08 |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 2,185 | 08.10.2026 | | 8.300 | (305) | (0,25) |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 2,983 | 08.11.2026 | | 20.100 | 594 | 0,48 |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 3,525 | 24.12.2026 | | 3.300 | (82) | (0,07) |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 3,600 | 27.12.2026 | | 3.300 | (80) | (0,06) |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 3,739 | 03.01.2027 | | 1.000 | (26) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 3,934 | 04.03.2027 | | 19.200 | (342) | (0,28) |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 4,219 | 04.02.2027 | | 10.200 | 232 | 0,19 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 4,830 | 18.03.2027 | | 2.000 | 35 | 0,03 |
| Erhalt | 6-Month PLN-WIBOR | 5,179 | 01.04.2027 | | 7.900 | 114 | 0,09 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 4,775 | 26.06.2025 | MXN | 4.900 | 30 | 0,02 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 4,800 | 05.02.2026 | | 65.500 | 381 | 0,31 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,080 | 09.10.2025 | | 14.500 | (98) | (0,08) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,095 | 30.10.2025 | | 23.500 | (159) | (0,13) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,120 | 06.05.2025 | | 15.800 | (100) | (0,08) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,443 | 17.04.2025 | | 5.700 | (37) | (0,03) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 5,550 | 12.03.2026 | | 32.800 | 185 | 0,15 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,050 | 04.06.2026 | | 22.600 | (114) | (0,09) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,095 | 20.03.2026 | | 51.800 | 251 | 0,20 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,210 | 28.03.2025 | | 4.300 | (30) | (0,02) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,230 | 07.04.2025 | | 16.700 | (118) | (0,10) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,255 | 21.05.2026 | | 23.500 | 109 | 0,09 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,460 | 18.06.2026 | | 43.000 | 178 | 0,14 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,625 | 11.09.2026 | | 21.100 | 89 | 0,07 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,635 | 11.09.2026 | | 21.100 | 89 | 0,07 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,740 | 17.09.2026 | | 28.500 | 115 | 0,09 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,109 | 03.12.2026 | | 102.300 | (356) | (0,29) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,113 | 24.09.2026 | | 134.600 | 457 | 0,37 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,264 | 17.12.2026 | | 30.000 | 97 | 0,08 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,273 | 12.11.2026 | | 33.880 | (108) | (0,09) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,353 | 05.11.2026 | | 58.150 | 175 | 0,14 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,370 | 14.10.2026 | | 24.200 | (72) | (0,06) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,383 | 28.01.2027 | | 29.500 | 90 | 0,07 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,460 % | 04.02.2027 | MXN | 44.800 | $ (131) | (0,11) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,530 | 14.01.2027 | | 24.100 | 66 | 0,05 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,590 | 29.10.2026 | | 40.000 | 103 | 0,08 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,673 | 31.12.2026 | | 23.900 | 59 | 0,05 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,745 | 11.02.2027 | | 53.100 | (126) | (0,10) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,400 | 21.05.2027 | | 47.400 | (55) | (0,04) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,402 | 20.05.2027 | | 34.800 | (40) | (0,03) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,498 | 11.03.2027 | | 25.400 | (24) | (0,02) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,785 | 06.05.2027 | | 24.900 | 9 | 0,01 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 9,020 | 03.06.2027 | | 91.300 | (18) | (0,01) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 9,070 | 24.06.2027 | | 13.500 | (2) | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 9,114 | 24.06.2027 | | 11.700 | (3) | 0,00 |
| | | | | | | $ 9.203 | 7,44 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | | **$ 9.931** | **8,03** |

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

(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**

**ZINSSWAPS**

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,230 % | 02.12.2025 | ILS | 2.100 | $ 0 | $ (47) | $ (47) | (0,04) |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,250 | 20.08.2025 | | 2.100 | 3 | 39 | 42 | 0,03 |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,265 | 29.05.2025 | | 3.700 | 0 | (71) | (71) | (0,06) |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,270 | 04.11.2025 | | 2.900 | 0 | (62) | (62) | (0,05) |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,305 | 15.05.2025 | | 2.900 | 0 | (53) | (53) | (0,04) |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,330 | 14.02.2025 | | 2.900 | 0 | (48) | (48) | (0,04) |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,335 | 29.11.2024 | | 2.200 | 0 | (33) | (33) | (0,03) |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,361 | 03.02.2026 | | 2.800 | 0 | (62) | (62) | (0,05) |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,403 | 31.01.2025 | | 2.900 | 0 | (45) | (45) | (0,04) |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,405 | 30.10.2024 | | 1.500 | 0 | 21 | 21 | 0,02 |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,666 | 06.04.2026 | | 6.400 | 0 | 129 | 129 | 0,10 |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,684 | 10.03.2026 | | 7.800 | 0 | 151 | 151 | 0,12 |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,712 | 19.03.2026 | | 19.700 | 0 | 378 | 378 | 0,31 |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 1,345 | 23.11.2023 | | 5.900 | 0 | (14) | (14) | (0,01) |
| | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 2,153 | 17.03.2026 | MYR | 2.700 | 0 | (35) | (35) | (0,03) |
| | Erhalt | 3-Month MYR-KLIBOR | 2,367 | 17.03.2026 | | 5.700 | 0 | 64 | 64 | 0,05 |
| | Erhalt | 3-Month MYR-KLIBOR | 2,500 | 15.09.2026 | | 21.600 | 22 | 233 | 255 | 0,21 |
| | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 2,700 | 16.06.2026 | | 7.800 | 10 | (82) | (72) | (0,06) |
| | Erhalt | 3-Month MYR-KLIBOR | 2,750 | 15.12.2026 | | 14.000 | 13 | 130 | 143 | 0,12 |
| | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 2,750 | 15.12.2026 | | 10.700 | (8) | (102) | (110) | (0,09) |
| | Erhalt | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,000 | 16.03.2027 | | 17.600 | 78 | 70 | 148 | 0,12 |
| | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,000 | 16.03.2027 | | 8.200 | (10) | (59) | (69) | (0,06) |
| | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,500 | 15.06.2027 | | 20.900 | (14) | (61) | (75) | (0,06) |
| | Erhalt | 6-Month THB-THBFIX | 1,250 | 16.03.2027 | THB | 88.800 | 43 | 116 | 159 | 0,13 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,750 | 15.06.2027 | | 61.200 | (1) | (76) | (77) | (0,06) |
| BPS | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,200 | 06.03.2025 | ILS | 2.900 | 0 | 52 | 52 | 0,04 |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,285 | 19.05.2025 | | 1.500 | 0 | (28) | (28) | (0,02) |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,375 | 13.03.2025 | | 1.500 | 0 | (25) | (25) | (0,02) |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,410 | 18.10.2024 | | 2.200 | 0 | 30 | 30 | 0,02 |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,710 | 25.03.2025 | | 3.300 | 0 | 47 | 47 | 0,04 |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 1,480 | 30.11.2023 | | 6.000 | 0 | 11 | 11 | 0,01 |
| | Erhalt | 3-Month MYR-KLIBOR | 2,646 | 17.03.2026 | MYR | 8.800 | 0 | 78 | 78 | 0,06 |
| CBK | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,257 | 11.12.2025 | ILS | 1.300 | 0 | 29 | 29 | 0,02 |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,293 | 18.05.2025 | | 3.000 | 0 | (56) | (56) | (0,04) |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,406 | 01.11.2024 | | 1.500 | 0 | (21) | (21) | (0,02) |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,413 | 08.11.2024 | | 2.200 | 0 | 30 | 30 | 0,03 |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,573 | 20.04.2026 | | 4.800 | 0 | (103) | (103) | (0,08) |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 1,202 | 19.09.2023 | | 10.400 | 0 | (18) | (18) | (0,01) |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 1,373 | 07.09.2023 | | 11.032 | 0 | 4 | 4 | 0,00 |

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 1,987 | 16.12.2025 | MYR | 1.800 | $ 0 | $ (24) | $ (24) | (0,02) |
| | Erhalt | 6-Month THB-THBFIX | 0,750 | 15.09.2026 | THB | 105.800 | 19 | 211 | 230 | 0,19 |
| | Erhalt | 6-Month THB-THBFIX | 1,000 | 15.12.2026 | | 124.400 | 23 | 226 | 249 | 0,20 |
| | Erhalt | 6-Month THB-THBFIX | 1,190 | 16.06.2026 | | 56.600 | 0 | 85 | 85 | 0,07 |
| | Erhalt | 6-Month THB-THBFIX | 1,500 | 16.03.2027 | | 36.040 | (3) | 55 | 52 | 0,04 |
| CKL | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 1,060 | 15.02.2024 | ILS | 3.100 | 9 | 9 | 18 | 0,02 |
| GLM | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,220 | 23.10.2025 | | 2.900 | 0 | (63) | (63) | (0,05) |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,233 | 02.12.2025 | | 2.400 | 0 | 53 | 53 | 0,04 |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,250 | 20.08.2025 | | 2.200 | 1 | 43 | 44 | 0,04 |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,320 | 15.01.2026 | | 1.900 | 0 | 42 | 42 | 0,03 |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,370 | 28.08.2025 | | 1.400 | 0 | 27 | 27 | 0,02 |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,393 | 02.01.2025 | | 2.800 | 0 | 43 | 43 | 0,04 |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,586 | 23.04.2026 | | 10.400 | 0 | (221) | (221) | (0,18) |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,635 | 27.03.2025 | | 4.200 | 0 | 62 | 62 | 0,05 |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,650 | 26.03.2025 | | 3.300 | 0 | 48 | 48 | 0,04 |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,967 | 19.06.2024 | | 3.000 | 0 | (27) | (27) | (0,02) |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 1,026 | 19.02.2024 | | 2.300 | 0 | 14 | 14 | 0,01 |
| | Erhalt | 3-Month MYR-KLIBOR | 2,840 | 16.06.2026 | MYR | 3.500 | (5) | 33 | 28 | 0,02 |
| | Erhalt | 3-Month MYR-KLIBOR | 4,000 | 15.06.2027 | | 10.000 | (8) | (10) | (18) | (0,01) |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 0,750 | 15.09.2026 | THB | 186.100 | (7) | (397) | (404) | (0,33) |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,000 | 15.09.2026 | | 98.700 | 14 | (198) | (184) | (0,15) |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,000 | 15.12.2026 | | 68.200 | (5) | (132) | (137) | (0,11) |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,130 | 16.06.2026 | | 28.400 | 6 | (51) | (45) | (0,04) |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,250 | 16.03.2027 | | 68.200 | 6 | (128) | (122) | (0,10) |
| | Erhalt | 6-Month THB-THBFIX | 1,500 | 16.03.2027 | | 174.820 | (36) | 290 | 254 | 0,21 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,750 | 15.06.2027 | | 84.100 | (52) | (54) | (106) | (0,09) |
| | Erhalt | 6-Month THB-THBFIX | 2,000 | 15.06.2027 | | 67.700 | (8) | 71 | 63 | 0,05 |
| HUS | Zahlung | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 5,195 | 18.03.2025 | INR | 82.600 | 0 | (37) | (37) | (0,03) |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 0,350 | 18.09.2024 | ILS | 1.400 | 0 | (19) | (19) | (0,01) |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,390 | 05.02.2026 | | 10.500 | 0 | 230 | 230 | 0,19 |
| | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 1,035 | 25.03.2024 | | 3.900 | 1 | 26 | 27 | 0,02 |
| JPM | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 1,030 | 19.06.2024 | | 2.900 | 0 | (25) | (25) | (0,02) |
| | Zahlung | 3-Month ILS-TELBOR | 1,280 | 11.01.2024 | | 17.620 | 0 | (71) | (71) | (0,06) |
| MBC | Erhalt | 6-Month THB-THBFIX | 1,500 | 16.03.2027 | THB | 36.060 | (3) | 55 | 52 | 0,04 |
| MYC | Erhalt | 3-Month ILS-TELBOR | 0,266 | 16.11.2025 | ILS | 1.400 | 0 | 30 | 30 | 0,02 |
| | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 1,975 | 16.12.2025 | MYR | 1.800 | 0 | (24) | (24) | (0,02) |
| | Erhalt | 3-Month MYR-KLIBOR | 4,000 | 15.06.2027 | | 6.000 | (6) | (5) | (11) | (0,01) |
| | Erhalt | 6-Month THB-THBFIX | 1,000 | 15.12.2026 | THB | 259.890 | 77 | 443 | 520 | 0,42 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,130 | 16.06.2026 | | 75.500 | 23 | (142) | (119) | (0,10) |
| | Erhalt | 6-Month THB-THBFIX | 1,250 | 15.12.2026 | | 116.500 | 1 | 197 | 198 | 0,16 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,250 | 16.03.2027 | | 237.600 | (15) | (412) | (427) | (0,34) |
| | Erhalt | 6-Month THB-THBFIX | 1,750 | 15.06.2027 | | 21.900 | 11 | 17 | 28 | 0,02 |
| SCX | Erhalt | 3-Month MYR-KLIBOR | 2,033 | 16.12.2025 | MYR | 3.500 | 0 | 45 | 45 | 0,04 |
| | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 2,212 | 17.03.2026 | | 2.600 | 0 | (32) | (32) | (0,03) |
| | Erhalt | 3-Month MYR-KLIBOR | 2,363 | 17.03.2026 | | 3.000 | 0 | 34 | 34 | 0,03 |
| | | | | | | | $ 179 | $ 828 | $ 1.007 | 0,81 |

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | | Nenn-betrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MEI | Zahlung | BOVESPA Index | 200 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | BRL | 20.827 | 17.08.2022 | $ 0 | $ 166 | $ 166 | 0,13 |
| | Zahlung | KOSPI2 Index | 10.000.000 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | KRW | 3.487.023 | 08.09.2022 | 0 | 318 | 318 | 0,26 |
| | Zahlung | SET50 Index | 15.000 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | THB | 14.276 | 29.09.2022 | 0 | 5 | 5 | 0,00 |
| | | | | | | | | $ 0 | $ 489 | $ 489 | 0,39 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 09.2022 | CAD | 28 | $ | 22 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 48 | CAD | 62 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 147 | € | 139 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | AUD | 2.200 | $ | 1.649 | 138 | 0 | 138 | 0,11 |
| | 07.2022 | £ | 1.081 | | 1.367 | 54 | 0 | 54 | 0,04 |
| | 07.2022 | PEN | 144 | | 38 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | MXN | 13.694 | | 675 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 3.465 | MXN | 75.556 | 258 | 0 | 258 | 0,21 |
| | 08.2022 | | 170 | PEN | 654 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 09.2022 | AUD | 291 | $ | 201 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09.2022 | CHF | 146 | | 153 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | CLP | 886 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | CNH | 26.378 | | 3.900 | 0 | (32) | (32) | (0,03) |
| | 09.2022 | € | 446 | | 473 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 09.2022 | HUF | 231.530 | $ | 598 | $ 0 | $ (5) | $ (5) | 0,00 |
| | 09.2022 | INR | 180.818 | | 2.305 | 32 | 0 | 32 | 0,03 |
| | 09.2022 | ¥ | 2.133.100 | | 15.952 | 173 | 0 | 173 | 0,14 |
| | 09.2022 | NOK | 20.200 | | 2.043 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 09.2022 | NZD | 900 | | 561 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 09.2022 | SEK | 12.000 | | 1.174 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | SGD | 2.645 | | 1.900 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | TRY | 1.424 | | 74 | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| | 09.2022 | $ | 41 | CAD | 52 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 48 | CHF | 47 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 02.2023 | PEN | 654 | $ | 167 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 03.2023 | ILS | 347 | | 102 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | MXN | 3.001 | | 144 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.539 | € | 1.463 | 0 | (9) | (9) | (0,01) |
| | 08.2022 | COP | 3.316.201 | $ | 804 | 14 | 0 | 14 | 0,01 |
| | 08.2022 | € | 1.463 | | 1.542 | 9 | 0 | 9 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ | 1.057 | MXN | 23.220 | 87 | 0 | 87 | 0,07 |
| | 09.2022 | BRL | 11.052 | $ | 2.100 | 30 | 0 | 30 | 0,02 |
| | 09.2022 | CHF | 750 | | 759 | 0 | (28) | (28) | (0,02) |
| | 09.2022 | CNH | 44.037 | | 6.561 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 09.2022 | COP | 6.585.528 | | 1.600 | 37 | 0 | 37 | 0,03 |
| | 09.2022 | CZK | 24.218 | | 1.035 | 21 | 0 | 21 | 0,02 |
| | 09.2022 | £ | 40 | | 49 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | HKD | 678 | | 87 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | HUF | 573.013 | | 1.554 | 62 | 0 | 62 | 0,05 |
| | 09.2022 | IDR | 99.971.723 | | 6.796 | 129 | 0 | 129 | 0,10 |
| | 09.2022 | ILS | 17.110 | | 5.141 | 232 | 0 | 232 | 0,19 |
| | 09.2022 | INR | 94.537 | | 1.200 | 12 | 0 | 12 | 0,01 |
| | 09.2022 | ¥ | 112.500 | | 841 | 9 | 0 | 9 | 0,01 |
| | 09.2022 | MXN | 159.675 | | 7.600 | 0 | (210) | (210) | (0,17) |
| | 09.2022 | $ | 362 | AUD | 520 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 1.300 | BRL | 6.427 | 0 | (96) | (96) | (0,08) |
| | 09.2022 | | 7.655 | CAD | 9.700 | 0 | (134) | (134) | (0,11) |
| | 09.2022 | | 1.405 | CLP | 1.180.768 | 0 | (163) | (163) | (0,13) |
| | 09.2022 | | 700 | HUF | 270.780 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 3.500 | IDR | 50.858.154 | 0 | (108) | (108) | (0,09) |
| | 09.2022 | | 27 | ILS | 92 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 438 | KRW | 546.069 | 0 | (17) | (17) | (0,01) |
| | 09.2022 | | 3.009 | MXN | 61.057 | 10 | (33) | (23) | (0,02) |
| | 09.2022 | | 279 | PLN | 1.254 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 6 | SEK | 65 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 2.500 | SGD | 3.438 | 0 | (29) | (29) | (0,02) |
| | 09.2022 | | 1.300 | THB | 45.625 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 225 | TRY | 4.441 | 25 | 0 | 25 | 0,02 |
| | 09.2022 | | 2.100 | ZAR | 32.451 | 0 | (134) | (134) | (0,11) |
| BRC | 09.2022 | CAD | 101 | $ | 78 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | € | 176 | | 184 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | £ | 258 | | 318 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 38 | £ | 31 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 8 | HUF | 2.971 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 13 | ILS | 46 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | BRL | 14.226 | $ | 2.920 | 200 | 0 | 200 | 0,16 |
| | 07.2022 | $ | 1.584 | BRL | 7.810 | 0 | (90) | (90) | (0,07) |
| | 07.2022 | | 46 | MXN | 913 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | ILS | 4.465 | $ | 1.390 | 113 | 0 | 113 | 0,09 |
| | 08.2022 | MXN | 1.885 | | 93 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | PEN | 654 | | 168 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 341 | BRL | 1.772 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 09.2022 | CLP | 684.060 | $ | 752 | 32 | 0 | 32 | 0,03 |
| | 09.2022 | HKD | 384 | | 49 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | INR | 141 | | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | MXN | 19.940 | | 967 | 0 | (10) | (10) | (0,01) |
| | 09.2022 | PHP | 80.243 | | 1.500 | 49 | 0 | 49 | 0,04 |
| | 09.2022 | $ | 175 | CLP | 146.996 | 0 | (20) | (20) | (0,02) |
| | 09.2022 | | 1.700 | COP | 6.555.951 | 0 | (144) | (144) | (0,12) |
| | 09.2022 | | 63 | HUF | 24.172 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11.2022 | | 1.106 | PEN | 4.390 | 35 | 0 | 35 | 0,03 |
| | 12.2022 | PEN | 6.225 | $ | 1.484 | 0 | (130) | (130) | (0,11) |
| DUB | 07.2022 | $ | 36 | MXN | 712 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 18 | | 357 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | NOK | 6.000 | $ | 609 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 74 | CAD | 95 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 25 | CHF | 24 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 6 | SEK | 60 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| FBF | 09.2022 | | 3 | € | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | | 1.291 | BRL | 6.416 | 0 | (64) | (64) | (0,05) |
| | 07.2022 | | 131 | MXN | 2.656 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 355 | CLP | 307.454 | 0 | (30) | (30) | (0,02) |
| | 08.2022 | | 3.249 | PEN | 12.192 | 0 | (53) | (53) | (0,04) |
| | 09.2022 | CAD | 4.600 | $ | 3.551 | 0 | (16) | (16) | (0,01) |
| | 09.2022 | CLP | 2.052.276 | | 2.299 | 140 | 0 | 140 | 0,11 |
| | 09.2022 | CZK | 10.001 | | 422 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 09.2022 | € | 1.500 | $ | 1.575 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | HUF | 107.842 | | 281 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | MXN | 4.115 | | 203 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 09.2022 | MYR | 5.308 | | 1.200 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 09.2022 | RON | 7.415 | | 1.582 | 32 | 0 | 32 | 0,03 |
| | 09.2022 | $ | 260 | CLP | 218.998 | 0 | (30) | (30) | (0,02) |
| | 09.2022 | | 157 | CZK | 3.738 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 28 | HKD | 220 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 224 | HUF | 85.813 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 69 | ILS | 229 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 937 | ¥ | 125.000 | 0 | (13) | (13) | (0,01) |
| | 09.2022 | | 120 | PLN | 527 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 2 | THB | 59 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| IND | 08.2022 | | 108 | CLP | 94.384 | 0 | (8) | (8) | (0,01) |
| | 09.2022 | | 32 | £ | 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 7 | ZAR | 110 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | MXN | 2.672 | $ | 131 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 34 | MXN | 677 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | SGD | 4 | $ | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | AUD | 2.819 | | 1.943 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 09.2022 | CHF | 423 | | 446 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09.2022 | £ | 1.000 | | 1.219 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 09.2022 | IDR | 11.109.440 | | 745 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 09.2022 | ILS | 4.142 | | 1.200 | 12 | 0 | 12 | 0,01 |
| | 09.2022 | KRW | 4.484.091 | | 3.570 | 109 | 0 | 109 | 0,09 |
| | 09.2022 | THB | 207.800 | | 6.017 | 120 | 0 | 120 | 0,10 |
| | 09.2022 | TRY | 2.071 | | 104 | 0 | (13) | (13) | (0,01) |
| | 09.2022 | TWD | 56.092 | | 1.900 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 9.483 | CHF | 9.054 | 23 | 0 | 23 | 0,02 |
| | 09.2022 | | 2.800 | CNH | 18.846 | 9 | 0 | 9 | 0,01 |
| | 09.2022 | | 24 | CZK | 568 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 121 | € | 114 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 111 | £ | 91 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 15 | HKD | 114 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 1.300 | ILS | 4.469 | 0 | (18) | (18) | (0,01) |
| | 09.2022 | | 541 | INR | 42.579 | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| | 09.2022 | | 3 | KRW | 3.176 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 900 | MXN | 17.938 | 0 | (23) | (23) | (0,02) |
| | 09.2022 | | 73 | PLN | 333 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 127 | SGD | 176 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 12.2022 | ILS | 300 | $ | 97 | 11 | 0 | 11 | 0,01 |
| MBC | 07.2022 | CAD | 299 | | 237 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 182 | MXN | 3.732 | 4 | (1) | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD | 3.081 | $ | 2.184 | 65 | 0 | 65 | 0,05 |
| | 08.2022 | CLP | 1.544.846 | | 1.844 | 206 | 0 | 206 | 0,17 |
| | 09.2022 | CHF | 10.804 | | 10.945 | 0 | (399) | (399) | (0,32) |
| | 09.2022 | CLP | 483.117 | | 548 | 40 | 0 | 40 | 0,03 |
| | 09.2022 | ILS | 3.420 | | 1.000 | 19 | 0 | 19 | 0,01 |
| | 09.2022 | INR | 124.283 | | 1.577 | 15 | 0 | 15 | 0,01 |
| | 09.2022 | NZD | 9.801 | | 6.107 | 19 | 0 | 19 | 0,01 |
| | 09.2022 | PHP | 39.169 | | 733 | 24 | 0 | 24 | 0,02 |
| | 09.2022 | PLN | 799 | | 179 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 09.2022 | SGD | 4.884 | | 3.548 | 38 | 0 | 38 | 0,03 |
| | 09.2022 | $ | 5.746 | CAD | 7.200 | 0 | (163) | (163) | (0,13) |
| | 09.2022 | | 83 | CHF | 79 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 640 | CLP | 536.384 | 0 | (76) | (76) | (0,06) |
| | 09.2022 | | 234 | HKD | 1.831 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 127 | HUF | 49.165 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 33 | ILS | 110 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 26 | ¥ | 3.400 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 662 | KRW | 824.005 | 0 | (26) | (26) | (0,02) |
| | 09.2022 | | 27 | PLN | 123 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 1.300 | RON | 6.076 | 0 | (30) | (30) | (0,02) |
| | 09.2022 | | 20 | SEK | 200 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 105 | SGD | 145 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 3 | TRY | 55 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 2.400 | TWD | 69.491 | 0 | (51) | (51) | (0,04) |
| | 09.2022 | | 150 | ZAR | 2.396 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | € | 403 | $ | 423 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | CLP | 803.677 | | 918 | 68 | 0 | 68 | 0,05 |
| | 09.2022 | CAD | 11.601 | | 8.975 | 0 | (19) | (19) | (0,02) |
| | 09.2022 | € | 2.108 | | 2.208 | 0 | (7) | (7) | (0,01) |
| | 09.2022 | HUF | 194.129 | | 500 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 09.2022 | MYR | 10.211 | | 2.318 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 09.2022 | SEK | 1.115 | | 111 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 09.2022 | THB | 33.062 | | 947 | 9 | 0 | 9 | 0,01 |
| | 09.2022 | TWD | 162.600 | | 5.552 | 56 | 0 | 56 | 0,05 |
| | 09.2022 | $ | 3 | CHF | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 1.200 | COP | 4.597.200 | 0 | (110) | (110) | (0,09) |
| | 09.2022 | | 267 | CZK | 6.410 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 570 | € | 539 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 157 | £ | 129 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu erhaltende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Wertzunahme (Wertabnahme) | % des Nettovermögen |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 09.2022 | | 45 | ILS | 154 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 759 | INR | 59.749 | 0 | (8) | (8) | (0,01) |
| | 09.2022 | | 6 | ¥ | 800 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 86 | PLN | 379 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 20 | ZAR | 319 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| RBC | 08.2022 | AUD | 4.559 | $ | 3.241 | 105 | 0 | 105 | 0,08 |
| | 09.2022 | | 287 | | 198 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | CAD | 199 | | 154 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | ¥ | 38.200 | | 285 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 09.2022 | KRW | 1.161.990 | | 900 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 09.2022 | MXN | 9.526 | | 463 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 09.2022 | PLN | 1.136 | | 252 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 39 | AUD | 54 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 404 | CHF | 385 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 76 | £ | 62 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 37 | HKD | 287 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 98 | HUF | 37.620 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 12 | ¥ | 1.600 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 4 | TWD | 121 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | ZAR | 42.568 | $ | 2.757 | 177 | 0 | 177 | 0,14 |
| | 10.2022 | $ | 1.404 | MXN | 28.135 | 0 | (34) | (34) | (0,03) |
| RYL | 09.2022 | | 14 | € | 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 29 | HKD | 225 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 7 | SEK | 65 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 09.2022 | COP | 2.667.859 | $ | 664 | 32 | 0 | 32 | 0,03 |
| | 09.2022 | TRY | 3.637 | | 196 | 0 | (9) | (9) | (0,01) |
| | 09.2022 | $ | 90 | CAD | 116 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 12 | £ | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | € | 1.463 | $ | 1.572 | 43 | 0 | 43 | 0,03 |
| | 09.2022 | $ | 85 | SEK | 865 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 101 | SGD | 140 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 09.2022 | £ | 11.038 | $ | 13.344 | 0 | (79) | (79) | (0,06) |
| | 09.2022 | ILS | 37 | | 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | PLN | 216 | | 50 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 09.2022 | SEK | 29.735 | | 2.944 | 33 | 0 | 33 | 0,03 |
| | 09.2022 | $ | 17 | CHF | 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 75 | £ | 60 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 68 | HKD | 534 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 224 | HUF | 85.397 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 83 | ILS | 282 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 73 | PLN | 326 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | | 47 | ZAR | 770 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09.2022 | ZAR | 1.301 | $ | 81 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| UAG | 09.2022 | CZK | 2.571 | | 108 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | HKD | 356 | | 45 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | ILS | 154 | | 45 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09.2022 | INR | 127.876 | | 1.623 | 16 | 0 | 16 | 0,01 |
| | 09.2022 | $ | 400 | BRL | 2.091 | 0 | (8) | (8) | (0,01) |
| | 09.2022 | | 1.920 | CLP | 1.617.595 | 0 | (218) | (218) | (0,18) |
| | 09.2022 | | 181 | CZK | 4.324 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 24 | ILS | 83 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 1.630 | MXN | 32.510 | 0 | (38) | (38) | (0,03) |
| | 09.2022 | | 749 | RUB | 55.686 | 130 | 0 | 130 | 0,11 |
| | 09.2022 | | 10 | SGD | 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09.2022 | | 57 | ZAR | 922 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 10.2022 | | 33 | MXN | 671 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 3.391 | $ (3.049) | $ 342 | 0,28 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu erhaltende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Wertzunahme (Wertabnahme) | % des Netto-vermögen |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | $ | 1.518 | € | 1.432 | $ 0 | $ (21) | $ (21) | (0,02) |
| BPS | 07.2022 | € | 8.443 | $ | 8.894 | 66 | 0 | 66 | 0,05 |
| | 07.2022 | $ | 3.361 | € | 3.176 | 0 | (41) | (41) | (0,03) |
| | 08.2022 | | 8.254 | | 7.833 | 0 | (50) | (50) | (0,04) |
| CBK | 07.2022 | | 194 | | 182 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | € | 8.171 | $ | 8.598 | 56 | 0 | 56 | 0,05 |
| | 07.2022 | $ | 7.038 | € | 6.533 | 1 | (208) | (207) | (0,17) |
| | 08.2022 | | 8.255 | | 7.833 | 0 | (51) | (51) | (0,04) |
| SOG | 07.2022 | | 6.828 | | 6.353 | 0 | (187) | (187) | (0,15) |
| UAG | 07.2022 | $ | 5.930 | € | 5.518 | $ 0 | $ (161) | $ (161) | (0,13) |
| | | | | | | $ 123 | $ (723) | $ (600) | (0,48) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **$ 1.238** | **1,00** |
| **Summe Anlagen** | | | | | | | | **$ 123.269** | **99,66** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | | | | | | | **$ 423** | **0,34** |
| **Nettovermögen** | | | | | | | | **$ 123.692** | **100,00** |

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

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

**(a) Nullkuponwertpapier.**

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

**(c) Mit dem Fonds verbunden.**

**(d) Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeits-datum | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Deutsche Bank AG | 0,898 % | 28.05.2024 | 31.03.2022 | $ 959 | $ 938 | 0,76 |

**Barmittel in Höhe von USD 7.948 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 1.841 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 79.760 | $ 0 | $ 79.760 |
| Investmentfonds | 10.209 | 2.019 | 0 | 12.228 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 19.775 | 0 | 19.775 |
| Finanzderivate[3] | 387 | 11.119 | 0 | 11.506 |
| **Summen** | **$ 10.596** | **$ 112.673** | **$ 0** | **$ 123.269** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 87.130 | $ 0 | $ 87.130 |
| Investmentfonds | 4.572 | 0 | 0 | 4.572 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 800 | 0 | 800 |
| Finanzderivate[3] | 315 | 4.571 | 0 | 4.886 |
| **Summen** | **$ 4.887** | **$ 92.501** | **$ 0** | **$ 97.388** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ (1) | $ 0 | $ (1) |
| BOA | 1.210 | (1.140) | 70 |
| BPS | (159) | 260 | 101 |
| BRC | 2 | 0 | 2 |
| CBK | 478 | (630) | (152) |
| CKL | 18 | 0 | 18 |
| GLM | (690) | 701 | 11 |
| HUS | 201 | 0 | 201 |
| IND | (8) | 0 | (8) |
| JPM | 140 | 0 | 140 |
| MBC | (463) | 590 | 127 |
| MEI | 489 | (310) | 179 |
| MYC | 195 | 0 | 195 |
| MYI | (18) | 0 | (18) |
| RBC | 248 | 0 | 248 |
| SCX | 70 | (280) | (210) |
| SOG | (145) | 0 | (145) |
| TOR | (50) | 0 | (50) |
| UAG | (279) | 290 | 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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 39,31 | 14,64 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 24,29 | 70,97 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 0,88 | k. A. |
| Investmentfonds | 9,89 | 4,49 |
| Pensionsgeschäfte | 15,99 | 0,79 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,27 | 0,30 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 8,03 | 4,69 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 1,00 | (0,20) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 43,05 | 10,28 |
| Kommunalanleihen und Wechsel | 0,80 | 0,49 |
| US-Regierungsbehörden | 0,91 | 2,50 |
| Non-Agency-MBS | 1,79 | 1,97 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 1,39 | 2,47 |
| Staatsemissionen | 2,71 | 0,49 |
| Kurzfristige Instrumente | 13,83 | 67,41 |
| Investmentfonds | 9,89 | 4,49 |
| Pensionsgeschäfte | 15,99 | 0,79 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,27 | 0,30 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | 0,60 | (0,05) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | (0,01) | 0,01 |
| Zinsswaps | 7,44 | 4,73 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Devisenoptionen | k. A. | 0,00 |
| Zinsswaps | 0,81 | 0,13 |
| Total Return Swaps auf Indizes | 0,39 | 0,09 |
| Devisenterminkontrakte | 0,28 | (0,55) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (0,48) | 0,13 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 0,34 | 4,32 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **ÖSTERREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Erste Group Bank AG** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.04.2024 (d)(f) | € | 200 | £ 168 | 0,03 |
| **BELGIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Anheuser-Busch InBev S.A.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 25.05.2037 | £ | 3.000 | 2.480 | 0,49 |
| **Sofina S.A.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 23.09.2028 | € | 1.300 | 881 | 0,18 |
| Summe Belgien | | | 3.361 | 0,67 |
| **KANADA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Canadian Imperial Bank of Commerce** | | | | |
| 2,169 % fällig am 15.12.2025 | £ | 1.700 | 1.728 | 0,34 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Trafford Centre Finance Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 28.04.2029 | | 500 | 471 | 0,10 |
| 8,280 % fällig am 28.10.2022 | | 11 | 11 | 0,00 |
| Summe Cayman Inseln | | | 482 | 0,10 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Orsted A/S** | | | | |
| 2,500 % fällig am 16.05.2033 | | 1.100 | 968 | 0,19 |
| **TDC Net A/S** | | | | |
| 5,056 % fällig am 31.05.2028 | € | 1.000 | 807 | 0,16 |
| Summe Dänemark | | | 1.775 | 0,35 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Air France-KLM** | | | | |
| 1,875 % fällig am 16.01.2025 | | 600 | 436 | 0,09 |
| **AXA S.A.** | | | | |
| 5,453 % fällig am 04.03.2026 (d) | £ | 850 | 847 | 0,17 |
| 5,625 % fällig am 16.01.2054 | | 1.000 | 950 | 0,19 |
| **Banque Federative du Credit Mutuel S.A.** | | | | |
| 0,875 % fällig am 07.12.2027 | | 1.000 | 860 | 0,17 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 13.07.2031 | | 500 | 382 | 0,08 |
| 2,000 % fällig am 13.09.2036 | | 800 | 572 | 0,11 |
| 2,875 % fällig am 24.02.2029 | | 2.000 | 1.829 | 0,36 |
| 4,625 % fällig am 12.01.2027 (d)(f) | $ | 300 | 205 | 0,04 |
| 4,625 % fällig am 25.02.2031 (d)(f) | | 900 | 549 | 0,11 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 23.06.2026 (d)(f) | £ | 750 | 731 | 0,14 |
| **Electricite de France S.A.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 22.09.2050 | | 1.050 | 1.060 | 0,21 |
| 5,500 % fällig am 27.03.2037 | | 2.000 | 2.106 | 0,42 |
| 5,500 % fällig am 17.10.2041 | | 2.900 | 3.038 | 0,60 |
| 6,125 % fällig am 02.06.2034 | | 650 | 727 | 0,14 |
| **JCDecaux S.A.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 07.02.2030 | € | 300 | 212 | 0,04 |
| **LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE** | | | | |
| 1,125 % fällig am 11.02.2027 | £ | 1.400 | 1.290 | 0,26 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 04.10.2023 (d)(f) | $ | 200 | 159 | 0,03 |
| 7,875 % fällig am 18.12.2023 (d)(f) | | 400 | 324 | 0,06 |
| Summe Frankreich | | | 16.277 | 3,22 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Deutsche Bahn Finance GmbH** | | | | |
| 1,875 % fällig am 13.02.2026 | £ | 700 | 679 | 0,13 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 1,375 % fällig am 17.02.2032 | € | 900 | 592 | 0,12 |
| 1,875 % fällig am 22.12.2028 | £ | 4.800 | 4.031 | 0,80 |
| 3,547 % fällig am 18.09.2031 | $ | 800 | 552 | 0,11 |
| **DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH** | | | | |
| 2,500 % fällig am 25.01.2027 | € | 900 | £ 643 | 0,13 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.09.2026 (a) | | 200 | 143 | 0,03 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** | | | | |
| 0,875 % fällig am 15.09.2026 | £ | 1.200 | 1.127 | 0,22 |
| 1,125 % fällig am 04.07.2025 | | 900 | 867 | 0,17 |
| 5,750 % fällig am 07.06.2032 | | 500 | 635 | 0,12 |
| **Schaeffler AG** | | | | |
| 2,750 % fällig am 12.10.2025 | € | 500 | 396 | 0,08 |
| | | | 9.665 | 1,91 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **State of Saxony-Anhalt** | | | | |
| 2,125 % fällig am 16.12.2024 | £ | 800 | 790 | 0,16 |
| Summe Deutschland | | | 10.455 | 2,07 |
| **INDIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ReNew Power Pvt Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 05.03.2027 | $ | 300 | 226 | 0,05 |
| **IRLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Toro European CLO DAC** | | | | |
| 0,920 % fällig am 12.01.2032 | € | 3.600 | 3.010 | 0,59 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bank of Ireland Group PLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 19.09.2027 | £ | 225 | 224 | 0,05 |
| **GE Capital UK Funding Unlimited Co.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 18.01.2033 | | 2.700 | 2.995 | 0,59 |
| **Perrigo Finance Unlimited Co.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 15.06.2030 | $ | 200 | 147 | 0,03 |
| | | | 3.366 | 0,67 |
| Summe Irland | | | 6.376 | 1,26 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aeroporti di Roma SpA** | | | | |
| 1,750 % fällig am 30.07.2031 | € | 200 | 132 | 0,03 |
| 5,441 % fällig am 20.02.2023 | £ | 550 | 556 | 0,11 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 5,148 % fällig am 10.06.2030 | | 800 | 694 | 0,14 |
| **Nexi SpA** | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.04.2026 | € | 500 | 352 | 0,07 |
| 2,125 % fällig am 30.04.2029 | | 600 | 362 | 0,07 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | $ | 2.400 | 2.047 | 0,40 |
| Summe Italien | | | 4.143 | 0,82 |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **East Japan Railway Co.** | | | | |
| 1,162 % fällig am 15.09.2028 | £ | 1.500 | 1.328 | 0,26 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.07.2043 | | 900 | 882 | 0,17 |
| 3,250 % fällig am 31.07.2050 | | 1.000 | 842 | 0,17 |
| 4,875 % fällig am 31.07.2043 | | 4.330 | 4.309 | 0,85 |
| **Gatwick Funding Ltd.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.04.2032 | | 600 | 525 | 0,10 |
| **Heathrow Funding Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 13.10.2031 | | 1.000 | 911 | 0,18 |
| 2,750 % fällig am 09.08.2051 | | 1.400 | 974 | 0,19 |
| 4,625 % fällig am 31.10.2046 | | 1.100 | 1.063 | 0,21 |
| 5,875 % fällig am 13.05.2043 | | 400 | 450 | 0,09 |
| 6,450 % fällig am 10.12.2031 | | 500 | 581 | 0,12 |
| 6,750 % fällig am 03.12.2028 | | 400 | 445 | 0,09 |
| **HSBC Bank Capital Funding Sterling LP** | | | | |
| 5,844 % fällig am 05.11.2031 (d) | | 1.400 | 1.607 | 0,32 |
| Summe Jersey, Kanalinseln | | | 12.589 | 2,49 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 16.10.2029 | £ | 3.000 | £ 2.531 | 0,50 |
| 3,625 % fällig am 10.04.2031 | | 800 | 676 | 0,13 |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | $ | 200 | 153 | 0,03 |
| **Bevco Lux SARL** | | | | |
| 1,000 % fällig am 16.01.2030 | € | 1.300 | 885 | 0,18 |
| **CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund** | | | | |
| 0,900 % fällig am 12.10.2029 | | 700 | 478 | 0,09 |
| **CK Hutchison Group Telecom Finance S.A.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 17.10.2027 | £ | 1.200 | 1.058 | 0,21 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 27.01.2031 | € | 500 | 286 | 0,06 |
| 1,750 % fällig am 14.01.2030 | | 200 | 122 | 0,02 |
| 2,750 % fällig am 22.01.2028 | £ | 3.500 | 2.706 | 0,54 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.01.2030 | | 1.800 | 1.552 | 0,31 |
| **NE Property BV** | | | | |
| 3,375 % fällig am 14.07.2027 | € | 800 | 594 | 0,12 |
| **Prologis International Funding S.A.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 22.02.2032 | £ | 900 | 798 | 0,16 |
| 3,125 % fällig am 01.06.2031 | € | 700 | 567 | 0,11 |
| Summe Luxemburg | | | 12.406 | 2,46 |
| **MAURITIUS** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Greenko Dutch BV** | | | | |
| 3,850 % fällig am 29.03.2026 | $ | 291 | 204 | 0,04 |
| **Greenko Power Ltd.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 13.12.2028 | | 293 | 193 | 0,04 |
| **Greenko Solar Mauritius Ltd.** | | | | |
| 5,550 % fällig am 29.01.2025 | | 300 | 232 | 0,05 |
| 5,950 % fällig am 29.07.2026 | | 350 | 258 | 0,05 |
| Summe Mauritius | | | 887 | 0,18 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | |
| 4,375 % fällig am 22.09.2025 (d)(f) | € | 1.000 | 765 | 0,15 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 1,250 % fällig am 14.01.2025 | £ | 300 | 282 | 0,05 |
| 1,875 % fällig am 12.07.2028 | | 1.100 | 998 | 0,20 |
| 3,100 % fällig am 29.06.2028 (d)(f) | € | 400 | 260 | 0,05 |
| 4,375 % fällig am 29.06.2027 (d)(f) | | 1.000 | 759 | 0,15 |
| 4,625 % fällig am 23.05.2029 | £ | 1.800 | 1.740 | 0,34 |
| 5,250 % fällig am 14.09.2027 | | 850 | 858 | 0,17 |
| **CTP NV** | | | | |
| 0,875 % fällig am 20.01.2026 | € | 1.600 | 1.154 | 0,23 |
| 1,250 % fällig am 21.06.2029 | | 800 | 481 | 0,09 |
| **E.ON International Finance BV** | | | | |
| 4,750 % fällig am 31.01.2034 | £ | 2.000 | 2.062 | 0,41 |
| 5,875 % fällig am 30.10.2037 | | 1.600 | 1.815 | 0,36 |
| 6,125 % fällig am 06.07.2039 | | 700 | 814 | 0,16 |
| 6,250 % fällig am 03.06.2030 | | 250 | 289 | 0,06 |
| **Enel Finance International NV** | | | | |
| 2,875 % fällig am 11.04.2029 | | 1.300 | 1.197 | 0,24 |
| 5,000 % fällig am 15.06.2032 | $ | 1.000 | 796 | 0,16 |
| 5,750 % fällig am 14.09.2040 | £ | 2.700 | 2.985 | 0,59 |
| **Holcim Sterling Finance Netherlands BV** | | | | |
| 2,250 % fällig am 04.04.2034 | | 1.300 | 1.004 | 0,20 |
| **IMCD NV** | | | | |
| 2,500 % fällig am 26.03.2025 | € | 500 | 402 | 0,08 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 1,125 % fällig am 07.12.2028 | £ | 1.500 | 1.257 | 0,25 |
| **JAB Holdings BV** | | | | |
| 2,250 % fällig am 19.12.2039 | € | 800 | 450 | 0,09 |
| **JDE Peet's NV** | | | | |
| 0,500 % fällig am 16.01.2029 | | 800 | 548 | 0,11 |
| **NN Group NV** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2026 (d) | | 400 | 333 | 0,07 |
| **Sagax Euro MTN NL BV** | | | | |
| 0,750 % fällig am 26.01.2028 | | 600 | 398 | 0,08 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Universal Music Group NV** | | | | |
| 3,750 % fällig am 30.06.2032 | € | 200 | £ 171 | 0,03 |
| **Volkswagen Financial Services NV** | | | | |
| 2,125 % fällig am 18.01.2028 | £ | 2.300 | 2.040 | 0,40 |
| **Volkswagen International Finance NV** | | | | |
| 3,500 % fällig am 17.06.2025 (d) | € | 700 | 547 | 0,11 |
| | | | 24.405 | 4,83 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Nederlandse Waterschapsbank NV** | | | | |
| 5,375 % fällig am 07.06.2032 | £ | 1.000 | 1.231 | 0,25 |
| Summe Niederlande | | | 25.636 | 5,08 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **DNB Bank ASA** | | | | |
| 2,625 % fällig am 10.06.2026 | | 1.000 | 971 | 0,19 |
| **Equinor ASA** | | | | |
| 4,250 % fällig am 10.04.2041 | | 1.100 | 1.119 | 0,22 |
| Summe Norwegen | | | 2.090 | 0,41 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Temasek Financial Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 26.07.2040 | | 970 | 1.160 | 0,23 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Abertis Infraestructuras S.A.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 27.11.2026 | | 1.000 | 946 | 0,19 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (d)(f) | € | 400 | 332 | 0,06 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 14.04.2026 | £ | 2.400 | 2.161 | 0,43 |
| 4,375 % fällig am 14.01.2026 (d)(f) | € | 600 | 436 | 0,09 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 03.12.2026 | £ | 1.600 | 1.442 | 0,28 |
| 3,500 % fällig am 06.04.2028 | | 900 | 848 | 0,17 |
| 3,625 % fällig am 14.09.2028 (d)(f) | € | 200 | 119 | 0,02 |
| 5,875 % fällig am 09.10.2027 (d)(f) | | 400 | 304 | 0,06 |
| Summe Spanien | | | 6.588 | 1,30 |
| **SUPRANATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.11.2024 | £ | 2.300 | 2.216 | 0,44 |
| 3,750 % fällig am 07.12.2027 | | 1.750 | 1.859 | 0,37 |
| 4,500 % fällig am 07.06.2029 | | 1.300 | 1.463 | 0,29 |
| 5,625 % fällig am 07.06.2032 | | 1.400 | 1.761 | 0,35 |
| 6,000 % fällig am 07.12.2028 | | 1.100 | 1.334 | 0,26 |
| **Europäische Union** | | | | |
| 0,400 % fällig am 04.02.2037 | € | 100 | 66 | 0,01 |
| **Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung** | | | | |
| 1,250 % fällig am 13.12.2028 | £ | 1.500 | 1.398 | 0,28 |
| 5,750 % fällig am 07.06.2032 | | 3.200 | 4.052 | 0,80 |
| **International Development Association** | | | | |
| 0,750 % fällig am 21.09.2028 | | 1.500 | 1.352 | 0,27 |
| 1,750 % fällig am 05.05.2037 | € | 1.000 | 789 | 0,16 |
| **International Finance Corp.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 22.07.2027 | £ | 2.000 | 1.841 | 0,36 |
| Summe Supranational | | | 18.131 | 3,59 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **EQT AB** | | | | |
| 0,875 % fällig am 14.05.2031 | € | 700 | 441 | 0,09 |
| 2,875 % fällig am 06.04.2032 | | 800 | 582 | 0,11 |
| **Investor AB** | | | | |
| 5,500 % fällig am 05.05.2037 | £ | 1.100 | 1.312 | 0,26 |
| Summe Schweden | | | 2.335 | 0,46 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.11.2029 | £ | 4.300 | £ 3.564 | 0,71 |
| 2,250 % fällig am 09.06.2028 | | 1.500 | 1.311 | 0,26 |
| 2,875 % fällig am 02.04.2032 | € | 1.100 | 798 | 0,16 |
| 3,091 % fällig am 14.05.2032 | $ | 250 | 164 | 0,03 |
| 4,194 % fällig am 01.04.2031 | | 500 | 365 | 0,07 |
| 6,250 % fällig am 18.12.2024 (d)(f) | | 400 | 301 | 0,06 |
| **UBS AG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (f) | | 1.600 | 1.317 | 0,26 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (f) | | 250 | 206 | 0,04 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 4,375 % fällig am 10.02.2031 (d)(f) | | 500 | 302 | 0,06 |
| 5,125 % fällig am 29.07.2026 (d)(f) | | 600 | 444 | 0,09 |
| Summe Schweiz | | | 8.772 | 1,74 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **3i Group PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 05.06.2040 | £ | 1.250 | 1.060 | 0,21 |
| **ABP Finance PLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 14.12.2026 | | 100 | 111 | 0,02 |
| **Annington Funding PLC** | | | | |
| 2,308 % fällig am 06.10.2032 | | 1.300 | 1.049 | 0,21 |
| 2,646 % fällig am 12.07.2025 | | 1.000 | 956 | 0,19 |
| 3,935 % fällig am 12.07.2047 | | 900 | 743 | 0,15 |
| **Arqiva Financing PLC** | | | | |
| 5,340 % fällig am 30.12.2037 | | 800 | 871 | 0,17 |
| **Assura Financing PLC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.06.2033 | | 1.000 | 775 | 0,15 |
| **Aviva PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 03.06.2055 | | 800 | 647 | 0,13 |
| 5,125 % fällig am 04.06.2050 | | 200 | 190 | 0,04 |
| 6,875 % fällig am 20.05.2058 | | 900 | 985 | 0,20 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (f) | $ | 520 | 432 | 0,09 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 1,700 % fällig am 03.11.2026 | £ | 800 | 729 | 0,14 |
| 3,250 % fällig am 12.02.2027 | | 950 | 892 | 0,18 |
| 3,250 % fällig am 17.01.2033 | | 800 | 683 | 0,14 |
| 4,972 % fällig am 16.05.2029 | $ | 400 | 324 | 0,06 |
| 6,375 % fällig am 15.12.2025 (d)(f) | £ | 200 | 185 | 0,04 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (d)(f) | | 600 | 591 | 0,12 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (d)(f) | $ | 1.000 | 811 | 0,16 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2022 (d)(f) | £ | 700 | 699 | 0,14 |
| 8,875 % fällig am 15.09.2027 (d)(f) | | 400 | 398 | 0,08 |
| **Berkeley Group PLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 11.08.2031 | | 1.700 | 1.255 | 0,25 |
| **Beyond Housing Ltd.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 17.05.2051 | | 500 | 345 | 0,07 |
| **Blend Funding PLC** | | | | |
| 3,459 % fällig am 21.09.2049 | | 800 | 725 | 0,14 |
| **BPHA Finance PLC** | | | | |
| 4,816 % fällig am 11.04.2044 | | 300 | 337 | 0,07 |
| **British Land Co. PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 14.09.2029 | | 2.300 | 2.066 | 0,41 |
| **British Telecommunications PLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 21.11.2031 | | 800 | 721 | 0,14 |
| **Cadent Finance PLC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 22.09.2038 | | 1.450 | 1.123 | 0,22 |
| 2,750 % fällig am 22.09.2046 | | 700 | 502 | 0,10 |
| **Chanel Ceres PLC** | | | | |
| 0,500 % fällig am 31.07.2026 | € | 1.400 | 1.105 | 0,22 |
| **Clarion Funding PLC** | | | | |
| 1,875 % fällig am 22.01.2035 | £ | 1.500 | 1.196 | 0,24 |
| 1,875 % fällig am 07.09.2051 | | 1.400 | 875 | 0,17 |
| 3,125 % fällig am 19.04.2048 | | 300 | 255 | 0,05 |
| **Derwent London PLC** | | | | |
| 1,875 % fällig am 17.11.2031 | | 2.800 | 2.277 | 0,45 |
| **Direct Line Insurance Group PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 05.06.2032 | | 800 | 693 | 0,14 |
| **EMH Treasury PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 29.01.2044 | | 300 | 321 | 0,06 |
| **Ferguson Finance PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 02.06.2030 | $ | 400 | 286 | 0,06 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **GlaxoSmithKline Capital PLC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 12.05.2035 | £ | 2.100 | £ 1.658 | 0,33 |
| 4,250 % fällig am 18.12.2045 | | 500 | 526 | 0,10 |
| **Grainger PLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 03.07.2030 | | 1.085 | 913 | 0,18 |
| 3,375 % fällig am 24.04.2028 | | 1.650 | 1.489 | 0,30 |
| **Greene King Finance PLC** | | | | |
| 3,593 % fällig am 15.03.2035 | | 377 | 354 | 0,07 |
| 4,064 % fällig am 15.03.2035 | | 217 | 206 | 0,04 |
| 5,106 % fällig am 15.03.2034 | | 571 | 582 | 0,12 |
| 5,318 % fällig am 15.09.2031 | | 1.461 | 1.512 | 0,30 |
| **GSK Consumer Healthcare Capital UK PLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 29.10.2028 | | 1.000 | 962 | 0,19 |
| 3,375 % fällig am 29.03.2038 | | 800 | 722 | 0,14 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 1,750 % fällig am 24.07.2027 | | 1.400 | 1.258 | 0,25 |
| 2,625 % fällig am 16.08.2028 | | 1.400 | 1.272 | 0,25 |
| 2,871 % fällig am 22.11.2032 | $ | 1.300 | 877 | 0,17 |
| 3,000 % fällig am 22.07.2028 | £ | 2.350 | 2.189 | 0,43 |
| 3,000 % fällig am 29.05.2030 | | 2.200 | 1.973 | 0,39 |
| 4,000 % fällig am 09.03.2026 (d)(f) | $ | 200 | 138 | 0,03 |
| 4,600 % fällig am 17.12.2030 (d)(f) | | 500 | 318 | 0,06 |
| 5,250 % fällig am 16.09.2022 (d)(f) | € | 800 | 680 | 0,13 |
| 5,875 % fällig am 28.09.2026 (d)(f) | £ | 900 | 820 | 0,16 |
| 6,000 % fällig am 29.09.2023 (d)(f) | € | 200 | 171 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 22.05.2027 (d)(f) | $ | 600 | 444 | 0,09 |
| 6,000 % fällig am 29.03.2040 | £ | 978 | 932 | 0,18 |
| **Hyde Housing Association Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 23.07.2040 | | 800 | 911 | 0,18 |
| **Informa PLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 05.07.2026 | | 645 | 621 | 0,12 |
| **InterContinental Hotels Group PLC** | | | | |
| 2,125 % fällig am 24.08.2026 | | 1.500 | 1.363 | 0,27 |
| **John Lewis PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 18.12.2034 | | 1.894 | 1.441 | 0,29 |
| 6,125 % fällig am 21.01.2025 | | 650 | 672 | 0,13 |
| **Karbon Homes Ltd.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.11.2047 | | 400 | 370 | 0,07 |
| **Land Securities Capital Markets PLC** | | | | |
| 2,399 % fällig am 08.02.2031 | | 1.251 | 1.192 | 0,24 |
| **LCR Finance PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 07.12.2038 | | 1.400 | 1.682 | 0,33 |
| **Legal & General Group PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.11.2050 | | 800 | 721 | 0,14 |
| 5,375 % fällig am 27.10.2045 | | 1.200 | 1.206 | 0,24 |
| 5,500 % fällig am 27.06.2064 | | 250 | 225 | 0,04 |
| 5,625 % fällig am 24.03.2031 (d)(f) | | 850 | 720 | 0,14 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 3,574 % fällig am 07.11.2028 | $ | 800 | 617 | 0,12 |
| 4,947 % fällig am 27.06.2025 (d)(f) | € | 400 | 324 | 0,06 |
| **London & Quadrant Housing Trust** | | | | |
| 2,000 % fällig am 31.03.2032 | £ | 3.200 | 2.777 | 0,55 |
| 2,000 % fällig am 20.10.2038 | | 2.800 | 2.127 | 0,42 |
| **London Power Networks PLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 31.03.2023 | | 150 | 152 | 0,03 |
| **Manchester Airport Group Funding PLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 31.03.2039 | | 235 | 187 | 0,04 |
| 2,875 % fällig am 30.09.2044 | | 900 | 676 | 0,13 |
| 4,750 % fällig am 31.03.2034 | | 400 | 411 | 0,08 |
| **Marks & Spencer PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 19.05.2026 | | 500 | 440 | 0,09 |
| 6,000 % fällig am 12.06.2025 | | 816 | 797 | 0,16 |
| **Metropolitan Housing Trust Ltd.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 28.07.2036 | | 3.700 | 2.880 | 0,57 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | |
| 2,279 % fällig am 15.12.2030 | $ | 1.305 | 994 | 0,20 |
| 5,965 % fällig am 15.12.2025 | £ | 117 | 118 | 0,02 |
| 6,013 % fällig am 15.12.2030 | | 445 | 454 | 0,09 |
| **Morhomes PLC** | | | | |
| 3,400 % fällig am 19.02.2040 | | 2.000 | 1.811 | 0,36 |
| **Motability Operations Group PLC** | | | | |
| 2,125 % fällig am 18.01.2042 | | 3.300 | 2.543 | 0,50 |
| 3,625 % fällig am 10.03.2036 | | 1.500 | 1.488 | 0,30 |
| 5,625 % fällig am 29.11.2030 | | 100 | 117 | 0,02 |
| **National Grid Electricity Transmission PLC** | | | | |
| 1,125 % fällig am 07.07.2028 | | 1.400 | 1.213 | 0,24 |
| **National Grid Gas PLC** | | | | |
| 1,375 % fällig am 07.02.2031 | | 800 | 641 | 0,13 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **NatWest Group PLC** | | | | | |
| 2,057 % fällig am 09.11.2028 | £ | 2.500 | £ | 2.188 | 0,43 |
| 2,875 % fällig am 19.09.2026 | | 500 | | 475 | 0,09 |
| 3,125 % fällig am 28.03.2027 | | 500 | | 473 | 0,09 |
| 3,619 % fällig am 29.03.2029 | | 600 | | 563 | 0,11 |
| 5,076 % fällig am 27.01.2030 | $ | 400 | | 323 | 0,06 |
| 5,125 % fällig am 12.05.2027 (d)(f) | £ | 2.600 | | 2.205 | 0,44 |
| **Network Rail Infrastructure Finance PLC** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 29.11.2035 | | 2.800 | | 3.353 | 0,66 |
| **Northern Gas Networks Finance PLC** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 23.03.2040 | | 50 | | 55 | 0,01 |
| **Northern Powergrid Yorkshire PLC** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 05.07.2032 | | 300 | | 314 | 0,06 |
| 5,125 % fällig am 04.05.2035 | | 200 | | 220 | 0,04 |
| **Notting Hill Genesis** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 03.06.2036 | | 1.200 | | 950 | 0,19 |
| 2,875 % fällig am 31.01.2029 | | 900 | | 868 | 0,17 |
| 3,250 % fällig am 12.10.2048 | | 1.000 | | 857 | 0,17 |
| 3,750 % fällig am 20.12.2032 | | 600 | | 605 | 0,12 |
| **Pacific Quay Finance PLC** | | | | | |
| 5,565 % fällig am 25.07.2034 | | 161 | | 183 | 0,04 |
| **Paragon Treasury PLC** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 07.05.2036 | | 500 | | 399 | 0,08 |
| **Peabody Capital PLC** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 14.09.2048 | | 900 | | 773 | 0,15 |
| **Pearson Funding PLC** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 04.06.2030 | | 500 | | 475 | 0,09 |
| **Places for People Homes Ltd.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 22.11.2028 | | 1.300 | | 1.309 | 0,26 |
| 5,090 % fällig am 31.07.2043 | | 400 | | 416 | 0,08 |
| 5,875 % fällig am 23.05.2031 | | 900 | | 1.040 | 0,21 |
| **Places for People Treasury PLC** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 26.01.2036 | | 800 | | 662 | 0,13 |
| **Platform HG Financing PLC** | | | | | |
| 1,926 % fällig am 15.09.2041 | | 900 | | 660 | 0,13 |
| **Prudential PLC** | | | | | |
| 6,125 % fällig am 19.12.2031 | | 580 | | 607 | 0,12 |
| **Quadgas Finance PLC** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 17.09.2029 | | 800 | | 738 | 0,15 |
| **Rentokil Initial PLC** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 27.06.2032 | | 900 | | 914 | 0,18 |
| **RHP Finance PLC** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 05.02.2048 | | 350 | | 309 | 0,06 |
| **Riverside Finance PLC** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 05.12.2044 | | 900 | | 889 | 0,18 |
| **Rolls-Royce PLC** | | | | | |
| 4,625 % fällig am 16.02.2026 | € | 500 | | 405 | 0,08 |
| **Sage Group PLC** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 25.02.2031 | £ | 800 | | 654 | 0,13 |
| 2,875 % fällig am 08.02.2034 | | 2.500 | | 2.155 | 0,43 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | | |
| 2,421 % fällig am 17.01.2029 | | 2.600 | | 2.319 | 0,46 |
| 3,625 % fällig am 14.01.2026 | | 600 | | 586 | 0,12 |
| 4,750 % fällig am 15.09.2025 | $ | 1.600 | | 1.302 | 0,26 |
| **Scotland Gas Networks PLC** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 21.12.2034 | £ | 300 | | 311 | 0,06 |
| **Scottish Hydro Electric Transmission PLC** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 24.03.2036 | | 750 | | 580 | 0,12 |
| 2,250 % fällig am 27.09.2035 | | 1.400 | | 1.107 | 0,22 |
| **Scottish Widows Ltd.** | | | | | |
| 7,000 % fällig am 16.06.2043 | | 900 | | 961 | 0,19 |
| **Severn Trent Utilities Finance PLC** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 02.06.2040 | | 600 | | 438 | 0,09 |
| 2,625 % fällig am 22.02.2033 | | 300 | | 268 | 0,05 |
| **Society of Lloyd's** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.10.2024 | | 1.000 | | 994 | 0,20 |
| 4,875 % fällig am 07.02.2047 | | 800 | | 780 | 0,15 |
| **South Eastern Power Networks PLC** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 30.09.2034 | | 2.700 | | 2.100 | 0,42 |
| **Southern Electric Power Distribution PLC** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 07.06.2032 | | 800 | | 896 | 0,18 |
| **Southern Gas Networks PLC** | | | | | |
| 3,100 % fällig am 15.09.2036 | | 1.600 | | 1.346 | 0,27 |
| **Southern Housing Group Ltd.** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 08.10.2036 | | 1.700 | | 1.393 | 0,28 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Sovereign Housing Capital PLC** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 04.11.2048 | £ | 1.000 | £ | 753 | 0,15 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | | |
| 0,800 % fällig am 17.11.2029 | € | 1.100 | | 780 | 0,15 |
| 1,456 % fällig am 14.01.2027 | $ | 700 | | 509 | 0,10 |
| **Student Finance PLC** | | | | | |
| 2,666 % fällig am 30.09.2029 | £ | 500 | | 487 | 0,10 |
| **Telereal Secured Finance PLC** | | | | | |
| 4,010 % fällig am 10.12.2033 | | 1.043 | | 1.043 | 0,21 |
| **Telereal Securitisation PLC** | | | | | |
| 4,974 % fällig am 10.12.2033 | | 158 | | 165 | 0,03 |
| **Tesco Corporate Treasury Services PLC** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 02.11.2028 | | 2.200 | | 1.874 | 0,37 |
| **Tesco Property Finance PLC** | | | | | |
| 5,411 % fällig am 13.07.2044 | | 1.659 | | 1.682 | 0,33 |
| 5,661 % fällig am 13.10.2041 | | 871 | | 904 | 0,18 |
| 5,744 % fällig am 13.04.2040 | | 837 | | 883 | 0,18 |
| 5,801 % fällig am 13.10.2040 | | 1.142 | | 1.208 | 0,24 |
| 6,052 % fällig am 13.10.2039 | | 1.825 | | 1.980 | 0,39 |
| **Thames Water Utilities Finance PLC** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 24.01.2032 | | 900 | | 797 | 0,16 |
| 3,500 % fällig am 25.02.2028 | | 1.000 | | 985 | 0,20 |
| **TP ICAP Finance PLC** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 18.11.2028 | | 3.650 | | 3.009 | 0,60 |
| 5,250 % fällig am 29.05.2026 | | 950 | | 929 | 0,18 |
| **Unique Pub Finance Co. PLC** | | | | | |
| 5,659 % fällig am 30.06.2027 | | 1.072 | | 1.132 | 0,22 |
| 7,395 % fällig am 28.03.2024 | | 345 | | 355 | 0,07 |
| **Virgin Money UK PLC** | | | | | |
| 3,125 % fällig am 22.06.2025 | | 200 | | 194 | 0,04 |
| 3,375 % fällig am 24.04.2026 | | 500 | | 476 | 0,09 |
| 4,000 % fällig am 25.09.2026 | | 1.500 | | 1.451 | 0,29 |
| 4,000 % fällig am 03.09.2027 | | 865 | | 826 | 0,16 |
| 5,125 % fällig am 11.12.2030 | | 300 | | 290 | 0,06 |
| 7,875 % fällig am 14.12.2028 | | 500 | | 514 | 0,10 |
| **Vodafone Group PLC** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 12.08.2056 | | 800 | | 569 | 0,11 |
| 3,375 % fällig am 08.08.2049 | | 1.700 | | 1.345 | 0,27 |
| **Wellcome Trust Ltd.** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 14.07.2071 | | 1.300 | | 733 | 0,15 |
| **Western Power Distribution East Midlands PLC** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 10.12.2040 | | 300 | | 364 | 0,07 |
| **Western Power Distribution South Wales PLC** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 23.03.2040 | | 850 | | 976 | 0,19 |
| **Western Power Distribution West Midlands PLC** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 16.04.2032 | | 900 | | 1.013 | 0,20 |
| **Workspace Group PLC** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 11.03.2028 | | 1.600 | | 1.318 | 0,26 |
| **Yorkshire Building Society** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.09.2029 | | 800 | | 660 | 0,13 |
| | | | | 150.722 | 29,84 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | | |
| **Alba PLC** | | | | | |
| 1,049 % fällig am 15.12.2038 | | 956 | | 918 | 0,18 |
| **Atlas Funding PLC** | | | | | |
| 1,388 % fällig am 25.07.2058 | | 1.062 | | 1.052 | 0,21 |
| **Avon Finance PLC** | | | | | |
| 1,690 % fällig am 20.09.2048 | | 1.794 | | 1.785 | 0,35 |
| **Barley Hill PLC** | | | | | |
| 1,892 % fällig am 27.08.2058 | | 1.161 | | 1.148 | 0,23 |
| **Brants Bridge 2022-1 PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 12.12.2064 | | 352 | | 352 | 0,07 |
| **Canada Square Funding PLC** | | | | | |
| 1,550 % fällig am 17.10.2051 | | 489 | | 489 | 0,10 |
| **Eurohome UK Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,739 % fällig am 15.06.2044 | | 117 | | 114 | 0,02 |
| **EuroMASTR PLC** | | | | | |
| 1,789 % fällig am 15.06.2040 | | 589 | | 559 | 0,11 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | | |
| 1,775 % fällig am 16.12.2069 | | 687 | | 684 | 0,14 |
| **Gosforth Funding PLC** | | | | | |
| 1,352 % fällig am 25.08.2060 | | 510 | | 510 | 0,10 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,048 % fällig am 18.06.2038 | £ | 15 | £ | 14 | 0,00 |
| 1,743 % fällig am 18.03.2039 | | 692 | | 682 | 0,13 |
| **Harbour Energy PLC** | | | | | |
| 1,405 % fällig am 28.01.2054 | | 300 | | 292 | 0,06 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,703 % fällig am 25.05.2053 | | 780 | | 778 | 0,15 |
| **Hops Hill No. 1 PLC** | | | | | |
| 1,922 % fällig am 27.05.2054 | | 712 | | 709 | 0,14 |
| **Lanark Master Issuer PLC** | | | | | |
| 1,210 % fällig am 22.12.2069 | | 280 | | 279 | 0,06 |
| **London Wall Mortgage Capital PLC** | | | | | |
| 1,351 % fällig am 15.05.2051 | | 443 | | 436 | 0,09 |
| **Ludgate Funding PLC** | | | | | |
| 1,638 % fällig am 01.01.2061 | | 1.927 | | 1.862 | 0,37 |
| **Mansard Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,529 % fällig am 15.12.2049 | | 110 | | 108 | 0,02 |
| **Mortimer BTL PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 23.03.2054 | | 900 | | 892 | 0,18 |
| 1,492 % fällig am 23.06.2053 | | 1.908 | | 1.849 | 0,37 |
| **Newgate Funding PLC** | | | | | |
| 0,319 % fällig am 15.12.2050 | € | 925 | | 781 | 0,15 |
| **Polaris 2022-2 PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 23.05.2059 | £ | 1.300 | | 1.300 | 0,26 |
| **Polaris PLC** | | | | | |
| 1,730 % fällig am 23.12.2058 | | 1.133 | | 1.117 | 0,22 |
| **Residential Mortgage Securities PLC** | | | | | |
| 2,040 % fällig am 20.06.2070 | | 1.332 | | 1.328 | 0,26 |
| **RMAC PLC** | | | | | |
| 1,571 % fällig am 12.06.2046 | | 1.620 | | 1.610 | 0,32 |
| 1,841 % fällig am 12.06.2046 | | 775 | | 776 | 0,15 |
| **Silverstone Master Issuer PLC** | | | | | |
| 1,216 % fällig am 21.01.2070 | | 264 | | 264 | 0,05 |
| **Stratton Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2060 | | 1.530 | | 1.518 | 0,30 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 1,605 % fällig am 20.10.2051 | | 1.815 | | 1.809 | 0,36 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | | |
| 1,602 % fällig am 12.03.2055 | | 1.562 | | 1.520 | 0,30 |
| | | | | 27.535 | 5,45 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 22.07.2022 | | 66.380 | | 66.362 | 13,14 |
| 0,875 % fällig am 31.07.2033 | | 12.700 | | 10.857 | 2,15 |
| 1,500 % fällig am 31.07.2053 | | 12.600 | | 9.769 | 1,93 |
| 1,750 % fällig am 07.09.2022 | | 11.250 | | 11.261 | 2,23 |
| 4,250 % fällig am 07.03.2036 (g) | | 3.700 | | 4.418 | 0,88 |
| | | | | 102.667 | 20,33 |
| Summe Großbritannien | | | | 280.924 | 55,62 |
| **USA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **AES Corp.** | | | | | |
| 2,450 % fällig am 15.01.2031 | $ | 900 | | 597 | 0,12 |
| **Amgen, Inc.** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 13.09.2029 | £ | 1.040 | | 1.065 | 0,21 |
| **Apple, Inc.** | | | | | |
| 3,050 % fällig am 31.07.2029 | | 500 | | 502 | 0,10 |
| 3,600 % fällig am 31.07.2042 | | 600 | | 598 | 0,12 |
| 4,450 % fällig am 06.05.2044 | $ | 400 | | 329 | 0,07 |
| **AT&T, Inc.** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.06.2043 | £ | 3.550 | | 3.280 | 0,65 |
| 4,375 % fällig am 14.09.2029 | | 1.000 | | 1.020 | 0,20 |
| 5,200 % fällig am 18.11.2033 | | 1.200 | | 1.274 | 0,25 |
| **Bank of America Corp.** | | | | | |
| 3,584 % fällig am 27.04.2031 | | 1.500 | | 1.427 | 0,28 |
| **Berkshire Hathaway Finance Corp.** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 19.06.2039 | | 1.600 | | 1.301 | 0,26 |
| **Blue Owl Finance LLC** | | | | | |
| 3,125 % fällig am 10.06.2031 | $ | 800 | | 509 | 0,10 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 23.10.2026 | £ | 1.000 | | 908 | 0,18 |
| 2,750 % fällig am 24.01.2024 | | 850 | | 839 | 0,17 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| 4,500 % fällig am 03.03.2031 | £ | 1.000 | £ | 955 | 0,19 |
| 5,150 % fällig am 21.05.2026 | | 1.060 | | 1.102 | 0,22 |
| **Comcast Corp.** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 20.02.2029 | | 500 | | 443 | 0,09 |
| 1,875 % fällig am 20.02.2036 | | 1.200 | | 940 | 0,19 |
| **Digital Stout Holding LLC** | | | | | |
| 3,300 % fällig am 19.07.2029 | | 816 | | 744 | 0,15 |
| 3,750 % fällig am 17.10.2030 | | 1.850 | | 1.709 | 0,34 |
| **Duke Energy Corp.** | | | | | |
| 3,850 % fällig am 15.06.2034 | € | 900 | | 760 | 0,15 |
| **Eli Lilly & Co.** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 14.09.2043 | £ | 800 | | 565 | 0,11 |
| **Entergy Corp.** | | | | | |
| 2,800 % fällig am 15.06.2030 | $ | 400 | | 283 | 0,06 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | | |
| 3,360 % fällig am 21.05.2031 | £ | 400 | | 371 | 0,07 |
| **Fiserv, Inc.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.07.2031 | | 791 | | 712 | 0,14 |
| **Ford Motor Co.** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.02.2032 | $ | 150 | | 93 | 0,02 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | | |
| 2,748 % fällig am 14.06.2024 | £ | 1.200 | | 1.110 | 0,22 |
| 4,535 % fällig am 06.03.2025 | | 1.050 | | 985 | 0,19 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 16.12.2030 | | 4.200 | | 3.454 | 0,68 |
| 3,625 % fällig am 29.10.2029 | | 3.500 | | 3.358 | 0,66 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | | |
| 1,895 % fällig am 28.04.2033 | | 1.200 | | 986 | 0,20 |
| 3,882 % fällig am 24.07.2038 | $ | 200 | | 145 | 0,03 |
| 4,203 % fällig am 23.07.2029 | | 700 | | 557 | 0,11 |
| **MassMutual Global Funding** | | | | | |
| 1,375 % fällig am 15.12.2026 | £ | 1.000 | | 914 | 0,18 |
| **McDonald's Corp.** | | | | | |
| 2,950 % fällig am 15.03.2034 | | 500 | | 450 | 0,09 |
| **Metropolitan Life Global Funding** | | | | | |
| 0,625 % fällig am 08.12.2027 | | 500 | | 426 | 0,08 |
| 1,625 % fällig am 21.09.2029 | | 600 | | 526 | 0,10 |
| 3,500 % fällig am 30.09.2026 | | 940 | | 938 | 0,19 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **MPT Operating Partnership LP** | | | | | |
| 0,993 % fällig am 15.10.2026 | € | 100 | £ | 71 | 0,01 |
| 2,500 % fällig am 24.03.2026 | £ | 3.300 | | 2.928 | 0,58 |
| 2,550 % fällig am 05.12.2023 | | 500 | | 480 | 0,09 |
| 3,375 % fällig am 24.04.2030 | | 600 | | 481 | 0,10 |
| 3,692 % fällig am 05.06.2028 | | 1.200 | | 1.041 | 0,21 |
| **Nestle Holdings, Inc.** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 04.04.2032 | | 2.000 | | 1.858 | 0,37 |
| **Netflix, Inc.** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.11.2029 | € | 800 | | 623 | 0,12 |
| **New York Life Global Funding** | | | | | |
| 1,250 % fällig am 17.12.2026 | £ | 500 | | 454 | 0,09 |
| **Pfizer, Inc.** | | | | | |
| 2,735 % fällig am 15.06.2043 | | 1.000 | | 853 | 0,17 |
| **Realty Income Corp.** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 13.07.2033 | | 1.100 | | 850 | 0,17 |
| 1,875 % fällig am 14.01.2027 | | 1.300 | | 1.196 | 0,24 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.04.2030 | $ | 600 | | 461 | 0,09 |
| **Time Warner Cable LLC** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.07.2042 | £ | 1.500 | | 1.385 | 0,27 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 19.09.2030 | | 500 | | 430 | 0,09 |
| 1,875 % fällig am 03.11.2038 | | 700 | | 498 | 0,10 |
| 2,500 % fällig am 08.04.2031 | | 1.400 | | 1.241 | 0,25 |
| 3,375 % fällig am 27.10.2036 | | 1.700 | | 1.519 | 0,30 |
| 4,750 % fällig am 17.02.2034 | | 550 | | 573 | 0,11 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 24.09.2031 | | 2.100 | | 1.742 | 0,34 |
| 2,500 % fällig am 02.05.2029 | | 2.750 | | 2.481 | 0,49 |
| 3,500 % fällig am 12.09.2029 | | 700 | | 669 | 0,13 |
| **Welltower, Inc.** | | | | | |
| 4,800 % fällig am 20.11.2028 | | 500 | | 517 | 0,10 |
| | | | | 58.526 | 11,59 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | | |
| **Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,124 % fällig am 25.04.2035 | $ | 105 | | 81 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | | | |
| 2,901 % fällig am 20.07.2037 ^ | $ | 7 | £ | 5 | 0,00 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,543 % fällig am 25.02.2034 | | 1 | | 1 | 0,00 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | | |
| 1,676 % fällig am 25.11.2042 | | 16 | | 12 | 0,00 |
| | | | | 99 | 0,02 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | | |
| 1,524 % fällig am 01.07.2044 | | 5 | | 4 | 0,00 |
| 2,560 % fällig am 01.08.2036 | | 4 | | 3 | 0,00 |
| | | | | 7 | 0,00 |
| Summe USA | | | | 58.632 | 11,61 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | | |
| **U.K. TREASURY BILLS** | | | | | |
| 0,550 % fällig am 18.07.2022 (b)(c) | £ | 420 | | 420 | 0,08 |
| 0,560 % fällig am 18.07.2022 (b)(c) | | 8.620 | | 8.619 | 1,71 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | | 9.039 | 1,79 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **£** | **485.508** | **96,13** |
| | | **AKTIEN** | | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (e)** | | 2.500 | | 209 | 0,04 |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF (e)** | | 51.000 | | 5.144 | 1,02 |
| **Summe Investmentfonds** | | | **£** | **5.353** | **1,06** |

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

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

### FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09.2022 | 51 | £ 6 | 0,00 |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 77 | 285 | 0,06 |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 8 | (32) | (0,01) |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 130 | 67 | 0,02 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 110 | (87) | (0,02) |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2022 | 6 | 6 | 0,00 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2022 | 16 | 59 | 0,01 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09.2022 | 100 | 410 | 0,08 |
| | | | | £ 714 | 0,14 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **£ 714** | **0,14** |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| General Electric Co. | 1,000 % | 20.06.2026 | $ 700 | £ (13) | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.06.2024 | € 1.700 | (33) | (0,01) |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.12.2024 | 2.300 | (97) | (0,02) |
| | | | | £ (143) | (0,03) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Europe Main 37 10-Year Index | 1,000 % | 20.06.2027 | € 34.800 | £ (490) | (0,10) |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fest-Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 % | 21.09.2024 | £ 144.500 | £ (1.849) | (0,36) |
| Zahlung[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 | 21.09.2027 | 51.900 | (1.353) | (0,27) |
| Zahlung[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2052 | 7.300 | (1.114) | (0,22) |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 | 15.12.2026 | $ 3.100 | (187) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 17.06.2030 | 9.200 | 1.111 | 0,22 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 18.12.2029 | 9.300 | 643 | 0,13 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 12.02.2045 | 2.100 | (306) | (0,06) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2027 | € 7.400 | 322 | 0,06 |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | 4.000 | (356) | (0,07) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2024 | 10.300 | 184 | 0,04 |
| | | | | | £ (2.905) | (0,57) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **£ (3.538)** | **(0,70)** |

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

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

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

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

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

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 % | 20.07.2022 | 2.400 | £ (8) | £ (4) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 8.700 | (21) | (23) | (0,01) |
| BRC | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 700 | (5) | (7) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 16.600 | (55) | (29) | (0,01) |
| JPM | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 1.500 | (11) | (14) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,100 | 20.07.2022 | 600 | (2) | (2) | 0,00 |
| | | | | | | £ (102) | £ (79) | (0,02) |

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

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 08.2022 | £ 68 | € 80 | £ 1 | £ 0 | £ 1 | 0,00 |
| BRC | 08.2022 | 671 | 780 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | 1.942 | $ 2.443 | 68 | 0 | 68 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ 1.068 | £ 874 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| DUB | 08.2022 | 26.215 | 21.251 | 0 | (318) | (318) | (0,06) |
| JPM | 08.2022 | € 40.880 | 35.173 | 0 | (95) | (95) | (0,02) |
| | 08.2022 | $ 23 | CNH 152 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 08.2022 | € 1.470 | £ 1.260 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 08.2022 | £ 3.729 | € 4.324 | 3 | (2) | 1 | 0,00 |
| | 08.2022 | 1.824 | $ 2.207 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 7.768 | £ 6.308 | 0 | (83) | (83) | (0,01) |
| MYI | 08.2022 | € 795 | 680 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 08.2022 | £ 3.639 | € 4.222 | 14 | (10) | 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | 1.635 | $ 1.995 | 8 | (2) | 6 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 143 | £ 117 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| RBC | 08.2022 | £ 1.222 | $ 1.503 | 17 | (3) | 14 | 0,00 |
| SCX | 08.2022 | 923 | € 1.079 | 9 | (1) | 8 | 0,00 |
| SOG | 08.2022 | 268 | 312 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| TOR | 08.2022 | 1.191 | $ 1.492 | 37 | 0 | 37 | 0,01 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| UAG | 08.2022 | £ 532 | $ 649 | £ 2 | £ 0 | £ 2 | 0,00 |
| | | | | £ 162 | £ (541) | £ (379) | (0,07) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **£ (458)** | **(0,09)** |
| **Summe Anlagen** | | | | | | **£ 487.579** | **96,54** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | | | | | **£ 17.479** | **3,46** |
| **Nettovermögen** | | | | | | **£ 505.058** | **100,00** |

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

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

**^ Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

**(b) Nullkuponwertpapier.**

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

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

**(e) Mit dem Fonds verbunden.**

**(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(g) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 489 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von GBP 8.439 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | £ 485.508 | £ 0 | £ 485.508 |
| Investmentfonds | 209 | 5.144 | 0 | 5.353 |
| Finanzderivate[3] | 669 | (3.951) | 0 | (3.282) |
| **Summen** | **£ 878** | **£ 486.701** | **£ 0** | **£ 487.579** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | £ 0 | £ 571.865 | £ 0 | £ 571.865 |
| Investmentfonds | 208 | 0 | 0 | 208 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 526 | 0 | 526 |
| Finanzderivate[3] | 160 | (1.074) | 0 | (914) |
| **Summen** | **£ 368** | **£ 571.317** | **£ 0** | **£ 571.685** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | £ (27) | £ 30 | £ 3 |
| BPS | 1 | 0 | 1 |
| BRC | 30 | 0 | 30 |
| DUB | (318) | 369 | 51 |
| JPM | (111) | 90 | (21) |
| MBC | (98) | 0 | (98) |
| MYI | 3 | 0 | 3 |
| RBC | 14 | 0 | 14 |
| SCX | 8 | 0 | 8 |

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| SOG | £ 1 | £ 0 | £ 1 |
| TOR | 37 | 0 | 37 |
| 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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 92,61 | 93,80 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 3,44 | 2,74 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 0,08 | 0,02 |
| Investmentfonds | 1,06 | 0,04 |
| Pensionsgeschäfte | k. A. | 0,09 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,14 | 0,02 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,70) | (0,30) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (0,09) | 0,13 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | k. A. | (0,09) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Australien | k. A. | 0,09 |
| Österreich | 0,03 | 0,18 |
| Belgien | 0,67 | 0,75 |
| Brasilien | k. A. | 0,27 |
| Kanada | 0,34 | 0,37 |
| Cayman-Inseln | 0,10 | 0,31 |
| Dänemark | 0,35 | 0,43 |
| Finnland | k. A. | 0,41 |
| Frankreich | 3,22 | 4,09 |
| Deutschland | 2,07 | 1,95 |
| Guernsey, Kanalinseln | k. A. | 0,27 |
| Indien | 0,05 | 0,04 |
| Irland | 1,26 | 1,73 |
| Insel Man | k. A. | 0,13 |
| Italien | 0,82 | 2,26 |
| Japan | 0,26 | 0,49 |
| Jersey, Kanalinseln | 2,49 | 2,52 |
| Luxemburg | 2,46 | 2,59 |
| Mauritius | 0,18 | 0,39 |
| Niederlande | 5,08 | 5,25 |
| Norwegen | 0,41 | 0,13 |
| Singapur | 0,23 | 0,41 |
| Slowenien | k. A. | 0,13 |
| Südkorea | k. A. | 0,06 |
| Spanien | 1,30 | 1,56 |
| Supranational | 3,59 | 2,95 |
| Schweden | 0,46 | 0,42 |
| Schweiz | 1,74 | 2,09 |
| Großbritannien | 55,62 | 52,85 |
| Vereinigte Staaten | 11,61 | 11,42 |
| Kurzfristige Instrumente | 1,79 | 0,02 |
| Investmentfonds | 1,06 | 0,04 |
| Pensionsgeschäfte | k. A. | 0,09 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,14 | 0,02 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,03) | (0,01) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | (0,10) | 0,01 |
| Zinsswaps | (0,57) | (0,30) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,02) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | k. A. | 0,03 |
| Devisenterminkontrakte | (0,07) | 0,10 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 3,46 | 3,46 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **BELGIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Anheuser-Busch InBev S.A.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 25.05.2037 | £ | 1.900 | £ 1.571 | 0,53 |
| **Sofina S.A.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 23.09.2028 | € | 900 | 610 | 0,20 |
| Summe Belgien | | | 2.181 | 0,73 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Orsted A/S** | | | | |
| 2,500 % fällig am 16.05.2033 | £ | 200 | 176 | 0,06 |
| **TDC Net A/S** | | | | |
| 5,056 % fällig am 31.05.2028 | € | 600 | 484 | 0,16 |
| Summe Dänemark | | | 660 | 0,22 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Accor S.A.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 29.11.2028 | | 200 | 137 | 0,05 |
| **Air France-KLM** | | | | |
| 1,875 % fällig am 16.01.2025 | | 400 | 291 | 0,10 |
| **AXA S.A.** | | | | |
| 5,453 % fällig am 04.03.2026 (b) | £ | 600 | 598 | 0,20 |
| 5,625 % fällig am 16.01.2054 | | 400 | 380 | 0,13 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 13.09.2036 | | 600 | 429 | 0,14 |
| 4,625 % fällig am 12.01.2027 (b)(c) | $ | 400 | 274 | 0,09 |
| 4,625 % fällig am 25.02.2031 (b)(c) | | 800 | 488 | 0,16 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 13.10.2046 (c) | € | 800 | 496 | 0,17 |
| **Electricite de France S.A.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 22.09.2050 | £ | 2.950 | 2.977 | 1,00 |
| 5,500 % fällig am 27.03.2037 | | 2.700 | 2.843 | 0,95 |
| 5,500 % fällig am 17.10.2041 | | 900 | 943 | 0,31 |
| 6,000 % fällig am 22.01.2114 | $ | 1.300 | 931 | 0,31 |
| **Peugeot Invest** | | | | |
| 1,875 % fällig am 30.10.2026 | € | 400 | 318 | 0,11 |
| | | | 11.105 | 3,72 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **SNCF Reseau** | | | | |
| 5,000 % fällig am 11.03.2052 | £ | 400 | 515 | 0,17 |
| 5,250 % fällig am 31.01.2035 | | 100 | 121 | 0,04 |
| | | | 636 | 0,21 |
| Summe Frankreich | | | 11.741 | 3,93 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 1,375 % fällig am 17.02.2032 | € | 400 | 263 | 0,09 |
| 1,875 % fällig am 22.12.2028 | £ | 1.400 | 1.176 | 0,39 |
| 3,547 % fällig am 18.09.2031 | $ | 1.500 | 1.035 | 0,34 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.09.2026 (a) | € | 200 | 143 | 0,05 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** | | | | |
| 0,875 % fällig am 15.09.2026 | £ | 3.400 | 3.192 | 1,07 |
| 5,750 % fällig am 07.06.2032 | | 300 | 381 | 0,13 |
| **Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen** | | | | |
| 1,000 % fällig am 26.05.2042 | € | 300 | 186 | 0,06 |
| **Schaeffler AG** | | | | |
| 2,750 % fällig am 12.10.2025 | | 300 | 238 | 0,08 |
| **Sixt SE** | | | | |
| 1,750 % fällig am 09.12.2024 | | 100 | 84 | 0,03 |
| Summe Deutschland | | | 6.698 | 2,24 |
| **INDIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ReNew Power Pvt Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 05.03.2027 | $ | 200 | 151 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **IRLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Toro European CLO DAC** | | | | |
| 0,920 % fällig am 12.01.2032 | € | 2.600 | £ 2.174 | 0,73 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **CCEP Finance Ireland DAC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 06.05.2041 | | 900 | 516 | 0,17 |
| **ESB Finance DAC** | | | | |
| 1,875 % fällig am 21.07.2035 | £ | 300 | 239 | 0,08 |
| **GE Capital UK Funding Unlimited Co.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 18.01.2033 | | 1.400 | 1.553 | 0,52 |
| **Permanent TSB Group Holdings PLC** | | | | |
| 2,125 % fällig am 26.09.2024 | € | 800 | 673 | 0,22 |
| **Perrigo Finance Unlimited Co.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 15.06.2030 | $ | 200 | 147 | 0,05 |
| **Zurich Finance Ireland Designated Activity Co.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 19.04.2051 | | 900 | 591 | 0,20 |
| | | | 3.719 | 1,24 |
| Summe Irland | | | 5.893 | 1,97 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aeroporti di Roma SpA** | | | | |
| 1,750 % fällig am 30.07.2031 | € | 100 | 66 | 0,02 |
| 5,441 % fällig am 20.02.2023 | £ | 300 | 303 | 0,10 |
| **Atlantia SpA** | | | | |
| 1,875 % fällig am 12.02.2028 | € | 1.400 | 941 | 0,31 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 2,625 % fällig am 28.04.2025 | | 1.000 | 765 | 0,26 |
| **Enel SpA** | | | | |
| 5,750 % fällig am 22.06.2037 | £ | 700 | 771 | 0,26 |
| **Nexi SpA** | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.04.2026 | € | 300 | 211 | 0,07 |
| 2,125 % fällig am 30.04.2029 | | 400 | 242 | 0,08 |
| Summe Italien | | | 3.299 | 1,10 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.07.2043 | £ | 900 | 882 | 0,30 |
| 3,250 % fällig am 31.07.2050 | | 1.700 | 1.431 | 0,48 |
| 4,875 % fällig am 31.07.2043 | | 1.600 | 1.592 | 0,53 |
| 5,500 % fällig am 31.07.2050 | | 180 | 176 | 0,06 |
| **Gatwick Funding Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 28.09.2041 | | 1.000 | 795 | 0,27 |
| **Heathrow Funding Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 13.10.2031 | | 700 | 637 | 0,21 |
| 4,625 % fällig am 31.10.2046 | | 2.277 | 2.201 | 0,74 |
| 5,875 % fällig am 13.05.2043 | | 650 | 732 | 0,24 |
| **HSBC Bank Capital Funding Sterling LP** | | | | |
| 5,844 % fällig am 05.11.2031 (b) | | 2.321 | 2.665 | 0,89 |
| Summe Jersey, Kanalinseln | | | 11.111 | 3,72 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 16.10.2029 | | 300 | 253 | 0,08 |
| **Becton Dickinson Euro Finance SARL** | | | | |
| 1,336 % fällig am 13.08.2041 | € | 1.200 | 652 | 0,22 |
| **Bevco Lux SARL** | | | | |
| 1,000 % fällig am 16.01.2030 | | 600 | 409 | 0,14 |
| **CK Hutchison Group Telecom Finance S.A.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 17.10.2034 | £ | 1.350 | 1.016 | 0,34 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 14.01.2030 | € | 600 | 366 | 0,12 |
| 2,750 % fällig am 22.01.2028 | £ | 1.200 | 928 | 0,31 |
| **Prologis International Funding S.A.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 22.02.2042 | | 1.000 | 795 | 0,27 |
| Summe Luxemburg | | | 4.419 | 1,48 |
| **MAURITIUS** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Greenko Solar Mauritius Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 29.07.2026 | $ | 350 | 258 | 0,09 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **MEXIKO** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **America Movil S.A.B. de C.V.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 07.08.2041 | £ | 388 | £ 374 | 0,12 |
| 4,948 % fällig am 22.07.2033 | | 100 | 106 | 0,04 |
| Summe Mexiko | | | 480 | 0,16 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | |
| 4,375 % fällig am 22.09.2025 (b)(c) | € | 500 | 382 | 0,13 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 3,100 % fällig am 29.06.2028 (b)(c) | | 200 | 130 | 0,04 |
| 4,625 % fällig am 23.05.2029 | £ | 200 | 193 | 0,06 |
| 4,875 % fällig am 29.06.2029 (b)(c) | € | 800 | 579 | 0,19 |
| 5,250 % fällig am 14.09.2027 | £ | 850 | 858 | 0,29 |
| **CTP NV** | | | | |
| 1,250 % fällig am 21.06.2029 | € | 400 | 241 | 0,08 |
| **Digital Dutch Finco BV** | | | | |
| 1,000 % fällig am 15.01.2032 | | 200 | 123 | 0,04 |
| **E.ON International Finance BV** | | | | |
| 4,750 % fällig am 31.01.2034 | £ | 2.600 | 2.681 | 0,90 |
| 5,875 % fällig am 30.10.2037 | | 1.100 | 1.248 | 0,42 |
| 6,125 % fällig am 06.07.2039 | | 1.650 | 1.920 | 0,64 |
| **Enel Finance International NV** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.06.2032 | $ | 400 | 318 | 0,11 |
| 5,750 % fällig am 14.09.2040 | £ | 2.763 | 3.055 | 1,02 |
| **Holcim Sterling Finance Netherlands BV** | | | | |
| 2,250 % fällig am 04.04.2034 | | 800 | 618 | 0,21 |
| 3,000 % fällig am 12.05.2032 | | 300 | 262 | 0,09 |
| **IMCD NV** | | | | |
| 2,125 % fällig am 31.03.2027 | € | 300 | 233 | 0,08 |
| **JAB Holdings BV** | | | | |
| 2,250 % fällig am 19.12.2039 | | 900 | 507 | 0,17 |
| **JDE Peet's NV** | | | | |
| 1,125 % fällig am 16.06.2033 | | 400 | 245 | 0,08 |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | |
| 6,500 % (b) | | 1.981 | 1.660 | 0,55 |
| **Thermo Fisher Scientific Finance BV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 18.10.2051 | | 500 | 299 | 0,10 |
| **Vestas Wind Systems Finance BV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 15.06.2034 | | 300 | 215 | 0,07 |
| **Volkswagen International Finance NV** | | | | |
| 3,500 % fällig am 17.06.2025 (b) | | 300 | 235 | 0,08 |
| 3,875 % fällig am 17.06.2029 (b) | | 500 | 358 | 0,12 |
| | | | 16.360 | 5,47 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Nederlandse Waterschapsbank NV** | | | | |
| 5,375 % fällig am 07.06.2032 | £ | 400 | 492 | 0,17 |
| Summe Niederlande | | | 16.852 | 5,64 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aker BP ASA** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.01.2030 | $ | 350 | 259 | 0,09 |
| **Equinor ASA** | | | | |
| 4,250 % fällig am 10.04.2041 | £ | 700 | 712 | 0,24 |
| Summe Norwegen | | | 971 | 0,33 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Temasek Financial Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 26.07.2040 | | 1.050 | 1.256 | 0,42 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (b)(c) | € | 200 | 166 | 0,05 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 14.09.2028 (b)(c) | | 600 | 357 | 0,12 |
| 6,000 % fällig am 18.07.2022 (b)(c) | | 200 | 172 | 0,06 |
| 6,750 % fällig am 13.06.2024 (b)(c) | | 200 | 166 | 0,06 |
| Summe Spanien | | | 861 | 0,29 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **SUPRANATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | |
| 3,875 % fällig am 08.06.2037 | £ | 200 | £ 224 | 0,07 |
| 5,625 % fällig am 07.06.2032 | | 200 | 251 | 0,08 |
| 6,000 % fällig am 07.12.2028 | | 1.700 | 2.062 | 0,69 |
| **Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung** | | | | |
| 0,100 % fällig am 17.09.2035 | € | 1.000 | 643 | 0,22 |
| Summe Supranational | | | 3.180 | 1,06 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **EQT AB** | | | | |
| 2,875 % fällig am 06.04.2032 | | 300 | 218 | 0,07 |
| **Investor AB** | | | | |
| 5,500 % fällig am 05.05.2037 | £ | 300 | 358 | 0,12 |
| Summe Schweden | | | 576 | 0,19 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 3,091 % fällig am 14.05.2032 | $ | 500 | 328 | 0,11 |
| 4,194 % fällig am 01.04.2031 | | 250 | 183 | 0,06 |
| 6,250 % fällig am 18.12.2024 (b)(c) | | 400 | 301 | 0,10 |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (b)(c) | | 200 | 152 | 0,05 |
| 7,500 % fällig am 11.12.2023 (b)(c) | | 2.400 | 1.888 | 0,63 |
| **UBS AG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (c) | | 300 | 247 | 0,08 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 3,126 % fällig am 13.08.2030 | | 200 | 146 | 0,05 |
| 4,375 % fällig am 10.02.2031 (b)(c) | | 800 | 483 | 0,16 |
| 4,875 % fällig am 12.02.2027 (b)(c) | | 300 | 207 | 0,07 |
| 5,125 % fällig am 29.07.2026 (b)(c) | | 300 | 222 | 0,08 |
| Summe Schweiz | | | 4.157 | 1,39 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **3i Group PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 05.06.2040 | £ | 1.400 | 1.187 | 0,40 |
| **Accent Capital PLC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 18.07.2049 | | 400 | 312 | 0,10 |
| **Annington Funding PLC** | | | | |
| 2,924 % fällig am 06.10.2051 | | 2.500 | 1.682 | 0,56 |
| 3,685 % fällig am 12.07.2034 | | 550 | 486 | 0,16 |
| **Arqiva Financing PLC** | | | | |
| 4,882 % fällig am 31.12.2032 | | 488 | 514 | 0,17 |
| 5,340 % fällig am 30.12.2037 | | 100 | 109 | 0,04 |
| **Aviva PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 03.06.2055 | | 1.000 | 809 | 0,27 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 17.01.2033 | | 780 | 666 | 0,22 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (b)(c) | | 600 | 591 | 0,20 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (b)(c) | $ | 200 | 162 | 0,05 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2022 (b)(c) | £ | 225 | 225 | 0,08 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2022 (b) | | 300 | 299 | 0,10 |
| 8,000 % fällig am 15.06.2024 (b)(c) | $ | 600 | 487 | 0,16 |
| 8,875 % fällig am 15.09.2027 (b)(c) | £ | 500 | 497 | 0,17 |
| **Berkeley Group PLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 11.08.2031 | | 800 | 590 | 0,20 |
| **Blend Funding PLC** | | | | |
| 3,459 % fällig am 21.09.2049 | | 300 | 272 | 0,09 |
| **BPHA Finance PLC** | | | | |
| 4,816 % fällig am 11.04.2044 | | 495 | 557 | 0,19 |
| **British Land Co. PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 14.09.2029 | | 600 | 539 | 0,18 |
| 5,264 % fällig am 24.09.2035 | | 300 | 331 | 0,11 |
| **British Telecommunications PLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 21.11.2031 | | 650 | 586 | 0,20 |
| 3,625 % fällig am 21.11.2047 | | 300 | 239 | 0,08 |
| **Broadgate Financing PLC** | | | | |
| 4,999 % fällig am 05.10.2033 | | 600 | 635 | 0,21 |
| 5,098 % fällig am 05.04.2035 | | 89 | 93 | 0,03 |
| **Cadent Finance PLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 10.10.2035 | | 500 | 385 | 0,13 |
| 2,625 % fällig am 22.09.2038 | | 2.700 | 2.091 | 0,70 |
| 2,750 % fällig am 22.09.2046 | | 1.300 | 932 | 0,31 |
| **Catalyst Housing Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 31.10.2047 | £ | 900 | £ 765 | 0,26 |
| **Chancellor Masters & Scholars of The University of Cambridge** | | | | |
| 2,350 % fällig am 27.06.2078 | | 200 | 159 | 0,05 |
| **Chanel Ceres PLC** | | | | |
| 1,000 % fällig am 31.07.2031 | € | 1.000 | 712 | 0,24 |
| **Citizen Treasury PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 20.10.2048 | £ | 700 | 624 | 0,21 |
| **Clarion Funding PLC** | | | | |
| 1,250 % fällig am 13.11.2032 | | 100 | 80 | 0,03 |
| 1,875 % fällig am 22.01.2035 | | 1.200 | 957 | 0,32 |
| 1,875 % fällig am 07.09.2051 | | 1.600 | 1.000 | 0,33 |
| 3,125 % fällig am 19.04.2048 | | 1.000 | 849 | 0,28 |
| **Derwent London PLC** | | | | |
| 1,875 % fällig am 17.11.2031 | | 2.000 | 1.627 | 0,54 |
| **Direct Line Insurance Group PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 05.06.2032 | | 300 | 260 | 0,09 |
| **Drax Finco PLC** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.11.2025 | $ | 200 | 161 | 0,05 |
| **EMH Treasury PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 29.01.2044 | £ | 800 | 855 | 0,29 |
| **Eversholt Funding PLC** | | | | |
| 3,529 % fällig am 07.08.2042 | | 800 | 702 | 0,23 |
| **Futures Treasury PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 08.02.2044 | | 1.000 | 908 | 0,30 |
| **GlaxoSmithKline Capital PLC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 12.05.2035 | | 2.100 | 1.658 | 0,55 |
| 5,250 % fällig am 19.12.2033 | | 200 | 233 | 0,08 |
| 6,375 % fällig am 09.03.2039 | | 500 | 653 | 0,22 |
| **Grainger PLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 03.07.2030 | | 2.200 | 1.851 | 0,62 |
| 3,375 % fällig am 24.04.2028 | | 200 | 180 | 0,06 |
| **Great Places Housing Group Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 22.10.2042 | | 1.000 | 1.116 | 0,37 |
| **Greene King Finance PLC** | | | | |
| 3,593 % fällig am 15.03.2035 | | 754 | 708 | 0,24 |
| 4,064 % fällig am 15.03.2035 | | 291 | 275 | 0,09 |
| 5,106 % fällig am 15.03.2034 | | 2.305 | 2.353 | 0,79 |
| 5,318 % fällig am 15.09.2031 | | 2.272 | 2.352 | 0,79 |
| **GSK Consumer Healthcare Capital UK PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 29.03.2038 | | 1.020 | 921 | 0,31 |
| **Guinness Partnership Ltd.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 22.04.2055 | | 1.000 | 663 | 0,22 |
| **Hexagon Housing Association Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 22.04.2048 | | 1.300 | 1.166 | 0,39 |
| **High Speed Rail Finance PLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 01.11.2038 | | 800 | 835 | 0,28 |
| **Home Group Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 27.03.2043 | | 1.300 | 1.129 | 0,38 |
| **HSBC Bank PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 24.03.2046 | | 2.900 | 2.547 | 0,85 |
| 5,375 % fällig am 22.08.2033 | | 600 | 597 | 0,20 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 4,600 % fällig am 17.12.2030 (b)(c) | $ | 200 | 127 | 0,04 |
| 4,950 % fällig am 31.03.2030 | | 200 | 163 | 0,05 |
| 5,875 % fällig am 28.09.2026 (b)(c) | £ | 200 | 182 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 29.03.2040 | | 500 | 476 | 0,16 |
| **Jigsaw Funding PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 05.05.2052 | | 800 | 700 | 0,23 |
| **John Lewis PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 18.12.2034 | | 2.222 | 1.690 | 0,57 |
| 6,125 % fällig am 21.01.2025 | | 100 | 103 | 0,03 |
| **Juturna European Loan Conduit PLC** | | | | |
| 5,064 % fällig am 10.08.2033 | | 1.025 | 1.138 | 0,38 |
| **Karbon Homes Ltd.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.11.2047 | | 300 | 277 | 0,09 |
| **Land Securities Capital Markets PLC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 22.09.2039 | | 1.373 | 1.196 | 0,40 |
| 2,750 % fällig am 22.09.2059 | | 301 | 242 | 0,08 |
| **LCR Finance PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 07.12.2038 | | 75 | 90 | 0,03 |
| **Legal & General Group PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.11.2050 | | 400 | 360 | 0,12 |
| 5,500 % fällig am 27.06.2064 | | 100 | 90 | 0,03 |
| 5,625 % fällig am 24.03.2031 (b)(c) | | 900 | 762 | 0,26 |
| **Lendlease Europe Finance PLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 02.12.2033 | £ | 1.300 | £ 1.018 | 0,34 |
| **Liberty Living Finance PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 28.11.2029 | | 600 | 560 | 0,19 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 27.12.2024 (b)(c) | | 700 | 646 | 0,22 |
| 5,125 % fällig am 27.12.2024 (b) | | 300 | 277 | 0,09 |
| 7,875 % fällig am 27.06.2029 (b)(c) | | 1.000 | 990 | 0,33 |
| **London & Quadrant Housing Trust** | | | | |
| 2,000 % fällig am 31.03.2032 | | 2.500 | 2.170 | 0,73 |
| 2,000 % fällig am 20.10.2038 | | 700 | 532 | 0,18 |
| 3,125 % fällig am 28.02.2053 | | 800 | 670 | 0,22 |
| 3,750 % fällig am 27.10.2049 | | 300 | 281 | 0,09 |
| **Longstone Finance PLC** | | | | |
| 4,896 % fällig am 19.04.2036 | | 100 | 103 | 0,03 |
| **M&G PLC** | | | | |
| 5,560 % fällig am 20.07.2055 | | 2.550 | 2.298 | 0,77 |
| **Manchester Airport Group Funding PLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 30.09.2044 | | 1.550 | 1.165 | 0,39 |
| **Marks & Spencer PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 19.05.2026 | | 300 | 264 | 0,09 |
| 6,000 % fällig am 12.06.2025 | | 939 | 917 | 0,31 |
| **Meadowhall Finance PLC** | | | | |
| 4,988 % fällig am 12.07.2037 | | 64 | 63 | 0,02 |
| **Metropolitan Housing Trust Ltd.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 28.07.2036 | | 1.700 | 1.323 | 0,44 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | |
| 2,279 % fällig am 15.12.2030 | $ | 739 | 563 | 0,19 |
| 3,282 % fällig am 15.09.2034 | £ | 993 | 798 | 0,27 |
| 5,965 % fällig am 15.12.2025 | | 108 | 109 | 0,04 |
| 6,013 % fällig am 15.12.2030 | | 556 | 567 | 0,19 |
| **Morhomes PLC** | | | | |
| 3,400 % fällig am 19.02.2040 | | 4.400 | 3.983 | 1,33 |
| **Motability Operations Group PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 20.01.2041 | | 800 | 560 | 0,19 |
| 2,125 % fällig am 18.01.2042 | | 2.100 | 1.618 | 0,54 |
| 2,375 % fällig am 03.07.2039 | | 900 | 744 | 0,25 |
| **National Grid Electricity Transmission PLC** | | | | |
| 2,000 % fällig am 16.09.2038 | | 900 | 653 | 0,22 |
| 2,000 % fällig am 17.04.2040 | | 2.008 | 1.417 | 0,47 |
| 2,750 % fällig am 06.02.2035 | | 100 | 84 | 0,03 |
| **National Grid Gas PLC** | | | | |
| 1,125 % fällig am 14.01.2033 | | 200 | 145 | 0,05 |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 2,057 % fällig am 09.11.2028 | | 1.000 | 875 | 0,29 |
| 3,619 % fällig am 29.03.2029 | | 1.200 | 1.126 | 0,38 |
| 4,600 % fällig am 28.06.2031 (b)(c) | $ | 800 | 487 | 0,16 |
| 5,076 % fällig am 27.01.2030 | | 950 | 766 | 0,26 |
| **Northern Electric Finance PLC** | | | | |
| 2,750 % fällig am 24.05.2049 | £ | 450 | 352 | 0,12 |
| **Northern Powergrid Northeast PLC** | | | | |
| 1,875 % fällig am 16.06.2062 | | 100 | 60 | 0,02 |
| 3,250 % fällig am 01.04.2052 | | 400 | 340 | 0,11 |
| **Northern Powergrid Yorkshire PLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 09.10.2059 | | 800 | 534 | 0,18 |
| 5,125 % fällig am 04.05.2035 | | 710 | 779 | 0,26 |
| **Notting Hill Genesis** | | | | |
| 2,000 % fällig am 03.06.2036 | | 1.220 | 966 | 0,32 |
| 3,250 % fällig am 12.10.2048 | | 1.141 | 978 | 0,33 |
| 3,750 % fällig am 20.12.2032 | | 300 | 302 | 0,10 |
| 5,250 % fällig am 07.07.2042 | | 199 | 229 | 0,08 |
| **Pacific Quay Finance PLC** | | | | |
| 5,565 % fällig am 25.07.2034 | | 804 | 917 | 0,31 |
| **Paragon Treasury PLC** | | | | |
| 2,000 % fällig am 07.05.2036 | | 1.300 | 1.037 | 0,35 |
| **Peabody Capital PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 14.09.2048 | | 1.500 | 1.288 | 0,43 |
| **Places for People Homes Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 23.05.2031 | | 700 | 809 | 0,27 |
| **Places for People Treasury PLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 26.01.2036 | | 500 | 414 | 0,14 |
| **Platform HG Financing PLC** | | | | |
| 1,926 % fällig am 15.09.2041 | | 800 | 587 | 0,20 |
| **Prudential PLC** | | | | |
| 6,125 % fällig am 19.12.2031 | | 620 | 649 | 0,22 |
| **RHP Finance PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 05.02.2048 | | 700 | 618 | 0,21 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Riverside Finance PLC** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 05.12.2044 | £ | 400 | £ | 395 | 0,13 |
| **Rolls-Royce PLC** | | | | | |
| 4,625 % fällig am 16.02.2026 | € | 700 | | 568 | 0,19 |
| **Sage Group PLC** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 25.02.2031 | £ | 600 | | 491 | 0,16 |
| 2,875 % fällig am 08.02.2034 | | 700 | | 603 | 0,20 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | | |
| 6,750 % fällig am 24.06.2024 (b)(c) | | 400 | | 386 | 0,13 |
| **Santander UK PLC** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 21.10.2030 | | 100 | | 110 | 0,04 |
| **Scottish Hydro Electric Transmission PLC** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 24.03.2036 | | 1.200 | | 928 | 0,31 |
| **Severn Trent Utilities Finance PLC** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 02.06.2040 | | 1.200 | | 876 | 0,29 |
| 4,875 % fällig am 24.01.2042 | | 600 | | 652 | 0,22 |
| **Society of Lloyd's** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.10.2024 | | 100 | | 99 | 0,03 |
| 4,875 % fällig am 07.02.2047 | | 1.800 | | 1.755 | 0,59 |
| **South Eastern Power Networks PLC** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 30.09.2034 | | 1.500 | | 1.167 | 0,39 |
| **Southern Electric Power Distribution PLC** | | | | | |
| 4,625 % fällig am 20.02.2037 | | 1.000 | | 1.013 | 0,34 |
| **Southern Gas Networks PLC** | | | | | |
| 3,100 % fällig am 15.09.2036 | | 1.600 | | 1.346 | 0,45 |
| **Southern Housing Group Ltd.** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 08.10.2036 | | 1.000 | | 819 | 0,27 |
| 3,500 % fällig am 19.10.2047 | | 1.100 | | 973 | 0,33 |
| **Sovereign Housing Capital PLC** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 04.11.2048 | | 200 | | 151 | 0,05 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | | |
| 4,300 % fällig am 19.08.2028 (b)(c) | $ | 200 | | 121 | 0,04 |
| 4,644 % fällig am 01.04.2031 | | 200 | | 157 | 0,05 |
| 4,750 % fällig am 14.01.2031 (b)(c) | | 300 | | 189 | 0,06 |
| 7,750 % fällig am 02.04.2023 (b)(c) | | 400 | | 326 | 0,11 |
| **Telereal Secured Finance PLC** | | | | | |
| 4,010 % fällig am 10.12.2033 | £ | 1.657 | | 1.656 | 0,55 |
| **Telereal Securitisation PLC** | | | | | |
| 6,165 % fällig am 10.12.2033 | | 87 | | 95 | 0,03 |
| **Tesco Property Finance PLC** | | | | | |
| 5,411 % fällig am 13.07.2044 | | 1.106 | | 1.122 | 0,38 |
| 5,661 % fällig am 13.10.2041 | | 967 | | 1.005 | 0,34 |
| 5,744 % fällig am 13.04.2040 | | 1.498 | | 1.581 | 0,53 |
| 5,801 % fällig am 13.10.2040 | | 1.086 | | 1.148 | 0,38 |
| 6,052 % fällig am 13.10.2039 | | 2.633 | | 2.856 | 0,96 |
| **Thames Water Utilities Finance PLC** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 24.01.2032 | | 300 | | 266 | 0,09 |
| 4,375 % fällig am 03.07.2034 | | 1.800 | | 1.808 | 0,61 |
| 5,500 % fällig am 11.02.2041 | | 200 | | 224 | 0,08 |
| **TP ICAP Finance PLC** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 18.11.2028 | | 2.800 | | 2.308 | 0,77 |
| 5,250 % fällig am 29.05.2026 | | 700 | | 685 | 0,23 |
| **Unique Pub Finance Co. PLC** | | | | | |
| 5,659 % fällig am 30.06.2027 | | 1.194 | | 1.261 | 0,42 |
| 7,395 % fällig am 28.03.2024 | | 794 | | 817 | 0,27 |
| **University of Oxford** | | | | | |
| 2,544 % fällig am 08.12.2117 | | 800 | | 580 | 0,19 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.01.2030 | | 700 | | 566 | 0,19 |
| **Virgin Money UK PLC** | | | | | |
| 3,125 % fällig am 22.06.2025 | | 300 | | 291 | 0,10 |
| 4,000 % fällig am 25.09.2026 | | 900 | | 871 | 0,29 |
| 4,000 % fällig am 03.09.2027 | | 1.235 | | 1.179 | 0,39 |
| 5,125 % fällig am 11.12.2030 | | 200 | | 194 | 0,06 |
| 7,875 % fällig am 14.12.2028 | | 500 | | 514 | 0,17 |
| **Vodafone Group PLC** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 12.08.2056 | | 1.600 | | 1.138 | 0,38 |
| 3,375 % fällig am 08.08.2049 | | 2.400 | | 1.898 | 0,64 |
| **Wellcome Trust Ltd.** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 14.07.2071 | | 3.300 | | 1.860 | 0,62 |
| **Western Power Distribution East Midlands PLC** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 10.12.2040 | | 500 | | 607 | 0,20 |
| **Western Power Distribution South Wales PLC** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 07.10.2035 | | 1.100 | | 799 | 0,27 |
| **Western Power Distribution South West PLC** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 23.03.2040 | | 700 | | 803 | 0,27 |
| **Workspace Group PLC** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 11.03.2028 | £ | 600 | £ | 494 | 0,17 |
| **Yorkshire Housing Finance PLC** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 31.10.2044 | | 700 | | 704 | 0,24 |
| **Yorkshire Water Finance PLC** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 27.10.2032 | | 500 | | 413 | 0,14 |
| | | | | 133.267 | 44,59 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | | |
| **Avon Finance PLC** | | | | | |
| 1,690 % fällig am 20.09.2048 | | 897 | | 893 | 0,30 |
| **Clavis Securities PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.12.2032 | € | 73 | | 60 | 0,02 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 18.06.2038 | | 15 | | 12 | 0,00 |
| 1,743 % fällig am 18.03.2039 | £ | 13 | | 12 | 0,00 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,703 % fällig am 25.05.2053 | | 390 | | 389 | 0,13 |
| **Hops Hill No. 1 PLC** | | | | | |
| 1,922 % fällig am 27.05.2054 | | 445 | | 443 | 0,15 |
| **Mansard Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,529 % fällig am 15.12.2049 | | 175 | | 171 | 0,06 |
| **Mortimer BTL PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 23.03.2054 | | 800 | | 793 | 0,26 |
| 1,492 % fällig am 23.06.2053 | | 1.240 | | 1.202 | 0,40 |
| **Newgate Funding PLC** | | | | | |
| 0,319 % fällig am 15.12.2050 | € | 1.444 | | 1.219 | 0,41 |
| 1,578 % fällig am 01.12.2050 | £ | 70 | | 66 | 0,02 |
| **Polaris PLC** | | | | | |
| 1,730 % fällig am 23.12.2058 | | 755 | | 745 | 0,25 |
| **RMAC PLC** | | | | | |
| 1,571 % fällig am 12.06.2046 | | 926 | | 920 | 0,31 |
| **Silverstone Master Issuer PLC** | | | | | |
| 1,216 % fällig am 21.01.2070 | | 198 | | 198 | 0,07 |
| **Stratton Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2060 | | 805 | | 799 | 0,27 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 1,605 % fällig am 20.10.2051 | | 809 | | 807 | 0,27 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | | |
| 1,602 % fällig am 12.03.2055 | | 919 | | 894 | 0,30 |
| | | | | 9.623 | 3,22 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 22.10.2061 | | 5.000 | | 2.576 | 0,86 |
| 0,875 % fällig am 31.07.2033 | | 2.700 | | 2.308 | 0,77 |
| 1,500 % fällig am 31.07.2053 (d) | | 9.000 | | 6.978 | 2,34 |
| 3,250 % fällig am 22.01.2044 (d)(e) | | 3.300 | | 3.618 | 1,21 |
| 3,500 % fällig am 22.01.2045 | | 5.900 | | 6.738 | 2,26 |
| 4,000 % fällig am 22.01.2060 | | 2.300 | | 3.151 | 1,05 |
| 4,250 % fällig am 07.12.2046 (e) | | 2.600 | | 3.348 | 1,12 |
| | | | | 28.717 | 9,61 |
| Summe Großbritannien | | | | 171.607 | 57,42 |
| **USA** | | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | | |
| 2,029 % fällig am 25.05.2036 | $ | 18 | | 15 | 0,01 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Alexandria Real Estate Equities, Inc.** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 18.05.2032 | | 600 | | 391 | 0,13 |
| **Amgen, Inc.** | | | | | |
| 4,200 % fällig am 22.02.2052 | | 62 | | 45 | 0,01 |
| 4,563 % fällig am 15.06.2048 | | 600 | | 454 | 0,15 |
| **Anheuser-Busch Cos. LLC** | | | | | |
| 4,700 % fällig am 01.02.2036 | | 165 | | 130 | 0,04 |
| 4,900 % fällig am 01.02.2046 | | 500 | | 388 | 0,13 |
| **Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.** | | | | | |
| 4,950 % fällig am 15.01.2042 | | 1.200 | | 942 | 0,32 |
| **Apple, Inc.** | | | | | |
| 3,600 % fällig am 31.07.2042 | £ | 800 | | 797 | 0,27 |
| **AT&T, Inc.** | | | | | |
| 3,550 % fällig am 15.09.2055 | $ | 200 | | 124 | 0,04 |
| 3,650 % fällig am 15.09.2059 | | 120 | | 74 | 0,02 |
| 3,800 % fällig am 01.12.2057 | $ | 904 | £ | 577 | 0,19 |
| 4,250 % fällig am 01.06.2043 | £ | 4.713 | | 4.354 | 1,46 |
| 4,875 % fällig am 01.06.2044 | | 1.738 | | 1.743 | 0,58 |
| 5,200 % fällig am 18.11.2033 | | 850 | | 902 | 0,30 |
| **Bank of America Corp.** | | | | | |
| 2,676 % fällig am 19.06.2041 | $ | 700 | | 416 | 0,14 |
| **Berkshire Hathaway Finance Corp.** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 19.06.2059 | £ | 100 | | 73 | 0,02 |
| **Bristol-Myers Squibb Co.** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.06.2039 | $ | 65 | | 51 | 0,02 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.07.2049 | | 500 | | 342 | 0,11 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | | |
| 3,878 % fällig am 24.01.2039 | | 1.500 | | 1.069 | 0,36 |
| 4,412 % fällig am 31.03.2031 | | 500 | | 394 | 0,13 |
| 4,650 % fällig am 30.07.2045 | | 200 | | 151 | 0,05 |
| 7,375 % fällig am 01.09.2039 | £ | 100 | | 137 | 0,05 |
| **Community Preservation Corp.** | | | | | |
| 2,867 % fällig am 01.02.2030 | $ | 1.300 | | 954 | 0,32 |
| **Digital Stout Holding LLC** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 17.10.2030 | £ | 200 | | 185 | 0,06 |
| **Duke Energy Corp.** | | | | | |
| 3,850 % fällig am 15.06.2034 | € | 600 | | 507 | 0,17 |
| **Eli Lilly & Co.** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 14.09.2043 | £ | 500 | | 353 | 0,12 |
| **Entergy Corp.** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.06.2050 | $ | 57 | | 37 | 0,01 |
| **Fiserv, Inc.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.07.2031 | £ | 900 | | 810 | 0,27 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | | |
| 2,748 % fällig am 14.06.2024 | | 700 | | 647 | 0,22 |
| 4,535 % fällig am 06.03.2025 | | 700 | | 657 | 0,22 |
| **GlaxoSmithKline Capital, Inc.** | | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.05.2038 | $ | 800 | | 788 | 0,26 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | | |
| 3,615 % fällig am 15.03.2028 | | 65 | | 51 | 0,02 |
| 3,625 % fällig am 29.10.2029 | £ | 1.900 | | 1.823 | 0,61 |
| 4,411 % fällig am 23.04.2039 | $ | 800 | | 599 | 0,20 |
| **Home Depot, Inc.** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.09.2056 | | 58 | | 39 | 0,01 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | | |
| 1,895 % fällig am 28.04.2033 | £ | 500 | | 411 | 0,14 |
| 3,882 % fällig am 24.07.2038 | $ | 200 | | 145 | 0,05 |
| 5,600 % fällig am 15.07.2041 | | 300 | | 258 | 0,09 |
| **McDonald's Corp.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 23.04.2032 | £ | 100 | | 116 | 0,04 |
| **Merck & Co., Inc.** | | | | | |
| 2,900 % fällig am 10.12.2061 | $ | 600 | | 352 | 0,12 |
| **Microsoft Corp.** | | | | | |
| 2,525 % fällig am 01.06.2050 | | 100 | | 61 | 0,02 |
| 2,675 % fällig am 01.06.2060 | | 600 | | 355 | 0,12 |
| **MidAmerican Energy Co.** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.07.2049 | | 64 | | 49 | 0,02 |
| **Mondelez International, Inc.** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 06.03.2045 | £ | 100 | | 94 | 0,03 |
| **MPT Operating Partnership LP** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 24.04.2030 | | 2.000 | | 1.605 | 0,54 |
| 3,692 % fällig am 05.06.2028 | | 1.250 | | 1.085 | 0,36 |
| **National Fuel Gas Co.** | | | | | |
| 2,950 % fällig am 01.03.2031 | $ | 159 | | 106 | 0,04 |
| **Nestle Holdings, Inc.** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 04.04.2032 | £ | 1.300 | | 1.208 | 0,40 |
| **Netflix, Inc.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.06.2030 | € | 600 | | 448 | 0,15 |
| **Northern States Power Co.** | | | | | |
| 2,900 % fällig am 01.03.2050 | $ | 300 | | 186 | 0,06 |
| **Pfizer, Inc.** | | | | | |
| 2,735 % fällig am 15.06.2043 | £ | 1.400 | | 1.194 | 0,40 |
| **Realty Income Corp.** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 13.07.2033 | | 1.100 | | 851 | 0,28 |
| 2,500 % fällig am 14.01.2042 | | 500 | | 364 | 0,12 |
| **Time Warner Cable LLC** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.09.2042 | $ | 500 | | 322 | 0,11 |
| 5,250 % fällig am 15.07.2042 | £ | 2.236 | | 2.065 | 0,69 |
| **United Airlines Pass-Through Trust** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.04.2029 | $ | 932 | | 755 | 0,25 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Verizon Communications, Inc.** | | | |
| 1,875 % fällig am 03.11.2038 | £ 1.500 | £ 1.066 | 0,36 |
| 3,375 % fällig am 27.10.2036 | 2.800 | 2.503 | 0,84 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | |
| 2,125 % fällig am 24.09.2031 | 100 | 83 | 0,03 |
| 4,625 % fällig am 02.11.2035 | 879 | 886 | 0,30 |
| 4,875 % fällig am 29.11.2035 | 800 | 761 | 0,25 |
| | | 38.333 | 12,82 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | |
| **Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,124 % fällig am 25.04.2035 | $ 167 | 129 | 0,05 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,933 % fällig am 25.09.2035 | $ 1 | £ 1 | 0,00 |
| **Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 1,764 % fällig am 15.12.2030 | 4 | 3 | 0,00 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | |
| 2,901 % fällig am 20.07.2037 ^ | 8 | 5 | 0,00 |
| | | 138 | 0,05 |
| Summe USA | | 38.486 | 12,88 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | **£ 284.837** | **95,31** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 189.000 | U.S. Treasury Notes 3,000% fällig am 30.06.2024 | £ (159) | £ 156 | £ 156 | 0,05 |
| RYL | 0,900 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | £ 2.500 | United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 31.07.2033 | (2.567) | 2.500 | 2.500 | 0,84 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **£ (2.726)** | **£ 2.656** | **£ 2.656** | **0,89** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 63 | £ 234 | 0,08 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 1 | 6 | 0,00 |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 6 | (24) | (0,01) |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 42 | 43 | 0,01 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 26 | (13) | 0,00 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 35 | 13 | 0,01 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Long | 09.2022 | 435 | (1.305) | (0,44) |
| | | | | £ (1.046) | (0,35) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **£ (1.046)** | **(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 | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| British Telecommunications PLC | 1,000 % | 20.06.2028 | € 300 | £ (9) | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.12.2028 | 600 | (17) | (0,01) |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.12.2024 | 2.600 | 128 | 0,04 |
| | | | | £ 102 | 0,03 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Europe Main 37 10-Year Index | 1,000 % | 20.06.2027 | € 24.600 | £ (254) | (0,08) |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabel Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 % | 21.09.2024 | £ 5.200 | £ (57) | (0,02) |
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 | 21.09.2027 | 14.600 | 360 | 0,12 |
| Zahlung[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2032 | 12.100 | (676) | (0,23) |
| Zahlung[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2052 | 21.700 | (3.201) | (1,07) |
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 1,013 | 20.03.2024 | 25.800 | 213 | 0,07 |
| Zahlung | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 | 15.12.2026 | $ 2.300 | (139) | (0,05) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,000 | 16.12.2030 | 3.700 | 435 | 0,15 |

| Zahlung/ Erhalt variabel Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 % | 16.12.2050 | $ 100 | £ 24 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 18.12.2029 | 6.400 | 861 | 0,29 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,625 | 16.01.2050 | 100 | 29 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 | 21.06.2047 | 1.300 | 373 | 0,13 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 | 18.12.2049 | 400 | 117 | 0,04 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 12.02.2045 | 6.600 | 1.846 | 0,62 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2027 | € 7.000 | 191 | 0,06 |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 21.09.2032 | 4.000 | (357) | (0,12) |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 15.09.2036 | 1.300 | 244 | 0,08 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2024 | 4.300 | 77 | 0,03 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 21.09.2052 | 2.800 | 581 | 0,19 |
| | | | | | £ 921 | 0,31 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **£ 769** | **0,26** |

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

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

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

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

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

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC iTraxx Crossover 36 5-Year Index | Verkauf | 5,250 % | 20.07.2022 | 500 | £ (4) | £ (8) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 2.200 | (8) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 2.700 | (6) | (7) | 0,00 |
| BRC | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 500 | (4) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 10.200 | (34) | (18) | (0,01) |
| JPM | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 1.100 | (8) | (10) | (0,01) |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,100 | 20.07.2022 | 1.900 | (5) | (6) | 0,00 |
| | | | | | | £ (69) | £ (58) | (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 | Nenn-betrag[2] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPM | Hochtief AG | 5,000 % | 20.12.2026 | € 500 | £ 86 | £ (48) | £ 38 | 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 | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 08.2022 | £ 1.205 | € 1.400 | £ 3 | £ 0 | £ 3 | 0,00 |
| BRC | 08.2022 | 692 | 806 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | 1.046 | $ 1.280 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| DUB | 08.2022 | $ 34.735 | £ 28.158 | 0 | (422) | (422) | (0,14) |
| JPM | 08.2022 | € 36.618 | 31.506 | 0 | (85) | (85) | (0,03) |
| | 08.2022 | £ 436 | $ 546 | 14 | 0 | 14 | 0,01 |
| | 08.2022 | $ 10 | CNH 67 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 08.2022 | € 601 | £ 517 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | £ 2.140 | € 2.491 | 10 | (1) | 9 | 0,00 |
| | 08.2022 | 1.164 | $ 1.418 | 5 | (2) | 3 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 3.751 | £ 3.005 | 0 | (81) | (81) | (0,03) |
| MYI | 08.2022 | € 1.080 | 919 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 08.2022 | £ 3.280 | € 3.788 | 9 | (21) | (12) | 0,00 |
| | 08.2022 | 5.256 | $ 6.381 | 3 | (9) | (6) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 556 | £ 442 | 0 | (16) | (16) | (0,01) |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| RBC | 08.2022 | £ 839 | $ 1.023 | £ 4 | £ (2) | £ 2 | 0,00 |
| SCX | 08.2022 | 3.994 | € 4.668 | 34 | 0 | 34 | 0,01 |
| SOG | 08.2022 | 273 | 316 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 635 | £ 516 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | | | | £ 92 | £ (659) | £ (567) | (0,19) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **£ (587)** | **(0,20)** |
| **Summe Anlagen** | | | | | | **£ 286.629** | **95,91** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | | | | | **£ 12.227** | **4,09** |
| **Nettovermögen** | | | | | | **£ 298.856** | **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) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar**

**(c) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(d) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 1.742 als Sicherheiten verpfändet.**

**(e) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 528 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von GBP 7.065 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | £ 284.837 | £ 0 | £ 284.837 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 2.656 | 0 | 2.656 |
| Finanzderivate[3] | (1.089) | 225 | 0 | (864) |
| **Summen** | **£ (1.089)** | **£ 287.718** | **£ 0** | **£ 286.629** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | £ 0 | £ 403.042 | £ 0 | £ 403.042 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 442 | 0 | 442 |
| Finanzderivate[3] | 175 | 2.439 | 0 | 2.614 |
| **Summen** | **£ 175** | **£ 405.923** | **£ 0** | **£ 406.098** |

(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 2022:**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| CEW | 1,330 % | 21.06.2022 | 09.08.2022 | £ (1.401) | £ (1.401) | (0,47) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **£ (1.401)** | **(0,47)** |

**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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | £ (19) | £ 18 | £ (1) |
| BPS | 3 | 0 | 3 |
| BRC | (13) | 0 | (13) |

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| DUB | £ (422) | £ 510 | £ 88 |
| JPM | (49) | 0 | (49) |
| MBC | (70) | 0 | (70) |
| MYI | (47) | 0 | (47) |
| RBC | 2 | 0 | 2 |
| SCX | 34 | 0 | 34 |
| SOG | (6) | 0 | (6) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 93,16 | 91,80 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 2,15 | 2,87 |
| Pensionsgeschäfte | 0,89 | 0,10 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,35) | 0,03 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,26 | 0,44 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (0,20) | 0,14 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (0,47) | (0,12) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Australien | k. A. | 0,28 |
| Österreich | k. A. | 0,02 |
| Belgien | 0,73 | 0,69 |
| Bermuda | k. A. | 0,21 |
| Brasilien | k. A. | 0,11 |
| Cayman-Inseln | k. A. | 0,47 |
| Dänemark | 0,22 | 0,08 |
| Finnland | k. A. | 0,14 |
| Frankreich | 3,93 | 5,34 |
| Deutschland | 2,24 | 2,11 |
| Guernsey, Kanalinseln | k. A. | 0,04 |
| Hongkong | k. A. | 0,03 |
| Indien | 0,05 | 0,04 |
| Irland | 1,97 | 1,70 |
| Italien | 1,10 | 1,61 |
| Japan | k. A. | 0,03 |
| Jersey, Kanalinseln | 3,72 | 3,61 |
| Luxemburg | 1,48 | 1,80 |
| Mauritius | 0,09 | 0,16 |
| Mexiko | 0,16 | 0,18 |
| Niederlande | 5,64 | 6,16 |
| Norwegen | 0,33 | 0,10 |
| Singapur | 0,42 | 0,45 |
| Spanien | 0,29 | 0,54 |
| Supranational | 1,06 | 1,04 |
| Schweden | 0,19 | 0,14 |
| Schweiz | 1,39 | 1,23 |
| Großbritannien | 57,42 | 52,21 |
| Vereinigte Staaten | 12,88 | 14,15 |
| Pensionsgeschäfte | 0,89 | 0,10 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,35) | 0,03 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,03 | 0,05 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | (0,08) | 0,00 |
| Zinsswaps | 0,31 | 0,39 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,02) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,01 | 0,02 |
| Devisenterminkontrakte | (0,19) | 0,12 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 4,09 | 4,62 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | |
| **Heartland Dental LLC** | | | |
| 5,166 % fällig am 30.04.2025 | $ 6.384 | $ 5.945 | 0,24 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | |
| 4,920 % fällig am 01.02.2029 | 3.173 | 2.911 | 0,12 |
| **Serta Simmons Bedding LLC** | | | |
| 4,563 % - 4,714 % fällig am 08.11.2023 | 3.126 | 866 | 0,03 |
| **Team Health Holdings, Inc.** | | | |
| 4,416 % fällig am 06.02.2024 | 8.850 | 7.905 | 0,32 |
| **Triton Water Holdings, Inc.** | | | |
| 5,750 % fällig am 31.03.2028 | 2.475 | 2.211 | 0,09 |
| **Welbilt, Inc.** | | | |
| 4,166 % fällig am 23.10.2025 | 2.510 | 2.479 | 0,10 |
| | | 22.317 | 0,90 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | |
| **Acrisure LLC** | | | |
| 6,000 % fällig am 01.08.2029 | 4.000 | 3.137 | 0,13 |
| **Alliant Holdings Intermediate LLC** | | | |
| 4,250 % fällig am 15.10.2027 | 5.000 | 4.335 | 0,18 |
| 6,750 % fällig am 15.10.2027 | 7.000 | 6.230 | 0,25 |
| **Allied Universal Holdco LLC** | | | |
| 4,625 % fällig am 01.06.2028 | 3.000 | 2.483 | 0,10 |
| 6,000 % fällig am 01.06.2029 | 9.000 | 6.562 | 0,26 |
| 6,625 % fällig am 15.07.2026 | 2.000 | 1.839 | 0,07 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | |
| 8,000 % fällig am 01.11.2031 (i) | 2.900 | 3.215 | 0,13 |
| **Armor Holdco, Inc.** | | | |
| 8,500 % fällig am 15.11.2029 | 9.000 | 7.453 | 0,30 |
| **BroadStreet Partners, Inc.** | | | |
| 5,875 % fällig am 15.04.2029 | 10.000 | 7.840 | 0,32 |
| **Curo Group Holdings Corp.** | | | |
| 7,500 % fällig am 01.08.2028 | 7.000 | 4.413 | 0,18 |
| **Diversified Healthcare Trust** | | | |
| 4,375 % fällig am 01.03.2031 | 2.500 | 1.703 | 0,07 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | |
| 2,900 % fällig am 16.02.2028 | 5.000 | 4.037 | 0,16 |
| 2,900 % fällig am 10.02.2029 | 8.000 | 6.286 | 0,25 |
| 3,375 % fällig am 13.11.2025 | 5.000 | 4.518 | 0,18 |
| 3,664 % fällig am 08.09.2024 | 5.000 | 4.737 | 0,19 |
| 4,000 % fällig am 13.11.2030 | 7.500 | 6.092 | 0,25 |
| 4,125 % fällig am 17.08.2027 | 5.000 | 4.417 | 0,18 |
| 4,134 % fällig am 04.08.2025 | 5.500 | 5.225 | 0,21 |
| 4,542 % fällig am 01.08.2026 | 2.000 | 1.834 | 0,07 |
| 5,113 % fällig am 03.05.2029 | 3.000 | 2.696 | 0,11 |
| 5,125 % fällig am 16.06.2025 | 4.000 | 3.828 | 0,15 |
| **Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC** | | | |
| 5,500 % fällig am 01.05.2028 | 3.000 | 2.485 | 0,10 |
| 6,500 % fällig am 01.10.2025 | 7.000 | 6.618 | 0,27 |
| **Getty Images, Inc.** | | | |
| 9,750 % fällig am 01.03.2027 | 8.250 | 7.848 | 0,32 |
| **Greystar Real Estate Partners LLC** | | | |
| 5,750 % fällig am 01.12.2025 | 2.000 | 1.896 | 0,08 |
| **HAT Holdings LLC** | | | |
| 3,750 % fällig am 15.09.2030 | 3.750 | 2.998 | 0,12 |
| **Howard Hughes Corp.** | | | |
| 4,125 % fällig am 01.02.2029 | 4.000 | 3.092 | 0,12 |
| 4,375 % fällig am 01.02.2031 | 2.750 | 2.040 | 0,08 |
| 5,375 % fällig am 01.08.2028 | 3.000 | 2.519 | 0,10 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | |
| 5,710 % fällig am 15.01.2026 | 3.000 | 2.862 | 0,12 |
| 7,700 % fällig am 17.09.2025 (e)(g) | 4.000 | 3.613 | 0,15 |
| **Midcap Financial Issuer Trust** | | | |
| 5,625 % fällig am 15.01.2030 | 2.500 | 1.955 | 0,08 |
| 6,500 % fällig am 01.05.2028 | 4.000 | 3.451 | 0,14 |
| **MPT Operating Partnership LP** | | | |
| 3,500 % fällig am 15.03.2031 | 6.000 | 4.747 | 0,19 |
| **Nationstar Mortgage Holdings, Inc.** | | | |
| 5,125 % fällig am 15.12.2030 | 5.000 | 3.744 | 0,15 |
| **NCL Finance Ltd.** | | | |
| 6,125 % fällig am 15.03.2028 | 2.000 | 1.458 | 0,06 |
| **OneMain Finance Corp.** | | | |
| 3,500 % fällig am 15.01.2027 | $ 4.000 | $ 3.206 | 0,13 |
| 4,000 % fällig am 15.09.2030 | 3.000 | 2.228 | 0,09 |
| 5,375 % fällig am 15.11.2029 | 3.000 | 2.437 | 0,10 |
| 6,625 % fällig am 15.01.2028 | 1.500 | 1.343 | 0,05 |
| 6,875 % fällig am 15.03.2025 | 2.000 | 1.899 | 0,08 |
| 7,125 % fällig am 15.03.2026 | 4.000 | 3.706 | 0,15 |
| **Park Intermediate Holdings LLC** | | | |
| 4,875 % fällig am 15.05.2029 | 2.000 | 1.721 | 0,07 |
| 5,875 % fällig am 01.10.2028 | 4.000 | 3.657 | 0,15 |
| **PennyMac Financial Services, Inc.** | | | |
| 5,375 % fällig am 15.10.2025 | 4.000 | 3.492 | 0,14 |
| 5,750 % fällig am 15.09.2031 | 4.000 | 2.991 | 0,12 |
| **Rocket Mortgage LLC** | | | |
| 3,625 % fällig am 01.03.2029 | 1.000 | 788 | 0,03 |
| 3,875 % fällig am 01.03.2031 | 2.000 | 1.504 | 0,06 |
| 4,000 % fällig am 15.10.2033 | 2.000 | 1.424 | 0,06 |
| **SBA Communications Corp.** | | | |
| 3,125 % fällig am 01.02.2029 | 10.000 | 8.209 | 0,33 |
| **USI, Inc.** | | | |
| 6,875 % fällig am 01.05.2025 | 10.000 | 9.664 | 0,39 |
| **Voyager Aviation Holdings LLC** | | | |
| 8,500 % fällig am 09.05.2026 | 1.805 | 1.615 | 0,07 |
| | | 194.090 | 7,84 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| **24 Hour Fitness Worldwide, Inc.** | | | |
| 8,000 % fällig am 01.06.2022 ^ | 9.500 | 24 | 0,00 |
| **Academy Ltd.** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.11.2027 | 4.000 | 3.662 | 0,15 |
| **AdaptHealth LLC** | | | |
| 6,125 % fällig am 01.08.2028 | 3.000 | 2.658 | 0,11 |
| **Adient Global Holdings Ltd.** | | | |
| 4,875 % fällig am 15.08.2026 | 4.000 | 3.516 | 0,14 |
| **ADT Security Corp.** | | | |
| 4,875 % fällig am 15.07.2032 | 5.000 | 3.990 | 0,16 |
| **Advantage Sales & Marketing, Inc.** | | | |
| 6,500 % fällig am 15.11.2028 | 5.000 | 4.296 | 0,17 |
| **Ahead DB Holdings LLC** | | | |
| 6,625 % fällig am 01.05.2028 | 10.000 | 8.305 | 0,34 |
| **Ahlstrom-Munksjo Holding Oy** | | | |
| 4,875 % fällig am 04.02.2028 | 4.000 | 3.369 | 0,14 |
| **Air Canada** | | | |
| 3,875 % fällig am 15.08.2026 | 2.500 | 2.120 | 0,09 |
| 4,625 % fällig am 15.08.2029 CAD | 2.750 | 1.817 | 0,07 |
| **Albertsons Cos., Inc.** | | | |
| 3,500 % fällig am 15.03.2029 $ | 4.000 | 3.249 | 0,13 |
| 4,625 % fällig am 15.01.2027 | 3.000 | 2.686 | 0,11 |
| 5,875 % fällig am 15.02.2028 | 2.500 | 2.341 | 0,09 |
| **Albion Financing SARL** | | | |
| 6,125 % fällig am 15.10.2026 | 4.625 | 3.966 | 0,16 |
| **Allison Transmission, Inc.** | | | |
| 3,750 % fällig am 30.01.2031 | 5.000 | 4.016 | 0,16 |
| **Altice Financing S.A.** | | | |
| 4,250 % fällig am 15.08.2029 € | 2.000 | 1.584 | 0,06 |
| 5,000 % fällig am 15.01.2028 $ | 4.000 | 3.234 | 0,13 |
| 5,750 % fällig am 15.08.2029 | 3.000 | 2.416 | 0,10 |
| **Altice France Holding S.A.** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.02.2028 | 10.000 | 7.117 | 0,29 |
| 10,500 % fällig am 15.05.2027 | 3.000 | 2.523 | 0,10 |
| **Altice France S.A.** | | | |
| 5,125 % fällig am 15.07.2029 | 5.000 | 3.791 | 0,15 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2028 | 4.000 | 3.234 | 0,13 |
| 5,500 % fällig am 15.10.2029 | 3.000 | 2.301 | 0,09 |
| **AMC Networks, Inc.** | | | |
| 4,250 % fällig am 15.02.2029 | 5.125 | 4.168 | 0,17 |
| **American Airlines Pass-Through Trust** | | | |
| 3,150 % fällig am 15.08.2033 (i) | 1.779 | 1.577 | 0,06 |
| 3,375 % fällig am 01.11.2028 | 2.279 | 2.047 | 0,08 |
| 3,650 % fällig am 15.08.2030 (i) | 758 | 708 | 0,03 |
| **American Airlines, Inc.** | | | |
| 5,500 % fällig am 20.04.2026 | 5.000 | 4.612 | 0,19 |
| 5,750 % fällig am 20.04.2029 | 10.000 | 8.572 | 0,35 |
| **Antero Resources Corp.** | | | |
| 5,375 % fällig am 01.03.2030 | 2.500 | 2.284 | 0,09 |
| **Apache Corp.** | | | |
| 4,875 % fällig am 15.11.2027 $ | 4.000 | $ 3.690 | 0,15 |
| **APi Escrow Corp.** | | | |
| 4,750 % fällig am 15.10.2029 | 4.000 | 3.236 | 0,13 |
| **Arches Buyer, Inc.** | | | |
| 4,250 % fällig am 01.06.2028 | 3.500 | 2.860 | 0,12 |
| 6,125 % fällig am 01.12.2028 | 8.000 | 6.536 | 0,26 |
| **Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC** | | | |
| 3,250 % fällig am 01.09.2028 | 2.000 | 1.710 | 0,07 |
| 4,000 % fällig am 01.09.2029 | 4.000 | 3.222 | 0,13 |
| **Ascent Resources Utica Holdings LLC** | | | |
| 5,875 % fällig am 30.06.2029 | 2.500 | 2.204 | 0,09 |
| 8,250 % fällig am 31.12.2028 | 1.750 | 1.669 | 0,07 |
| **ASP Unifrax Holdings, Inc.** | | | |
| 5,250 % fällig am 30.09.2028 | 2.000 | 1.600 | 0,06 |
| 7,500 % fällig am 30.09.2029 | 2.500 | 1.740 | 0,07 |
| **At Home Group, Inc.** | | | |
| 4,875 % fällig am 15.07.2028 | 1.500 | 1.090 | 0,04 |
| 7,125 % fällig am 15.07.2029 | 5.000 | 2.846 | 0,11 |
| **Atlantia SpA** | | | |
| 1,875 % fällig am 12.02.2028 € | 8.750 | 7.145 | 0,29 |
| **Audacy Capital Corp.** | | | |
| 6,750 % fällig am 31.03.2029 $ | 3.000 | 1.602 | 0,06 |
| **Avantor Funding, Inc.** | | | |
| 4,625 % fällig am 15.07.2028 | 7.000 | 6.435 | 0,26 |
| **Axalta Coating Systems LLC** | | | |
| 3,375 % fällig am 15.02.2029 | 5.000 | 4.088 | 0,17 |
| **B.C. Unlimited Liability Co.** | | | |
| 3,500 % fällig am 15.02.2029 | 2.250 | 1.909 | 0,08 |
| 3,875 % fällig am 15.01.2028 | 2.000 | 1.740 | 0,07 |
| 4,000 % fällig am 15.10.2030 | 8.250 | 6.647 | 0,27 |
| 4,375 % fällig am 15.01.2028 | 2.000 | 1.752 | 0,07 |
| **Ball Corp.** | | | |
| 2,875 % fällig am 15.08.2030 | 5.000 | 4.036 | 0,16 |
| **Bath & Body Works, Inc.** | | | |
| 6,625 % fällig am 01.10.2030 | 3.000 | 2.599 | 0,10 |
| 6,875 % fällig am 01.11.2035 | 6.500 | 5.301 | 0,21 |
| 6,950 % fällig am 01.03.2033 | 6.750 | 5.401 | 0,22 |
| 9,375 % fällig am 01.07.2025 | 1.438 | 1.461 | 0,06 |
| **Bausch Health Cos., Inc.** | | | |
| 4,875 % fällig am 01.06.2028 | 2.000 | 1.569 | 0,06 |
| 5,000 % fällig am 30.01.2028 | 3.000 | 1.606 | 0,06 |
| 5,250 % fällig am 30.01.2030 | 4.000 | 2.078 | 0,08 |
| 5,250 % fällig am 15.02.2031 | 4.000 | 2.059 | 0,08 |
| 5,500 % fällig am 01.11.2025 | 5.000 | 4.400 | 0,18 |
| 5,750 % fällig am 15.08.2027 | 1.000 | 830 | 0,03 |
| 6,250 % fällig am 15.02.2029 | 5.000 | 2.675 | 0,11 |
| 7,000 % fällig am 15.01.2028 | 3.000 | 1.721 | 0,07 |
| 9,000 % fällig am 15.12.2025 | 1.000 | 742 | 0,03 |
| **BCPE Empire Holdings, Inc.** | | | |
| 7,625 % fällig am 01.05.2027 | 14.000 | 11.417 | 0,46 |
| **BCPE Ulysses Intermediate, Inc. (7,750 % bar oder 8,500 % PIK)** | | | |
| 7,750 % fällig am 01.04.2027 (a) | 5.000 | 3.082 | 0,12 |
| **Bellis Acquisition Co. PLC** | | | |
| 3,250 % fällig am 16.02.2026 £ | 5.000 | 4.736 | 0,19 |
| **Bellis Finco PLC** | | | |
| 4,000 % fällig am 16.02.2027 | 1.400 | 1.181 | 0,05 |
| **BellRing Brands, Inc.** | | | |
| 7,000 % fällig am 15.03.2030 $ | 2.000 | 1.888 | 0,08 |
| **Black Knight InfoServ LLC** | | | |
| 3,625 % fällig am 01.09.2028 | 3.000 | 2.603 | 0,11 |
| **Block, Inc.** | | | |
| 2,750 % fällig am 01.06.2026 | 1.000 | 890 | 0,04 |
| 3,500 % fällig am 01.06.2031 | 5.000 | 3.995 | 0,16 |
| **Bombardier, Inc.** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.02.2028 | 5.000 | 3.755 | 0,15 |
| 7,125 % fällig am 15.06.2026 | 6.500 | 5.380 | 0,22 |
| 7,500 % fällig am 15.03.2025 | 1.977 | 1.792 | 0,07 |
| 7,875 % fällig am 15.04.2027 | 6.000 | 5.010 | 0,20 |
| **Boxer Parent Co., Inc.** | | | |
| 6,500 % fällig am 02.10.2025 € | 2.000 | 1.969 | 0,08 |
| **Boyne USA, Inc.** | | | |
| 4,750 % fällig am 15.05.2029 $ | 2.500 | 2.169 | 0,09 |
| **Buckeye Partners LP** | | | |
| 4,125 % fällig am 01.03.2025 | 2.000 | 1.854 | 0,07 |
| 4,500 % fällig am 01.03.2028 | 2.000 | 1.687 | 0,07 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Builders FirstSource, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.03.2030 | $ | 7.000 | $ 5.941 | 0,24 |
| **CAB SELAS** | | | | |
| 3,375 % fällig am 01.02.2028 | € | 5.000 | 4.217 | 0,17 |
| **Cable One, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.11.2030 | $ | 2.000 | 1.646 | 0,07 |
| **Cablevision Lightpath LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.09.2028 | | 5.000 | 3.918 | 0,16 |
| **Caesars Entertainment, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.10.2029 | | 10.000 | 7.802 | 0,32 |
| 8,125 % fällig am 01.07.2027 | | 4.000 | 3.873 | 0,16 |
| **Callon Petroleum Co.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.06.2030 | | 2.500 | 2.304 | 0,09 |
| **Cargo Aircraft Management, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.02.2028 | | 4.000 | 3.654 | 0,15 |
| **Carnival Corp.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2028 | | 5.000 | 4.118 | 0,17 |
| 5,750 % fällig am 01.03.2027 | | 7.000 | 5.080 | 0,21 |
| 6,000 % fällig am 01.05.2029 | | 4.000 | 2.824 | 0,11 |
| 7,625 % fällig am 01.03.2026 | | 5.000 | 3.884 | 0,16 |
| **Carnival PLC** | | | | |
| 1,000 % fällig am 28.10.2029 | € | 7.500 | 4.444 | 0,18 |
| **Carvana Co.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.09.2029 | $ | 3.500 | 1.995 | 0,08 |
| 5,500 % fällig am 15.04.2027 | | 2.000 | 1.293 | 0,05 |
| **Catalent Pharma Solutions, Inc.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 01.03.2028 | € | 2.000 | 1.715 | 0,07 |
| 3,125 % fällig am 15.02.2029 | $ | 5.000 | 4.109 | 0,17 |
| **CCO Holdings LLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.02.2031 | | 10.000 | 8.178 | 0,33 |
| 4,250 % fällig am 15.01.2034 | | 5.000 | 3.880 | 0,16 |
| 4,500 % fällig am 15.08.2030 | | 10.000 | 8.335 | 0,34 |
| 4,500 % fällig am 01.05.2032 | | 10.000 | 8.131 | 0,33 |
| 4,500 % fällig am 01.06.2033 | | 11.750 | 9.285 | 0,38 |
| 4,750 % fällig am 01.03.2030 | | 5.000 | 4.292 | 0,17 |
| 5,000 % fällig am 01.02.2028 | | 2.000 | 1.852 | 0,07 |
| 5,375 % fällig am 01.06.2029 | | 4.000 | 3.584 | 0,14 |
| **CDI Escrow Issuer, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.04.2030 | | 3.500 | 3.192 | 0,13 |
| **Centene Corp.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.03.2031 | | 4.000 | 3.188 | 0,13 |
| 2,625 % fällig am 01.08.2031 | | 2.000 | 1.595 | 0,06 |
| 3,375 % fällig am 15.02.2030 | | 4.000 | 3.404 | 0,14 |
| 4,625 % fällig am 15.12.2029 | | 2.000 | 1.871 | 0,08 |
| **Centennial Resource Production LLC** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.01.2026 | | 5.000 | 4.525 | 0,18 |
| **Central Garden & Pet Co.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.10.2030 | | 5.000 | 4.109 | 0,17 |
| 4,125 % fällig am 30.04.2031 | | 5.000 | 4.022 | 0,16 |
| **Charles River Laboratories International, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.03.2029 | | 5.000 | 4.348 | 0,18 |
| 4,000 % fällig am 15.03.2031 | | 6.250 | 5.340 | 0,22 |
| **Cheniere Energy Partners LP** | | | | |
| 3,250 % fällig am 31.01.2032 | | 4.000 | 3.159 | 0,13 |
| 4,000 % fällig am 01.03.2031 | | 7.500 | 6.395 | 0,26 |
| 4,500 % fällig am 01.10.2029 | | 2.000 | 1.789 | 0,07 |
| **Cheniere Energy, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.10.2028 | | 3.000 | 2.711 | 0,11 |
| **Chesapeake Energy Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.02.2029 | | 950 | 898 | 0,04 |
| 6,750 % fällig am 15.04.2029 | | 8.500 | 8.245 | 0,33 |
| **Chobani LLC** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.11.2028 | | 2.500 | 2.116 | 0,09 |
| 7,500 % fällig am 15.04.2025 | | 8.500 | 7.821 | 0,32 |
| **Churchill Downs, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.01.2028 | | 5.000 | 4.459 | 0,18 |
| **Clarios Global LP** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.05.2026 | € | 5.000 | 4.584 | 0,19 |
| 6,250 % fällig am 15.05.2026 | $ | 2.700 | 2.603 | 0,11 |
| 6,750 % fällig am 15.05.2025 | | 1.575 | 1.562 | 0,06 |
| 8,500 % fällig am 15.05.2027 | | 5.000 | 4.843 | 0,20 |
| **Clarivate Science Holdings Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.07.2029 | | 6.000 | 4.944 | 0,20 |
| **Clear Channel International BV** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.08.2025 | | 2.000 | 1.863 | 0,08 |
| **Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.08.2027 | | 3.000 | 2.541 | 0,10 |
| 7,750 % fällig am 15.04.2028 | | 5.000 | 3.651 | 0,15 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Clearwater Paper Corp.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.08.2028 | $ | 2.000 | $ 1.728 | 0,07 |
| 5,375 % fällig am 01.02.2025 | | 1.500 | 1.461 | 0,06 |
| **Clydesdale Acquisition Holdings, Inc.** | | | | |
| 8,750 % fällig am 15.04.2030 | | 10.000 | 8.653 | 0,35 |
| **CommScope Technologies LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2027 | | 5.000 | 3.703 | 0,15 |
| 6,000 % fällig am 15.06.2025 | | 3.250 | 2.818 | 0,11 |
| **CommScope, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.09.2029 | | 4.500 | 3.643 | 0,15 |
| 6,000 % fällig am 01.03.2026 | | 3.250 | 3.000 | 0,12 |
| 7,125 % fällig am 01.07.2028 | | 10.000 | 7.615 | 0,31 |
| 8,250 % fällig am 01.03.2027 | | 4.575 | 3.628 | 0,15 |
| **Community Health Systems, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.02.2031 | | 5.000 | 3.674 | 0,15 |
| 5,250 % fällig am 15.05.2030 | | 3.000 | 2.285 | 0,09 |
| 5,625 % fällig am 15.03.2027 | | 5.000 | 4.245 | 0,17 |
| 6,125 % fällig am 01.04.2030 | | 8.750 | 5.360 | 0,22 |
| 6,875 % fällig am 01.04.2028 | | 7.500 | 4.407 | 0,18 |
| 6,875 % fällig am 15.04.2029 | | 12.000 | 7.775 | 0,31 |
| **Comstock Resources, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.01.2030 (i) | | 2.500 | 2.157 | 0,09 |
| 6,750 % fällig am 01.03.2029 | | 5.000 | 4.488 | 0,18 |
| **Condor Merger Sub, Inc.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 15.02.2030 | | 15.000 | 12.236 | 0,49 |
| **Connect Finco SARL** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.10.2026 | | 3.000 | 2.706 | 0,11 |
| **Consolidated Communications, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.10.2028 | | 2.000 | 1.602 | 0,06 |
| **Cornerstone Building Brands, Inc.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.01.2029 | | 7.500 | 4.827 | 0,20 |
| **Coty, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.04.2026 | € | 4.100 | 3.803 | 0,15 |
| 5,000 % fällig am 15.04.2026 | $ | 4.000 | 3.672 | 0,15 |
| 6,500 % fällig am 15.04.2026 (i) | | 5.000 | 4.617 | 0,19 |
| **Covanta Holding Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.12.2029 | | 750 | 611 | 0,02 |
| 5,000 % fällig am 01.09.2030 | | 1.000 | 818 | 0,03 |
| **Crocs, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.03.2029 | | 3.625 | 2.687 | 0,11 |
| **CSC Holdings LLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.02.2031 | | 4.000 | 2.969 | 0,12 |
| 4,125 % fällig am 01.12.2030 | | 2.500 | 1.957 | 0,08 |
| 4,625 % fällig am 01.12.2030 | | 4.000 | 2.687 | 0,11 |
| 5,750 % fällig am 15.01.2030 | | 7.000 | 5.112 | 0,21 |
| 6,500 % fällig am 01.02.2029 | | 2.500 | 2.263 | 0,09 |
| **Ctec GmbH** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.02.2030 | € | 5.000 | 3.809 | 0,15 |
| **DaVita, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.02.2031 | $ | 7.500 | 5.397 | 0,22 |
| 4,625 % fällig am 01.06.2030 | | 10.000 | 7.830 | 0,32 |
| **DCP Midstream Operating LP** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.02.2032 | | 5.000 | 3.931 | 0,16 |
| 5,375 % fällig am 15.07.2025 | | 1.000 | 974 | 0,04 |
| **Dealer Tire LLC** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.02.2028 | | 5.000 | 4.326 | 0,17 |
| **Deluxe Corp.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.06.2029 | | 8.500 | 6.941 | 0,28 |
| **Diamond BC BV** | | | | |
| 4,625 % fällig am 01.10.2029 | | 10.000 | 8.011 | 0,32 |
| **Diamond Foreign Asset Co. (9,000 % bar oder 9,000 % PIK)** | | | | |
| 9,000 % fällig am 22.04.2027 (a)(h) | | 115 | 113 | 0,00 |
| 9,000 % fällig am 22.04.2027 (a) | | 31 | 30 | 0,00 |
| **Diamond Offshore Drilling, Inc.** | | | | |
| 13,000 % fällig am 21.12.2026 | | 77 | 76 | 0,00 |
| **Diamond Sports Group LLC** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.08.2026 | | 11.000 | 2.764 | 0,11 |
| 6,625 % fällig am 15.08.2027 | | 5.000 | 625 | 0,03 |
| **Directv Financing LLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.08.2027 | | 11.000 | 9.419 | 0,38 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.12.2026 | | 5.000 | 3.929 | 0,16 |
| 5,750 % fällig am 01.12.2028 | | 5.000 | 3.711 | 0,15 |
| 5,875 % fällig am 15.11.2024 | | 5.000 | 4.230 | 0,17 |
| 7,750 % fällig am 01.07.2026 | | 3.000 | 2.349 | 0,09 |
| **DKT Finance ApS** | | | | |
| 9,375 % fällig am 17.06.2023 | | 2.250 | 2.183 | 0,09 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **DT Midstream, Inc.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.06.2029 | $ | 4.000 | $ 3.402 | 0,14 |
| 4,375 % fällig am 15.06.2031 | | 3.500 | 2.942 | 0,12 |
| **Edgewell Personal Care Co.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.06.2028 | | 3.000 | 2.735 | 0,11 |
| **Element Solutions, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.09.2028 | | 4.000 | 3.307 | 0,13 |
| **Encino Acquisition Partners Holdings LLC** | | | | |
| 8,500 % fällig am 01.05.2028 | | 3.000 | 2.839 | 0,11 |
| **Endo DAC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 30.06.2028 | | 8.000 | 640 | 0,03 |
| **Endurance International Group Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.02.2029 | | 11.000 | 7.955 | 0,32 |
| **Energizer Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 31.03.2029 | | 4.000 | 3.077 | 0,12 |
| 4,750 % fällig am 15.06.2028 | | 2.000 | 1.590 | 0,06 |
| **EnLink Midstream LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.01.2028 | | 5.000 | 4.595 | 0,19 |
| **EnLink Midstream Partners LP** | | | | |
| 4,150 % fällig am 01.06.2025 | | 5.000 | 4.664 | 0,19 |
| **EQM Midstream Partners LP** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2024 | | 1.123 | 1.045 | 0,04 |
| 4,500 % fällig am 15.01.2029 | | 3.000 | 2.441 | 0,10 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2031 | | 3.000 | 2.401 | 0,10 |
| 6,000 % fällig am 01.07.2025 | | 735 | 706 | 0,03 |
| 6,500 % fällig am 01.07.2027 | | 2.000 | 1.863 | 0,08 |
| 6,500 % fällig am 15.07.2048 | | 3.500 | 2.675 | 0,11 |
| **Fertitta Entertainment LLC** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.01.2029 | | 2.000 | 1.711 | 0,07 |
| 6,750 % fällig am 15.01.2030 | | 7.750 | 5.970 | 0,24 |
| **Ford Motor Co.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.02.2032 | | 4.625 | 3.475 | 0,14 |
| **Foundation Building Materials, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.03.2029 | | 13.500 | 9.910 | 0,40 |
| **Frontier Communications Holdings LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.05.2028 | | 2.250 | 1.918 | 0,08 |
| 5,875 % fällig am 15.10.2027 | | 3.000 | 2.705 | 0,11 |
| 6,750 % fällig am 01.05.2029 | | 5.000 | 4.126 | 0,17 |
| **Full House Resorts, Inc.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 15.02.2028 | | 7.250 | 5.805 | 0,23 |
| **Gap, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.10.2029 | | 3.500 | 2.464 | 0,10 |
| 3,875 % fällig am 01.10.2031 | | 5.000 | 3.498 | 0,14 |
| **Garda World Security Corp.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.02.2027 | | 3.000 | 2.585 | 0,10 |
| 6,000 % fällig am 01.06.2029 | | 7.000 | 5.392 | 0,22 |
| **GCP Applied Technologies, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.04.2026 | | 3.000 | 2.990 | 0,12 |
| **GFL Environmental, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.09.2028 | | 5.000 | 4.295 | 0,17 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2028 | | 5.000 | 4.133 | 0,17 |
| 5,125 % fällig am 15.12.2026 | | 1.000 | 958 | 0,04 |
| **Global Marine, Inc.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 01.06.2028 | | 4.000 | 2.467 | 0,10 |
| **Global Medical Response, Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.10.2025 | | 10.000 | 8.924 | 0,36 |
| **Go Daddy Operating Co. LLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.03.2029 | | 10.000 | 8.449 | 0,34 |
| **Golden Entertainment, Inc.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 15.04.2026 | | 3.000 | 2.973 | 0,12 |
| **Graham Packaging Co., Inc.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.08.2028 | | 10.000 | 8.039 | 0,32 |
| **Graphic Packaging International LLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.03.2029 | | 5.000 | 4.205 | 0,17 |
| **H-Food Holdings LLC** | | | | |
| 8,500 % fällig am 01.06.2026 | | 18.000 | 12.625 | 0,52 |
| **Hadrian Merger Sub, Inc.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 01.05.2026 | | 10.000 | 9.521 | 0,38 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.09.2030 | | 5.000 | 4.268 | 0,17 |
| 5,375 % fällig am 01.02.2025 | | 2.000 | 1.996 | 0,08 |
| **Herens Holdco SARL** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.05.2028 | | 4.000 | 3.329 | 0,13 |
| **Herens Midco SARL** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.05.2029 | € | 6.000 | 4.147 | 0,17 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Hertz Corp.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 01.12.2026 | $ | 2.000 | $ 1.674 | 0,07 |
| 5,000 % fällig am 01.12.2029 | | 2.000 | 1.545 | 0,06 |
| **Hilton Domestic Operating Co., Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.02.2032 | | 5.000 | 3.983 | 0,16 |
| 3,750 % fällig am 01.05.2029 | | 3.000 | 2.548 | 0,10 |
| 4,000 % fällig am 01.05.2031 | | 3.000 | 2.502 | 0,10 |
| 4,875 % fällig am 15.01.2030 | | 2.500 | 2.266 | 0,09 |
| 5,750 % fällig am 01.05.2028 | | 1.500 | 1.429 | 0,06 |
| **Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.07.2031 | | 5.000 | 3.824 | 0,15 |
| 5,000 % fällig am 01.06.2029 | | 4.375 | 3.551 | 0,14 |
| **Howard Midstream Energy Partners LLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.01.2027 | | 2.625 | 2.266 | 0,09 |
| **Howmet Aerospace, Inc.** | | | | |
| 5,900 % fällig am 01.02.2027 | | 750 | 740 | 0,03 |
| 5,950 % fällig am 01.02.2037 | | 3.000 | 2.834 | 0,11 |
| **iHeartCommunications, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.01.2028 | | 7.500 | 6.191 | 0,25 |
| 6,375 % fällig am 01.05.2026 | | 500 | 464 | 0,02 |
| 8,375 % fällig am 01.05.2027 | | 8.750 | 6.972 | 0,28 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (4,750 % bar oder 5,500 % PIK)** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.09.2026 (a) | | 2.000 | 1.722 | 0,07 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (6,000 % bar oder 6,750 % PIK)** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.05.2027 (a) | | 2.000 | 1.783 | 0,07 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (6,375 % bar oder 7,125 % PIK)** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.05.2029 (a) | | 1.750 | 1.526 | 0,06 |
| **II-VI, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.12.2029 | | 4.000 | 3.500 | 0,14 |
| **Imola Merger Corp.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.05.2029 | | 5.000 | 4.200 | 0,17 |
| **Ingevity Corp.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.11.2028 | | 5.000 | 4.197 | 0,17 |
| **Innophos Holdings, Inc.** | | | | |
| 9,375 % fällig am 15.02.2028 | | 9.750 | 8.897 | 0,36 |
| **Intelligent Packaging Holdco Issuer LP (9,000 % bar oder 9,750 % PIK)** | | | | |
| 9,000 % fällig am 15.01.2026 (a) | | 3.000 | 2.671 | 0,11 |
| **Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.09.2028 | | 4.000 | 3.321 | 0,13 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.03.2030 | | 11.249 | 9.309 | 0,38 |
| **International Game Technology PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.01.2029 | | 2.000 | 1.815 | 0,07 |
| 6,250 % fällig am 15.01.2027 | | 2.000 | 1.949 | 0,08 |
| **IQVIA, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.10.2026 | | 5.000 | 4.775 | 0,19 |
| **Iris Holdings, Inc. (8.750 % bar oder 9,500 % PIK)** | | | | |
| 8,750 % fällig am 15.02.2026 (a) | | 3.750 | 3.006 | 0,12 |
| **Jeld-Wen, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.12.2025 | | 2.000 | 1.703 | 0,07 |
| 4,875 % fällig am 15.12.2027 | | 5.000 | 3.907 | 0,16 |
| **Kronos Acquisition Holdings, Inc.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 31.12.2027 | | 11.750 | 8.827 | 0,36 |
| **LABL, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.11.2028 | | 2.125 | 1.720 | 0,07 |
| 6,750 % fällig am 15.07.2026 | | 3.750 | 3.382 | 0,14 |
| 8,250 % fällig am 01.11.2029 | | 3.625 | 2.744 | 0,11 |
| 10,500 % fällig am 15.07.2027 | | 3.500 | 3.050 | 0,12 |
| **Laboratoire Eimer Selas** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.02.2029 | € | 500 | 367 | 0,01 |
| **Lamb Weston Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 31.01.2030 | $ | 2.000 | 1.736 | 0,07 |
| 4,375 % fällig am 31.01.2032 | | 2.500 | 2.180 | 0,09 |
| 4,875 % fällig am 15.05.2028 | | 3.000 | 2.828 | 0,11 |
| **LBM Acquisition LLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.01.2029 | | 15.000 | 9.680 | 0,39 |
| **Legacy LifePoint Health LLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.02.2027 | | 4.000 | 3.432 | 0,14 |
| **Level 3 Financing, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.01.2029 | | 3.000 | 2.319 | 0,09 |
| 3,750 % fällig am 15.07.2029 | | 5.000 | 3.875 | 0,16 |
| **LifePoint Health, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.01.2029 | | 10.000 | 7.364 | 0,30 |
| **Live Nation Entertainment, Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.05.2027 | | 3.000 | 2.957 | 0,12 |
| **LogMeIn, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.09.2027 | $ | 2.500 | $ 1.747 | 0,07 |
| **Madison IAQ LLC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 30.06.2028 | | 3.500 | 2.896 | 0,12 |
| 5,875 % fällig am 30.06.2029 | | 11.000 | 8.458 | 0,34 |
| **MajorDrive Holdings LLC** | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.06.2029 | | 4.000 | 2.747 | 0,11 |
| **Marriott Ownership Resorts, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.06.2029 | | 3.250 | 2.708 | 0,11 |
| 6,125 % fällig am 15.09.2025 | | 375 | 372 | 0,01 |
| **Mattel, Inc.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 01.04.2026 | | 3.000 | 2.757 | 0,11 |
| 3,750 % fällig am 01.04.2029 | | 4.000 | 3.601 | 0,15 |
| 5,875 % fällig am 15.12.2027 | | 4.000 | 3.916 | 0,16 |
| **Mauser Packaging Solutions Holding Co.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.04.2024 | | 2.000 | 1.914 | 0,08 |
| 7,250 % fällig am 15.04.2025 (i) | | 5.000 | 4.372 | 0,18 |
| **MEG Energy Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.02.2029 | | 1.000 | 915 | 0,04 |
| 7,125 % fällig am 01.02.2027 | | 2.500 | 2.523 | 0,10 |
| **Merlin Entertainments Ltd.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.06.2026 | | 2.000 | 1.828 | 0,07 |
| **Michaels Cos., Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.05.2028 | | 4.000 | 3.152 | 0,13 |
| 7,875 % fällig am 01.05.2029 | | 4.000 | 2.648 | 0,11 |
| **Midwest Gaming Borrower LLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.05.2029 | | 5.000 | 4.083 | 0,16 |
| **Minerva Merger Sub, Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.02.2030 | | 10.000 | 8.345 | 0,34 |
| **Motion Bondco DAC** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.11.2027 | | 1.000 | 793 | 0,03 |
| **Mozart Debt Merger Sub, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.04.2029 | | 8.000 | 6.841 | 0,28 |
| 5,250 % fällig am 01.10.2029 (i) | | 9.000 | 7.420 | 0,30 |
| **MPH Acquisition Holdings LLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.11.2028 (i) | | 8.000 | 6.646 | 0,27 |
| **MSCI, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.08.2033 | | 2.000 | 1.598 | 0,06 |
| 3,625 % fällig am 01.09.2030 | | 4.000 | 3.342 | 0,14 |
| 3,875 % fällig am 15.02.2031 | | 2.000 | 1.716 | 0,07 |
| 4,000 % fällig am 15.11.2029 | | 3.000 | 2.666 | 0,11 |
| **Nabors Industries, Inc.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 15.05.2027 | | 2.500 | 2.378 | 0,10 |
| 9,000 % fällig am 01.02.2025 | | 2.156 | 2.148 | 0,09 |
| **NCL Corp. Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.12.2024 | | 6.000 | 4.999 | 0,20 |
| 5,875 % fällig am 15.03.2026 | | 4.375 | 3.447 | 0,14 |
| 7,750 % fällig am 15.02.2029 | | 3.000 | 2.299 | 0,09 |
| **NCR Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.10.2028 | | 2.250 | 1.911 | 0,08 |
| 5,125 % fällig am 15.04.2029 | | 3.000 | 2.544 | 0,10 |
| 5,250 % fällig am 01.10.2030 | | 2.000 | 1.728 | 0,07 |
| **NESCO Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.04.2029 | | 2.250 | 1.891 | 0,08 |
| **Nidda BondCo GmbH** | | | | |
| 5,000 % fällig am 30.09.2025 | € | 10.000 | 8.486 | 0,34 |
| **Nielsen Finance LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.07.2029 | $ | 2.000 | 1.809 | 0,07 |
| 4,750 % fällig am 15.07.2031 | | 3.000 | 2.703 | 0,11 |
| 5,625 % fällig am 01.10.2028 | | 2.375 | 2.212 | 0,09 |
| 5,875 % fällig am 01.10.2030 | | 2.750 | 2.530 | 0,10 |
| **Noble Finance Co. (11,000 % bar oder 15,000 % PIK)** | | | | |
| 11,000 % fällig am 15.02.2028 (a) | | 1.171 | 1.282 | 0,05 |
| **Nokia Oyj** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.05.2039 | | 3.000 | 2.972 | 0,12 |
| **Novelis Corp.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.11.2026 | | 4.250 | 3.599 | 0,15 |
| 3,875 % fällig am 15.08.2031 | | 7.500 | 5.789 | 0,23 |
| 4,750 % fällig am 30.01.2030 | | 6.000 | 4.999 | 0,20 |
| **NuStar Logistics LP** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.10.2025 | | 2.750 | 2.575 | 0,10 |
| 6,375 % fällig am 01.10.2030 | | 2.375 | 2.067 | 0,08 |
| **Occidental Petroleum Corp.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 15.08.2039 | | 2.800 | 2.285 | 0,09 |
| 4,400 % fällig am 15.04.2046 | | 2.000 | 1.620 | 0,07 |
| 4,625 % fällig am 15.06.2045 | | 1.500 | 1.236 | 0,05 |
| 5,500 % fällig am 01.12.2025 (h) | | 4.000 | 3.947 | 0,16 |
| 5,550 % fällig am 15.03.2026 | $ | 3.000 | $ 2.985 | 0,12 |
| 5,875 % fällig am 01.09.2025 | | 2.375 | 2.370 | 0,10 |
| 6,125 % fällig am 01.01.2031 (h) | | 250 | 254 | 0,01 |
| 6,200 % fällig am 15.03.2040 | | 3.000 | 2.961 | 0,12 |
| 6,375 % fällig am 01.09.2028 | | 2.000 | 2.028 | 0,08 |
| 6,450 % fällig am 15.09.2036 | | 5.100 | 5.240 | 0,21 |
| 6,600 % fällig am 15.03.2046 | | 6.750 | 7.188 | 0,29 |
| 6,625 % fällig am 01.09.2030 | | 4.125 | 4.256 | 0,17 |
| 7,500 % fällig am 01.05.2031 | | 1.000 | 1.077 | 0,04 |
| 8,000 % fällig am 15.07.2025 | | 2.000 | 2.108 | 0,09 |
| 8,875 % fällig am 15.07.2030 | | 3.625 | 4.169 | 0,17 |
| **Olympus Water U.S. Holding Corp.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.10.2028 | € | 2.250 | 1.914 | 0,08 |
| 4,250 % fällig am 01.10.2028 | $ | 7.000 | 5.494 | 0,22 |
| 5,375 % fällig am 01.10.2029 | € | 10.000 | 7.550 | 0,31 |
| 6,250 % fällig am 01.10.2029 | $ | 5.000 | 3.481 | 0,14 |
| **ON Semiconductor Corp.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.09.2028 | | 3.750 | 3.307 | 0,13 |
| **Organon & Co.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 30.04.2028 | | 7.500 | 6.665 | 0,27 |
| 5,125 % fällig am 30.04.2031 | | 10.000 | 8.665 | 0,35 |
| **Outfront Media Capital LLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.01.2029 | | 2.000 | 1.596 | 0,06 |
| 5,000 % fällig am 15.08.2027 | | 2.125 | 1.859 | 0,08 |
| **Pactiv Evergreen Group Issuer LLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.10.2028 | | 4.500 | 3.832 | 0,15 |
| **Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.10.2027 | | 8.250 | 7.070 | 0,29 |
| **Pactiv LLC** | | | | |
| 8,375 % fällig am 15.04.2027 | | 500 | 439 | 0,02 |
| **Par Pharmaceutical, Inc.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 01.04.2027 | | 5.000 | 3.816 | 0,15 |
| **Park River Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.02.2029 | | 15.000 | 9.369 | 0,38 |
| 6,750 % fällig am 01.08.2029 | | 9.000 | 5.850 | 0,24 |
| **Performance Food Group, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.08.2029 | | 3.000 | 2.511 | 0,10 |
| 5,500 % fällig am 15.10.2027 | | 2.125 | 1.971 | 0,08 |
| 6,875 % fällig am 01.05.2025 | | 1.000 | 997 | 0,04 |
| **PetSmart, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.02.2028 | | 10.000 | 8.681 | 0,35 |
| 7,750 % fällig am 15.02.2029 | | 10.000 | 9.028 | 0,36 |
| **Picasso Finance Sub, Inc.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.06.2025 | | 1.000 | 977 | 0,04 |
| **Post Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.09.2031 | | 10.500 | 8.618 | 0,35 |
| 4,625 % fällig am 15.04.2030 | | 5.000 | 4.227 | 0,17 |
| 5,625 % fällig am 15.01.2028 | | 5.000 | 4.757 | 0,19 |
| **Premier Entertainment Sub LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.09.2029 | | 5.000 | 3.567 | 0,14 |
| 5,875 % fällig am 01.09.2031 | | 3.000 | 2.086 | 0,08 |
| **Presidio Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.02.2027 | | 2.500 | 2.300 | 0,09 |
| 8,250 % fällig am 01.02.2028 | | 3.750 | 3.302 | 0,13 |
| **Prime Healthcare Services, Inc.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 01.11.2025 | | 7.000 | 5.996 | 0,24 |
| **Prime Security Services Borrower LLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 31.08.2027 | | 2.000 | 1.654 | 0,07 |
| 5,250 % fällig am 15.04.2024 | | 2.000 | 1.959 | 0,08 |
| 5,750 % fällig am 15.04.2026 | | 1.500 | 1.402 | 0,06 |
| 6,250 % fällig am 15.01.2028 (i) | | 5.000 | 4.196 | 0,17 |
| **Radiate Holdco LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.09.2026 | | 2.000 | 1.728 | 0,07 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2028 | | 8.000 | 6.205 | 0,25 |
| **Radiology Partners, Inc.** | | | | |
| 9,250 % fällig am 01.02.2028 | | 3.000 | 2.257 | 0,09 |
| **Range Resources Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.05.2025 | | 2.000 | 1.954 | 0,08 |
| 5,000 % fällig am 15.03.2023 | | 1.122 | 1.115 | 0,05 |
| 8,250 % fällig am 15.01.2029 | | 2.000 | 2.042 | 0,08 |
| **Real Hero Merger Sub, Inc.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 01.02.2029 | | 5.000 | 3.799 | 0,15 |
| **RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.** | | | | |
| 9,750 % fällig am 01.12.2026 | | 5.000 | 4.872 | 0,20 |
| **Revlon Consumer Products Corp.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 01.08.2024 ^ | | 2.000 | 165 | 0,01 |
| **Rite Aid Corp.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 15.11.2026 | | 3.000 | 2.338 | 0,09 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Rockcliff Energy LLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.10.2029 | $ | 6.000 | $ 5.468 | 0,22 |
| **Rockies Express Pipeline LLC** | | | | |
| 4,800 % fällig am 15.05.2030 | | 2.000 | 1.668 | 0,07 |
| 4,950 % fällig am 15.07.2029 | | 2.000 | 1.713 | 0,07 |
| **Roller Bearing Co. of America, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.10.2029 | | 3.750 | 3.196 | 0,13 |
| **Rolls-Royce PLC** | | | | |
| 4,625 % fällig am 16.02.2026 | € | 1.500 | 1.477 | 0,06 |
| 5,750 % fällig am 15.10.2027 | £ | 1.750 | 2.006 | 0,08 |
| **Royal Caribbean Cruises Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.04.2028 | $ | 5.000 | 3.487 | 0,14 |
| 9,125 % fällig am 15.06.2023 | | 2.500 | 2.478 | 0,10 |
| **RP Escrow Issuer LLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.12.2025 | | 2.250 | 1.948 | 0,08 |
| **Sabre GLBL, Inc.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 01.09.2025 | | 2.500 | 2.324 | 0,09 |
| 9,250 % fällig am 15.04.2025 | | 2.000 | 1.931 | 0,08 |
| **Scientific Games Holdings LP** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.03.2030 | | 8.750 | 7.451 | 0,30 |
| **Scientific Games International, Inc.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.05.2028 | | 1.500 | 1.410 | 0,06 |
| 7,250 % fällig am 15.11.2029 | | 4.000 | 3.757 | 0,15 |
| **SCIH Salt Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.05.2028 | | 5.000 | 4.166 | 0,17 |
| 6,625 % fällig am 01.05.2029 | | 7.000 | 5.540 | 0,22 |
| **Scripps Escrow, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.01.2031 | | 10.050 | 8.028 | 0,32 |
| **Seagate HDD Cayman** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.07.2029 | | 1.750 | 1.376 | 0,06 |
| 3,375 % fällig am 15.07.2031 | | 3.500 | 2.727 | 0,11 |
| **Sensata Technologies BV** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.04.2029 | | 5.000 | 4.251 | 0,17 |
| 5,625 % fällig am 01.11.2024 | | 1.000 | 989 | 0,04 |
| **Sensata Technologies, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.02.2031 | | 5.250 | 4.217 | 0,17 |
| **Sigma Holdco BV** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.05.2026 | | 10.000 | 5.692 | 0,23 |
| **Simmons Foods, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 01.03.2029 | | 5.000 | 4.235 | 0,17 |
| **Sinclair Television Group, Inc.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.12.2030 | | 3.000 | 2.384 | 0,10 |
| 5,125 % fällig am 15.02.2027 | | 3.000 | 2.533 | 0,10 |
| **Sirius XM Radio, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.09.2031 | | 2.000 | 1.596 | 0,06 |
| 4,125 % fällig am 01.07.2030 | | 5.000 | 4.188 | 0,17 |
| 5,000 % fällig am 01.08.2027 | | 2.000 | 1.860 | 0,08 |
| **SM Energy Co.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.07.2028 | | 1.500 | 1.382 | 0,06 |
| 6,625 % fällig am 15.01.2027 | | 2.000 | 1.872 | 0,08 |
| 6,750 % fällig am 15.09.2026 | | 2.000 | 1.889 | 0,08 |
| **Southwestern Energy Co.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.02.2032 | | 2.000 | 1.714 | 0,07 |
| 5,375 % fällig am 01.02.2029 | | 5.000 | 4.647 | 0,19 |
| 5,375 % fällig am 15.03.2030 | | 5.000 | 4.610 | 0,19 |
| **Spectrum Brands, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.03.2031 | | 4.000 | 3.230 | 0,13 |
| 5,500 % fällig am 15.07.2030 | | 5.000 | 4.508 | 0,18 |
| 5,750 % fällig am 15.07.2025 | | 2.000 | 1.978 | 0,08 |
| **Spirit AeroSystems, Inc.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.06.2023 | | 2.750 | 2.582 | 0,10 |
| 4,600 % fällig am 15.06.2028 | | 5.275 | 3.903 | 0,16 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2025 | | 1.750 | 1.622 | 0,07 |
| 7,500 % fällig am 15.04.2025 | | 3.250 | 3.028 | 0,12 |
| **SRS Distribution, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.12.2029 | | 5.000 | 3.933 | 0,16 |
| 6,125 % fällig am 01.07.2029 | | 7.500 | 5.928 | 0,24 |
| **Standard Industries, Inc.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.01.2031 | | 6.500 | 4.807 | 0,19 |
| 4,375 % fällig am 15.07.2030 | | 2.500 | 1.976 | 0,08 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2028 | | 5.000 | 4.289 | 0,17 |
| 5,000 % fällig am 15.02.2027 | | 2.000 | 1.788 | 0,07 |
| **Staples, Inc.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.04.2026 | | 7.000 | 5.823 | 0,24 |
| 10,750 % fällig am 15.04.2027 | | 4.000 | 2.651 | 0,11 |
| **Station Casinos LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.02.2028 | | 2.000 | 1.692 | 0,07 |
| 4,625 % fällig am 01.12.2031 | | 2.000 | 1.563 | 0,06 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Strathcona Resources Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.08.2026 | $ | 4.625 | $ 4.215 | 0,17 |
| **Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.05.2025 | | 3.150 | 2.901 | 0,12 |
| **Summer BC Bidco LLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 31.10.2026 | | 4.000 | 3.588 | 0,14 |
| **Superior Plus LP** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2029 | | 4.575 | 3.897 | 0,16 |
| **Surgery Center Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.07.2025 | | 3.500 | 3.213 | 0,13 |
| **SWF Escrow Issuer Corp.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.10.2029 | | 7.000 | 4.717 | 0,19 |
| **Syneos Health, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.01.2029 | | 3.000 | 2.544 | 0,10 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.02.2026 | | 2.125 | 1.916 | 0,08 |
| 2,625 % fällig am 15.02.2029 | | 5.250 | 4.434 | 0,18 |
| 2,875 % fällig am 15.02.2031 | | 7.000 | 5.825 | 0,24 |
| 3,500 % fällig am 15.04.2031 | | 7.000 | 6.058 | 0,24 |
| **Team Health Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.02.2025 | | 18.000 | 12.596 | 0,51 |
| **TEGNA, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.03.2028 | | 2.500 | 2.344 | 0,09 |
| 4,750 % fällig am 15.03.2026 | | 1.500 | 1.442 | 0,06 |
| 5,000 % fällig am 15.09.2029 | | 5.000 | 4.743 | 0,19 |
| **Tenet Healthcare Corp.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.01.2030 | | 4.000 | 3.392 | 0,14 |
| 4,875 % fällig am 01.01.2026 | | 2.500 | 2.309 | 0,09 |
| 5,125 % fällig am 01.11.2027 | | 4.000 | 3.607 | 0,15 |
| 6,125 % fällig am 01.10.2028 | | 10.000 | 8.589 | 0,35 |
| 6,125 % fällig am 15.06.2030 | | 5.000 | 4.628 | 0,19 |
| 6,750 % fällig am 15.06.2023 | | 10.000 | 10.299 | 0,42 |
| 6,875 % fällig am 15.11.2031 | | 4.000 | 3.563 | 0,14 |
| **Terminix Co. LLC** | | | | |
| 7,450 % fällig am 15.08.2027 | | 4.580 | 5.140 | 0,21 |
| **TK Elevator Holdco GmbH** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.07.2028 | € | 1.800 | 1.614 | 0,07 |
| 7,625 % fällig am 15.07.2028 | $ | 4.734 | 4.257 | 0,17 |
| **TK Elevator U.S. Newco, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.07.2027 | | 4.000 | 3.573 | 0,14 |
| **TransDigm, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.01.2029 | | 7.000 | 5.651 | 0,23 |
| 5,500 % fällig am 15.11.2027 | | 8.000 | 6.814 | 0,28 |
| 6,250 % fällig am 15.03.2026 | | 1.750 | 1.692 | 0,07 |
| **Transocean Guardian Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.01.2024 | | 2.274 | 2.105 | 0,09 |
| **Transocean, Inc.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 01.11.2025 | | 5.750 | 4.263 | 0,17 |
| 7,500 % fällig am 15.01.2026 | | 2.000 | 1.433 | 0,06 |
| 7,500 % fällig am 15.04.2031 | | 5.000 | 2.707 | 0,11 |
| **Travel + Leisure Co.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 01.03.2030 | | 5.000 | 3.882 | 0,16 |
| 6,625 % fällig am 31.07.2026 | | 3.500 | 3.325 | 0,13 |
| **Trident TPI Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.11.2025 | | 2.000 | 1.839 | 0,07 |
| 9,250 % fällig am 01.08.2024 | | 5.000 | 4.581 | 0,19 |
| **TriNet Group, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.03.2029 | | 5.000 | 4.126 | 0,17 |
| **Triton Water Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 01.04.2029 | | 10.000 | 7.117 | 0,29 |
| **Triumph Group, Inc.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.09.2024 | | 3.000 | 2.680 | 0,11 |
| 7,750 % fällig am 15.08.2025 | | 5.000 | 3.857 | 0,16 |
| 8,875 % fällig am 01.06.2024 | | 2.715 | 2.738 | 0,11 |
| **Twilio, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.03.2029 | | 3.000 | 2.528 | 0,10 |
| 3,875 % fällig am 15.03.2031 | | 3.000 | 2.474 | 0,10 |
| **U.S. Acute Care Solutions LLC** | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.03.2026 | | 10.000 | 8.969 | 0,36 |
| **U.S. Foods, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.02.2029 | | 8.000 | 7.007 | 0,28 |
| 6,250 % fällig am 15.04.2025 | | 2.000 | 1.999 | 0,08 |
| **U.S. Renal Care, Inc.** | | | | |
| 10,625 % fällig am 15.07.2027 | | 13.000 | 4.908 | 0,20 |
| **Uber Technologies, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.08.2029 | | 7.500 | 6.183 | 0,25 |
| 7,500 % fällig am 15.09.2027 | | 3.000 | 2.911 | 0,12 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **United Airlines, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.04.2026 | $ | 3.000 | $ 2.654 | 0,11 |
| 4,625 % fällig am 15.04.2029 | | 7.500 | 6.388 | 0,26 |
| **Univar Solutions USA, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.12.2027 | | 3.000 | 2.798 | 0,11 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.05.2029 | | 8.500 | 7.141 | 0,29 |
| 6,625 % fällig am 01.06.2027 | | 2.500 | 2.385 | 0,10 |
| **UPC Holding BV** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2028 | | 3.000 | 2.569 | 0,10 |
| **Valaris Ltd. (8,250 % bar oder 12,000 % PIK)** | | | | |
| 8,250 % fällig am 30.04.2028 (a) | | 482 | 468 | 0,02 |
| **Venture Global Calcasieu Pass LLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.08.2029 | | 5.000 | 4.387 | 0,18 |
| 4,125 % fällig am 15.08.2031 | | 2.500 | 2.144 | 0,09 |
| **Veritas U.S., Inc.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 01.09.2025 | | 4.000 | 3.010 | 0,12 |
| **Vertiv Group Corp.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.11.2028 | | 7.500 | 6.101 | 0,25 |
| **ViaSat, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.09.2025 | | 3.000 | 2.431 | 0,10 |
| 6,500 % fällig am 15.07.2028 | | 3.000 | 2.070 | 0,08 |
| **Viking Cruises Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.09.2027 | | 7.000 | 5.239 | 0,21 |
| 7,000 % fällig am 15.02.2029 | | 5.000 | 3.753 | 0,15 |
| 13,000 % fällig am 15.05.2025 | | 2.750 | 2.822 | 0,11 |
| **Virgin Media Finance PLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.07.2030 | | 7.000 | 5.566 | 0,22 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.08.2030 | | 5.000 | 4.122 | 0,17 |
| 5,500 % fällig am 15.05.2029 | | 5.000 | 4.481 | 0,18 |
| **Vmed O2 UK Financing PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 31.01.2031 | | 5.000 | 4.033 | 0,16 |
| **VOC Escrow Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.02.2028 | | 2.500 | 2.012 | 0,08 |
| **WESCO Distribution, Inc.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.06.2025 | | 5.000 | 4.999 | 0,20 |
| 7,250 % fällig am 15.06.2028 | | 5.000 | 4.957 | 0,20 |
| **Western Midstream Operating LP** | | | | |
| 5,450 % fällig am 01.04.2044 | | 2.000 | 1.666 | 0,07 |
| 5,750 % fällig am 01.02.2050 | | 10.000 | 8.060 | 0,33 |
| **Wheel Pros, Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.05.2029 | | 10.000 | 7.080 | 0,29 |
| **White Cap Buyer LLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.10.2028 | | 14.000 | 11.219 | 0,45 |
| **White Cap Parent LLC (8,250 % bar oder 8,250 % PIK)** | | | | |
| 8,250 % fällig am 15.03.2026 (a) | | 5.250 | 4.379 | 0,18 |
| **Williams Scotsman International, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.08.2028 | | 2.750 | 2.348 | 0,09 |
| **WMG Acquisition Corp.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.02.2031 | | 4.000 | 3.109 | 0,13 |
| 3,875 % fällig am 15.07.2030 | | 4.000 | 3.333 | 0,13 |
| **WR Grace Holdings LLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.06.2027 | | 3.000 | 2.614 | 0,11 |
| 5,625 % fällig am 15.08.2029 | | 8.000 | 5.910 | 0,24 |
| **WW International, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.04.2029 | | 5.000 | 3.337 | 0,13 |
| **Wyndham Hotels & Resorts, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.08.2028 | | 3.000 | 2.628 | 0,11 |
| **Wynn Las Vegas LLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.05.2027 | | 3.000 | 2.574 | 0,10 |
| 5,500 % fällig am 01.03.2025 | | 3.000 | 2.751 | 0,11 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.12.2029 | | 1.500 | 933 | 0,04 |
| 5,500 % fällig am 01.10.2027 | | 2.500 | 1.622 | 0,07 |
| **Wynn Resorts Finance LLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.10.2029 | | 3.000 | 2.367 | 0,10 |
| **Yum! Brands, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.03.2031 | | 5.000 | 4.212 | 0,17 |
| 4,625 % fällig am 31.01.2032 | | 5.000 | 4.431 | 0,18 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2030 | | 2.500 | 2.273 | 0,09 |
| 6,875 % fällig am 15.11.2037 | | 2.000 | 2.034 | 0,08 |
| **Zayo Group Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.03.2027 | | 3.000 | 2.494 | 0,10 |
| 6,125 % fällig am 01.03.2028 | | 8.000 | 5.798 | 0,23 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Ziggo Bond Co. BV** | | | |
| 3,375 % fällig am 28.02.2030 € | 2.000 | $ 1.473 | 0,06 |
| 5,125 % fällig am 28.02.2030 $ | 2.500 | 1.964 | 0,08 |
| **Ziggo BV** | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2030 | 2.200 | 1.871 | 0,08 |
| | | 1.916.484 | 77,46 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| **Antero Midstream Partners LP** | | | |
| 5,375 % fällig am 15.06.2029 | 3.000 | 2.692 | 0,11 |
| 5,750 % fällig am 01.03.2027 | 1.000 | 932 | 0,04 |
| **Blue Racer Midstream LLC** | | | |
| 7,625 % fällig am 15.12.2025 | 2.000 | 1.894 | 0,08 |
| **Calpine Corp.** | | | |
| 3,750 % fällig am 01.03.2031 | 5.000 | 4.077 | 0,16 |
| 4,500 % fällig am 15.02.2028 | 3.000 | 2.730 | 0,11 |
| 4,625 % fällig am 01.02.2029 | 1.500 | 1.250 | 0,05 |
| 5,125 % fällig am 15.03.2028 | 3.000 | 2.648 | 0,11 |
| **Clearway Energy Operating LLC** | | | |
| 3,750 % fällig am 15.02.2031 | 10.000 | 8.092 | 0,33 |
| **Crestwood Midstream Partners LP** | | | |
| 5,625 % fällig am 01.05.2027 | 3.000 | 2.675 | 0,11 |
| 6,000 % fällig am 01.02.2029 | 2.000 | 1.749 | 0,07 |
| **CrownRock LP** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.05.2029 | 2.750 | 2.471 | 0,10 |
| 5,625 % fällig am 15.10.2025 | 3.000 | 2.828 | 0,11 |
| **Embarq Corp.** | | | |
| 7,995 % fällig am 01.06.2036 | 1.250 | 942 | 0,04 |
| **Endeavor Energy Resources LP** | | | |
| 5,750 % fällig am 30.01.2028 | 5.000 | 4.776 | 0,19 |
| 6,625 % fällig am 15.07.2025 | 1.000 | 1.006 | 0,04 |
| **Genesis Energy LP** | | | |
| 6,500 % fällig am 01.10.2025 | 2.000 | 1.848 | 0,07 |
| 7,750 % fällig am 01.02.2028 | 1.750 | 1.516 | 0,06 |
| 8,000 % fällig am 15.01.2027 | 2.750 | 2.441 | 0,10 |
| **High Ridge Brands Co.** | | | |
| 8,875 % fällig am 15.03.2025 | 2.500 | 41 | 0,00 |
| **Lumen Technologies, Inc.** | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2029 | 5.000 | 3.736 | 0,15 |
| **NRG Energy, Inc.** | | | |
| 3,375 % fällig am 15.02.2029 | 2.000 | 1.616 | 0,07 |
| 3,625 % fällig am 15.02.2031 | 2.000 | 1.572 | 0,06 |
| 3,875 % fällig am 15.02.2032 | 4.000 | 3.186 | 0,13 |
| 5,250 % fällig am 15.06.2029 | 1.250 | 1.118 | 0,04 |
| 6,625 % fällig am 15.01.2027 | 838 | 822 | 0,03 |
| **NSG Holdings LLC** | | | |
| 7,750 % fällig am 15.12.2025 | 1.198 | 1.180 | 0,05 |
| **PG&E Corp.** | | | |
| 5,250 % fällig am 01.07.2030 | 5.000 | 4.123 | 0,17 |
| **Sprint Capital Corp.** | | | |
| 6,875 % fällig am 15.11.2028 | 5.000 | 5.273 | 0,21 |
| 8,750 % fällig am 15.03.2032 | 7.500 | 9.051 | 0,37 |
| **Sprint Corp.** | | | |
| 7,625 % fällig am 15.02.2025 | 5.000 | 5.221 | 0,21 |
| 7,625 % fällig am 01.03.2026 | 3.000 | 3.167 | 0,13 |
| **Tallgrass Energy Partners LP** | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2028 | 1.750 | 1.490 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 31.12.2030 | 3.000 | 2.494 | 0,10 |
| 7,500 % fällig am 01.10.2025 | 1.000 | 970 | 0,04 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Telecom Italia Capital S.A.** | | | |
| 6,375 % fällig am 15.11.2033 $ | 3.500 | $ 2.713 | 0,11 |
| 7,200 % fällig am 18.07.2036 | 2.000 | 1.524 | 0,06 |
| **TerraForm Power Operating LLC** | | | |
| 4,750 % fällig am 15.01.2030 | 2.000 | 1.717 | 0,07 |
| 5,000 % fällig am 31.01.2028 | 3.750 | 3.404 | 0,14 |
| **Transocean Sentry Ltd.** | | | |
| 5,375 % fällig am 15.05.2023 | 2.242 | 2.120 | 0,09 |
| | | 103.105 | 4,17 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | 2.213.679 | 89,47 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | |
| **Banc of America Funding Trust** | | | |
| 2,861 % fällig am 20.02.2036 ^ | 81 | 76 | 0,00 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,072 % fällig am 20.05.2046 ^ | 60 | 52 | 0,00 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 2,264 % fällig am 25.03.2035 | 17 | 14 | 0,00 |
| 2,324 % fällig am 25.02.2036 ^ | 10 | 5 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust** | | | |
| 5,863 % fällig am 25.02.2037 ^ | 354 | 90 | 0,00 |
| **Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 ^ | 44 | 38 | 0,00 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,763 % fällig am 25.04.2035 | 2 | 2 | 0,00 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 ^ | 198 | 165 | 0,01 |
| **MortgageIT Trust** | | | |
| 2,264 % fällig am 25.02.2035 | 39 | 38 | 0,00 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | |
| 2,164 % fällig am 25.05.2046 ^ | 86 | 72 | 0,00 |
| **TBW Mortgage-Backed Trust** | | | |
| 6,470 % fällig am 25.09.2036 ^ | 662 | 28 | 0,00 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 2,713 % fällig am 25.12.2036 ^ | 169 | 157 | 0,01 |
| 3,011 % fällig am 25.10.2036 ^ | 98 | 94 | 0,01 |
| | | 831 | 0,03 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | |
| 1,694 % fällig am 25.01.2037 ^ | 80 | 29 | 0,00 |
| | **AKTIEN** | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| **Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (b)** | 167.378 | 179 | 0,01 |
| **iHeartMedia, Inc. 'A' (b)** | 38.621 | 305 | 0,01 |
| **iHeartMedia, Inc. 'B' (b)** | 29.972 | 213 | 0,01 |
| | | 697 | 0,03 |
| **ENERGIE** | | | |
| **CHC Group LLC** | 3.887 | 0 | 0,00 |
| **Diamond Offshore Drilling, Inc. (b)(h)** | 50.195 | 296 | 0,01 |
| **Noble Corp. (b)(h)** | 205.228 | 5.202 | 0,21 |
| | | 5.498 | 0,22 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **FINANZWERTE** | | | |
| **DB Investors, Inc. (b)(h)** | 30 | $ 0 | 0,00 |
| **Intelsat Emergence S.A. (b)(h)** | 152.075 | 4.258 | 0,17 |
| **Voyager Aviation Holdings LLC (b)** | 833 | 0 | 0,00 |
| | | 4.258 | 0,17 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| **Associated Materials Group, Inc. (b)** | 2.063.103 | 478 | 0,02 |
| | | 10.931 | 0,44 |
| **RECHTE** | | | |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp 05/12/2025** | 31.850 | 155 | 0,01 |
| **OPTIONSSCHEINE** | | | |
| **DB Investors, Inc. - Exp. 28.06.2069 (h)** | 113 | 0 | 0,00 |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| **Sequa Corp.** 15,000 % | 4.334 | 4.917 | 0,20 |
| **Voyager Aviation Holdings LLC** 9,500 % | 5.000 | 1.512 | 0,06 |
| | | 6.429 | 0,26 |
| | **PARI (000S)** | | |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **U.S. TREASURY BILLS** | | | |
| 0,074 % fällig am 08.09.2022 (c)(d) $ | 21.000 | 20.938 | 0,85 |
| 0,465 % fällig am 08.09.2022 (c)(d) | 17.100 | 17.050 | 0,69 |
| 1,051 % fällig am 08.09.2022 (c)(d) | 27.500 | 27.419 | 1,10 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 65.407 | 2,64 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | **$ 2.319.778** | **93,75** |
| | **AKTIEN** | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (f)** | 661.211 | 5.647 | 0,23 |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)** | 12.886.298 | 128.193 | 5,18 |
| **Summe Investmentfonds** | | **$ 133.840** | **5,41** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 1.278 | U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | $ (1.304) | $ 1.278 | $ 1.278 | 0,05 |
| NOM | 1,480 | 30.06.2022 | 01.07.2022 | 12.300 | U.S. Treasury Bonds 4,375 % fällig am 15.05.2040 | (12.594) | 12.300 | 12.301 | 0,50 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (13.898)** | **$ 13.578** | **$ 13.579** | **0,55** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-38 5-Year Index | 5,000 % | 20.06.2027 | $ 29.700 | $ (1.222) | (0,05) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | **$ (1.222)** | **(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.

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

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

### TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nenn-betrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Receive | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 1,044 % | $ 5.200 | 20.03.2023 | $ (6) | $ (30) | $ (36) | 0,00 |
| BPS | Receive | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 1,044 | 14.300 | 20.09.2022 | (17) | (290) | (307) | (0,02) |
| JPM | Receive | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 1,044 | 5.000 | 20.09.2022 | (6) | (34) | (40) | 0,00 |
| MYC | Receive | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 1,044 | 19.400 | 20.09.2022 | (23) | 153 | 130 | 0,01 |
| | | | | | | | $ (52) | $ (201) | $ (253) | (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 | 07.2022 | £ 6.597 | $ 8.342 | $ 330 | $ 0 | $ 330 | 0,01 |
| BPS | 07.2022 | $ 72.622 | € 68.979 | 0 | (508) | (508) | (0,02) |
| | 08.2022 | € 65.233 | $ 68.737 | 413 | 0 | 413 | 0,02 |
| MBC | 08.2022 | CAD 701 | 547 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | $ 48 | € 46 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | 47 | £ 39 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RBC | 08.2022 | CAD 1.984 | $ 1.534 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | € 68.979 | 74.139 | 2.024 | 0 | 2.024 | 0,08 |
| | | | | $ 2.771 | $ (513) | $ 2.258 | 0,09 |

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | CHF 39 | $ 40 | $ 0 | $ (2) | $ (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 724 | CHF 691 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | 723 | 692 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | 138 | 132 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 723 | 692 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | CHF 45 | $ 47 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 0 | $ (4) | $ (4) | 0,00 |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | € 5.577 | $ 5.900 | $ 69 | $ 0 | $ 69 | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | 196.728 | 206.823 | 1.153 | 0 | 1.153 | 0,05 |
| | 07.2022 | $ 6.898 | € 6.415 | 0 | (192) | (192) | (0,01) |
| | 08.2022 | 173.919 | 165.053 | 0 | (1.046) | (1.046) | (0,04) |
| CBK | 07.2022 | € 1.672 | $ 1.795 | 47 | 0 | 47 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | 181.255 | 190.770 | 1.279 | (2) | 1.277 | 0,05 |
| | 07.2022 | $ 204.338 | € 189.484 | 0 | (6.241) | (6.241) | (0,25) |
| | 08.2022 | 173.951 | 165.053 | 0 | (1.078) | (1.078) | (0,05) |
| SOG | 07.2022 | 202.488 | 188.395 | 0 | (5.531) | (5.531) | (0,22) |
| UAG | 07.2022 | 170.820 | 158.961 | 0 | (4.634) | (4.634) | (0,19) |
| | | | | $ 2.548 | $ (18.724) | $ (16.176) | (0,66) |

Zum 30. Juni 2022 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 | 07.2022 | £ 148 | $ 187 | $ 7 | $ 0 | $ 7 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 20.324 | £ 16.074 | 0 | (803) | (803) | (0,03) |
| BPS | 07.2022 | £ 1.030 | $ 1.250 | 4 | (4) | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 265 | £ 210 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | 20.330 | 16.117 | 0 | (757) | (757) | (0,03) |
| CBK | 07.2022 | 126 | 100 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | 14 | 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | £ 27 | $ 33 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 523 | 642 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| SOG | 07.2022 | 15.059 | 18.327 | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 18.335 | £ 15.059 | 0 | (38) | (38) | 0,00 |
| TOR | 07.2022 | 20.069 | 15.919 | 0 | (737) | (737) | (0,03) |
| | | | | $ 56 | $ (2.352) | $ (2.296) | (0,09) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | SGD 51 | $ 37 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 82 | SGD 113 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08.2022 | 37 | 51 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 07.2022 | SGD 102 | $ 74 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 74 | SGD 102 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | SGD 9 | $ 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | $ 1 | SGD 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | 86 | 117 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| UAG | 07.2022 | SGD 6 | $ 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 89 | SGD 121 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | $ 0 | $ (4) | $ (4) | 0,00 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (16.475)** | **(0,67)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 2.449.499** | **98,99** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ 25.011** | **1,01** |
| **Nettovermögen** | **$ 2.474.510** | **100,00** |

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

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

**^ Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

**(b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

**(c) Nullkuponwertpapier.**

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

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

**(f) Mit dem Fonds verbunden.**

**(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(h) Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|
| DB Investors, Inc. | 18.02.2015 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| DB Investors, Inc. - Exp. 28. Juni 2069 | 18.02.2015 | 0 | 0 | 0,00 |
| Diamond Foreign Asset Co, (9,000 % Cash or 9,000 % PIK) 9,000 % fällig am 22.04.2027 | 12.05.2021 | 115 | 113 | 0,00 |
| Diamond Offshore Drilling, Inc. | 12.05.2021 | 0 | 296 | 0,01 |
| Intelsat Emergence S.A. | 11.02.2014 - 02.03.2022 | 15.552 | 4.258 | 0,17 |
| Noble Corp. | 08.02.2021 - 25.02.2021 | 3.116 | 5.202 | 0,21 |
| Occidental Petroleum Corp, 5,500 % fällig am 01.12.2025 | 08.12.2020 | 4.000 | 3.947 | 0,16 |
| Occidental Petroleum Corp, 6,125 % fällig am 01.01.2031 | 23.03.2021 | 267 | 254 | 0,01 |
| | | $ 23.050 | $ 14.070 | 0,56 |

**(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 34.908 und Barmittel in Höhe von USD 1.030 als Sicherheiten verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von USD 4.823 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 15.520 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 5.686 | $ 2.302.417 | $ 11.675 | $ 2.319.778 |
| Investmentfonds | 133.840 | 0 | 0 | 133.840 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 13.578 | 0 | 13.578 |
| Finanzderivate[3] | 0 | (17.697) | 0 | (17.697) |
| **Summen** | **$ 139.526** | **$ 2.298.298** | **$ 11.675** | **$ 2.449.499** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 13.770 | $ 3.560.207 | $ 33.943 | $ 3.607.920 |
| Investmentfonds | 255.818 | 0 | 0 | 255.818 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 1.473 | 0 | 1.473 |
| Finanzderivate[3] | 0 | 8.133 | 0 | 8.133 |
| **Summen** | **$ 269.588** | **$ 3.569.813** | **$ 33.943** | **$ 3.873.344** |

(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.

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2022:**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | (1,000) % | 29.06.2022 | TBD[1] | $ (5.940) | $ (5.940) | (0,24) |
| | 0,850 | 17.06.2022 | TBD[1] | (4.006) | (4.007) | (0,16) |
| JML | 1,450 | 17.06.2022 | 29.07.2022 | (3.574) | (3.576) | (0,15) |
| | 1,500 | 17.06.2022 | 29.07.2022 | (11.716) | (11.723) | (0,47) |
| TDM | 1,750 | 17.06.2022 | TBD[1] | (5.231) | (5.234) | (0,21) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (30.480)** | **(1,23)** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (437) | $ 360 | $ (77) |
| BPS | (496) | 430 | (66) |
| BRC | (757) | 660 | (97) |
| CBK | 43 | 0 | 43 |
| JPM | (40) | 0 | (40) |
| MBC | (6.038) | 5.500 | (538) |
| MYC | 130 | (170) | (40) |
| MYI | 0 | (10) | (10) |
| RBC | (5) | 0 | (5) |
| SCX | 4 | 0 | 4 |
| SOG | (3.507) | 3.630 | 123 |
| TOR | (737) | 750 | 13 |
| UAG | (4.635) | 4.190 | (445) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 30,55 | 33,54 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 61,22 | 57,25 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 1,98 | 1,15 |
| Investmentfonds | 5,41 | 6,52 |
| Pensionsgeschäfte | 0,55 | 0,04 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,05) | 0,00 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (0,67) | 0,21 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (1,23) | k. A. |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 0,90 | 1,19 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 89,47 | 88,62 |
| Non-Agency-MBS | 0,03 | 0,03 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 0,00 | 0,00 |
| Stammaktien | 0,44 | 0,80 |
| Bezugsrechte | 0,01 | k. A. |
| Optionsscheine | 0,00 | 0,00 |
| Vorzugswertpapiere | 0,26 | 0,16 |
| Kurzfristige Instrumente | 2,64 | 1,14 |
| Investmentfonds | 5,41 | 6,52 |
| Pensionsgeschäfte | 0,55 | 0,04 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | (0,05) | 0,00 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Total Return Swaps auf Indizes | (0,01) | 0,03 |
| Devisenterminkontrakte | 0,09 | (0,03) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (0,75) | 0,21 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 1,01 | 1,29 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Caesars Resort Collection LLC** | | | | |
| 5,166 % fällig am 21.07.2025 | $ | 295 | $ 285 | 0,07 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 3,420 % fällig am 01.02.2027 | | 89 | 86 | 0,02 |
| **CommScope, Inc.** | | | | |
| 4,916 % fällig am 06.04.2026 | | 389 | 352 | 0,09 |
| **Cornerstone Building Brands, Inc.** | | | | |
| 4,574 % fällig am 12.04.2028 | | 2.136 | 1.782 | 0,44 |
| **Elanco Animal Health, Inc.** | | | | |
| 2,812 % fällig am 01.08.2027 | | 1.601 | 1.515 | 0,37 |
| **Level 3 Financing, Inc.** | | | | |
| 3,416 % fällig am 01.03.2027 | | 42 | 39 | 0,01 |
| **MH Sub LLC** | | | | |
| 5,416 % fällig am 13.09.2024 | | 191 | 180 | 0,04 |
| **RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,416 % fällig am 16.11.2025 | | 2.006 | 1.876 | 0,46 |
| **Sotera Health Holdings LLC** | | | | |
| 4,416 % fällig am 11.12.2026 | | 700 | 667 | 0,16 |
| **Southwestern Energy Co.** | | | | |
| 4,704 % fällig am 22.06.2027 | | 995 | 970 | 0,24 |
| **SS&C Technologies, Inc.** | | | | |
| 3,416 % fällig am 16.04.2025 | | 0 | 0 | 0,00 |
| **Tempo Acquisition LLC** | | | | |
| 4,525 % fällig am 31.08.2028 | | 794 | 753 | 0,18 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | | |
| 4,416 % fällig am 15.03.2024 | | 211 | 207 | 0,05 |
| **USI, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 02.12.2026 | | 195 | 185 | 0,05 |
| | | | 8.897 | 2,18 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 1,750 % fällig am 29.10.2024 | | 3.500 | 3.232 | 0,79 |
| 4,450 % fällig am 01.10.2025 | | 500 | 484 | 0,12 |
| 4,450 % fällig am 03.04.2026 | | 600 | 574 | 0,14 |
| **Aircastle Ltd.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 25.09.2023 | | 300 | 296 | 0,07 |
| **Alexandria Real Estate Equities, Inc.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.01.2028 | | 200 | 194 | 0,05 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.11.2031 | | 1.000 | 1.112 | 0,27 |
| **American Homes 4 Rent LP** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.02.2028 | | 2.900 | 2.772 | 0,68 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 2,100 % fällig am 15.06.2030 | | 200 | 160 | 0,04 |
| 2,750 % fällig am 15.01.2027 | | 2.000 | 1.831 | 0,45 |
| 3,650 % fällig am 15.03.2027 | | 2.300 | 2.186 | 0,54 |
| **Antares Holdings LP** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.01.2027 | | 1.600 | 1.279 | 0,31 |
| **Ares Capital Corp.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.06.2027 | | 800 | 668 | 0,16 |
| **Ares Finance Co. LLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.06.2030 | | 900 | 799 | 0,20 |
| 4,125 % fällig am 30.06.2051 | | 200 | 167 | 0,04 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | | 1.200 | 1.112 | 0,27 |
| **Assured Guaranty U.S. Holdings, Inc.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 15.09.2051 | | 1.700 | 1.281 | 0,31 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.11.2027 | | 400 | 353 | 0,09 |
| 3,875 % fällig am 01.05.2023 | | 1.500 | 1.488 | 0,37 |
| 4,375 % fällig am 30.01.2024 | | 100 | 98 | 0,02 |
| 4,875 % fällig am 01.10.2025 | | 1.300 | 1.262 | 0,31 |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 21.02.2026 | | 400 | 346 | 0,08 |
| 2,528 % fällig am 18.11.2027 | | 1.301 | 1.062 | 0,26 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2026 | | 400 | 389 | 0,10 |
| **AXIS Specialty Finance PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 06.12.2027 | | 200 | 194 | 0,05 |
| **Banco BTG Pactual S.A.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 31.01.2023 | | 300 | 301 | 0,07 |
| **Banco Daycoval S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 13.12.2024 | $ | 1.600 | $ 1.540 | 0,38 |
| **Banco do Brasil S.A.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.01.2025 | | 400 | 393 | 0,10 |
| **Banco Mercantil del Norte S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 27.09.2024 (e)(g) | | 500 | 472 | 0,12 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 1,898 % fällig am 23.07.2031 | | 3.300 | 2.640 | 0,65 |
| 2,687 % fällig am 22.04.2032 | | 3.200 | 2.689 | 0,66 |
| 2,972 % fällig am 04.02.2033 | | 1.100 | 938 | 0,23 |
| 3,194 % fällig am 23.07.2030 | | 1.800 | 1.615 | 0,40 |
| 4,300 % fällig am 28.01.2025 (e) | | 900 | 754 | 0,19 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 4,972 % fällig am 16.05.2029 | | 700 | 689 | 0,17 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2022 (e)(g) | £ | 800 | 970 | 0,24 |
| **BBVA Bancomer S.A.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 10.04.2024 | $ | 200 | 199 | 0,05 |
| 6,750 % fällig am 30.09.2022 | | 1.900 | 1.907 | 0,47 |
| **Berkshire Hathaway Finance Corp.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 15.05.2042 | | 300 | 283 | 0,07 |
| **BGC Partners, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.12.2025 | | 1.100 | 1.074 | 0,26 |
| **Blackstone Private Credit Fund** | | | | |
| 2,350 % fällig am 22.11.2024 | | 100 | 92 | 0,02 |
| **Block Financial LLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.08.2030 | | 1.500 | 1.351 | 0,33 |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 10.10.2024 | | 300 | 297 | 0,07 |
| **Brookfield Finance, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 30.03.2051 | | 400 | 289 | 0,07 |
| 3,900 % fällig am 25.01.2028 | | 1.400 | 1.339 | 0,33 |
| **Carlyle Finance Subsidiary LLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 19.09.2029 | | 1.900 | 1.724 | 0,42 |
| **CIFI Holdings Group Co. Ltd.** | | | | |
| 6,450 % fällig am 07.11.2024 | | 800 | 515 | 0,13 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 2,976 % fällig am 05.11.2030 | | 1.600 | 1.398 | 0,34 |
| 3,520 % fällig am 27.10.2028 | | 226 | 211 | 0,05 |
| 3,668 % fällig am 24.07.2028 | | 205 | 194 | 0,05 |
| 3,785 % fällig am 17.03.2033 (h) | | 1.300 | 1.172 | 0,29 |
| 4,075 % fällig am 23.04.2029 | | 400 | 381 | 0,09 |
| **Citizens Financial Group, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 30.04.2030 | | 500 | 444 | 0,11 |
| **Commonwealth Bank of Australia** | | | | |
| 3,784 % fällig am 14.03.2032 (g) | | 400 | 353 | 0,09 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 3,100 % fällig am 29.06.2028 (e)(g) | € | 1.200 | 946 | 0,23 |
| **Corebridge Financial, Inc.** | | | | |
| 3,850 % fällig am 05.04.2029 | $ | 900 | 833 | 0,20 |
| **Corporate Office Properties LP** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.03.2026 | | 300 | 272 | 0,07 |
| 2,750 % fällig am 15.04.2031 | | 1.400 | 1.134 | 0,28 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 12.07.2026 | | 800 | 376 | 0,09 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 2,593 % fällig am 11.09.2025 | | 400 | 377 | 0,09 |
| 4,282 % fällig am 09.01.2028 | | 1.250 | 1.168 | 0,29 |
| **Crown Castle International Corp.** | | | | |
| 2,900 % fällig am 15.03.2027 | | 400 | 369 | 0,09 |
| 3,100 % fällig am 15.11.2029 | | 900 | 795 | 0,20 |
| 4,150 % fällig am 01.07.2050 | | 700 | 583 | 0,14 |
| 4,300 % fällig am 15.02.2029 | | 600 | 577 | 0,14 |
| **CubeSmart LP** | | | | |
| 3,125 % fällig am 01.09.2026 | | 600 | 572 | 0,14 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 2,222 % fällig am 18.09.2024 | | 1.000 | 965 | 0,24 |
| 2,601 % fällig am 16.11.2022 | | 500 | 500 | 0,12 |
| 2,783 % fällig am 27.02.2023 | | 600 | 599 | 0,15 |
| 3,035 % fällig am 28.05.2032 (h) | | 400 | 317 | 0,08 |
| 3,950 % fällig am 27.02.2023 | | 1.600 | 1.597 | 0,39 |
| **Doric Nimrod Air Alpha Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,250 % fällig am 30.05.2025 | | 226 | 223 | 0,05 |
| **EPR Properties** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.06.2027 | | 450 | 408 | 0,10 |
| 4,750 % fällig am 15.12.2026 | | 100 | 94 | 0,02 |
| 4,950 % fällig am 15.04.2028 | | 400 | 368 | 0,09 |
| **ERP Operating LP** | | | | |
| 3,250 % fällig am 01.08.2027 | $ | 100 | $ 95 | 0,02 |
| **Extra Space Storage LP** | | | | |
| 2,350 % fällig am 15.03.2032 | | 400 | 318 | 0,08 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd,** | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028 | € | 200 | 194 | 0,05 |
| 4,625 % fällig am 29.04.2030 | $ | 1.400 | 1.346 | 0,33 |
| 4,850 % fällig am 17.04.2028 | | 300 | 298 | 0,07 |
| **Federal Realty OP LP** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.06.2030 | | 400 | 364 | 0,09 |
| **First American Financial Corp.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 01.02.2023 | | 200 | 200 | 0,05 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 2,386 % fällig am 17.02.2026 | € | 200 | 183 | 0,04 |
| 3,550 % fällig am 07.10.2022 | $ | 300 | 299 | 0,07 |
| **Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.10.2025 | | 600 | 567 | 0,14 |
| **Freedom Mortgage Corp.** | | | | |
| 8,125 % fällig am 15.11.2024 | | 900 | 777 | 0,19 |
| **GAIF Bond Issuer Pty. Ltd.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 30.09.2026 | | 500 | 482 | 0,12 |
| **Global Atlantic Fin Co.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.06.2031 | | 200 | 159 | 0,04 |
| 4,400 % fällig am 15.10.2029 | | 800 | 726 | 0,18 |
| **GLP Capital LP** | | | | |
| 3,350 % fällig am 01.09.2024 | | 700 | 672 | 0,16 |
| 4,000 % fällig am 15.01.2031 | | 300 | 259 | 0,06 |
| 5,750 % fällig am 01.06.2028 | | 700 | 685 | 0,17 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 2,383 % fällig am 21.07.2032 | | 1.500 | 1.214 | 0,30 |
| 2,615 % fällig am 22.04.2032 | | 1.000 | 831 | 0,20 |
| 3,691 % fällig am 05.06.2028 | | 655 | 622 | 0,15 |
| **Goodman U.S. Finance Three LLC** | | | | |
| 3,700 % fällig am 15.03.2028 | | 1.100 | 1.054 | 0,26 |
| **Great-West Lifeco Finance LP** | | | | |
| 4,581 % fällig am 17.05.2048 | | 300 | 279 | 0,07 |
| **Hanover Insurance Group, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.04.2026 | | 800 | 798 | 0,20 |
| **Healthcare Trust of America Holdings LP** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.07.2027 | | 800 | 760 | 0,19 |
| **Highwoods Realty LP** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.03.2028 | | 500 | 479 | 0,12 |
| 4,200 % fällig am 15.04.2029 | | 200 | 188 | 0,05 |
| **Host Hotels & Resorts LP** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.09.2030 | | 1.300 | 1.112 | 0,27 |
| 4,000 % fällig am 15.06.2025 | | 1.233 | 1.207 | 0,30 |
| **HSBC Capital Funding Dollar LP** | | | | |
| 10,176 % fällig am 30.06.2030 (e) | | 400 | 544 | 0,13 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 2,099 % fällig am 04.06.2026 | | 900 | 832 | 0,20 |
| 2,357 % fällig am 18.08.2031 | | 1.600 | 1.298 | 0,32 |
| 3,950 % fällig am 18.05.2024 | | 800 | 797 | 0,20 |
| 4,292 % fällig am 12.09.2026 | | 1.000 | 979 | 0,24 |
| 4,583 % fällig am 19.06.2029 | | 400 | 386 | 0,09 |
| 5,875 % fällig am 28.09.2026 (e)(g) | £ | 700 | 774 | 0,19 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2037 | $ | 100 | 107 | 0,03 |
| 6,800 % fällig am 01.06.2038 | | 220 | 238 | 0,06 |
| **Hudson Pacific Properties LP** | | | | |
| 4,650 % fällig am 01.04.2029 | | 100 | 96 | 0,02 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 4,875 % fällig am 16.05.2029 (e)(g) | | 2.100 | 1.721 | 0,42 |
| **Intercontinental Exchange, Inc.** | | | | |
| 4,350 % fällig am 15.06.2029 | | 1.400 | 1.383 | 0,34 |
| **Invitation Homes Operating Partnership LP** | | | | |
| 2,300 % fällig am 15.11.2028 | | 1.300 | 1.095 | 0,27 |
| **JAB Holdings BV** | | | | |
| 2,200 % fällig am 23.11.2030 | | 1.600 | 1.264 | 0,31 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 2,182 % fällig am 01.06.2028 | | 700 | 623 | 0,15 |
| 2,545 % fällig am 08.11.2032 | | 1.400 | 1.165 | 0,29 |
| 2,580 % fällig am 22.04.2032 | | 5.100 | 4.296 | 1,05 |
| 3,509 % fällig am 23.01.2029 | | 1.105 | 1.035 | 0,25 |
| 3,782 % fällig am 01.02.2028 | | 40 | 38 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 01.04.2025 (e) | | 2.900 | 2.396 | 0,59 |
| **Kilroy Realty LP** | | | | |
| 3,050 % fällig am 15.02.2030 | | 1.800 | 1.544 | 0,38 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **KKR Group Finance Co. LLC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 25.02.2050 | $ | 700 | $ 540 | 0,13 |
| **KWG Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 10.11.2024 | | 500 | 100 | 0,02 |
| **Lazard Group LLC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.03.2027 | | 100 | 94 | 0,02 |
| 4,500 % fällig am 19.09.2028 | | 200 | 192 | 0,05 |
| **Legg Mason, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.01.2044 | | 200 | 206 | 0,05 |
| **Life Storage LP** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.12.2027 | | 800 | 763 | 0,19 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 02.04.2032 | | 200 | 129 | 0,03 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 22.03.2028 | | 800 | 778 | 0,19 |
| **Marsh & McLennan Cos., Inc.** | | | | |
| 2,900 % fällig am 15.12.2051 | | 100 | 70 | 0,02 |
| **Mid-America Apartments LP** | | | | |
| 1,100 % fällig am 15.09.2026 | | 1.200 | 1.055 | 0,26 |
| 4,200 % fällig am 15.06.2028 | | 400 | 392 | 0,10 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | |
| 2,309 % fällig am 20.07.2032 | | 2.000 | 1.630 | 0,40 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | |
| 2,201 % fällig am 10.07.2031 | | 800 | 650 | 0,16 |
| 2,275 % fällig am 08.09.2024 | | 1.600 | 1.583 | 0,39 |
| 3,153 % fällig am 16.07.2030 | | 1.873 | 1.665 | 0,41 |
| **Morgan Stanley Domestic Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 20.06.2028 | | 1.000 | 1.002 | 0,25 |
| **MPT Operating Partnership LP** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.03.2031 | | 900 | 712 | 0,17 |
| 4,625 % fällig am 01.08.2029 | | 600 | 528 | 0,13 |
| **Muthoot Finance Ltd.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 02.09.2023 | | 1.400 | 1.363 | 0,33 |
| **Nationstar Mortgage Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.08.2028 | | 1.188 | 955 | 0,23 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 3,766 % fällig am 08.03.2024 | | 900 | 898 | 0,22 |
| 4,000 % fällig am 14.09.2026 | | 300 | 289 | 0,07 |
| **Nationwide Financial Services, Inc.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 30.11.2049 | | 500 | 408 | 0,10 |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 3,747 % fällig am 25.06.2024 | | 400 | 400 | 0,10 |
| 4,519 % fällig am 25.06.2024 | | 500 | 499 | 0,12 |
| 4,892 % fällig am 18.05.2029 | | 1.700 | 1.649 | 0,40 |
| **Neuberger Berman Group LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2027 | | 1.000 | 1.000 | 0,25 |
| **New Metro Global Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 02.05.2026 | | 200 | 93 | 0,02 |
| 6,800 % fällig am 05.08.2023 | | 700 | 479 | 0,12 |
| **Nissan Motor Acceptance Co. LLC** | | | | |
| 2,650 % fällig am 13.07.2022 | | 200 | 200 | 0,05 |
| 2,750 % fällig am 09.03.2028 | | 1.900 | 1.590 | 0,39 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | | |
| 2,924 % fällig am 28.09.2022 | | 200 | 199 | 0,05 |
| **Nomura Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,679 % fällig am 16.07.2030 | | 1.000 | 819 | 0,20 |
| 5,386 % fällig am 06.07.2027 (a) | | 2.100 | 2.103 | 0,52 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053 | DKK | 9.500 | 1.090 | 0,27 |
| **Omega Healthcare Investors, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.01.2028 | $ | 1.500 | 1.422 | 0,35 |
| 5,250 % fällig am 15.01.2026 | | 100 | 99 | 0,02 |
| **Owl Rock Capital Corp.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 11.06.2028 | | 500 | 393 | 0,10 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2023 | | 1.400 | 1.395 | 0,34 |
| **Physicians Realty LP** | | | | |
| 4,300 % fällig am 15.03.2027 | | 300 | 294 | 0,07 |
| **Prologis LP** | | | | |
| 4,375 % fällig am 01.02.2029 | | 200 | 200 | 0,05 |
| **Regency Centers LP** | | | | |
| 3,600 % fällig am 01.02.2027 | | 400 | 387 | 0,10 |
| **Sagax AB** | | | | |
| 2,250 % fällig am 13.03.2025 | € | 300 | 298 | 0,07 |
| **Santander Holdings USA, Inc.** | | | | |
| 2,490 % fällig am 06.01.2028 | $ | 700 | 618 | 0,15 |
| 4,400 % fällig am 13.07.2027 | | 400 | 385 | 0,09 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 1,532 % fällig am 21.08.2026 | $ | 1.700 | $ 1.524 | 0,37 |
| **SBA Tower Trust** | | | | |
| 1,884 % fällig am 15.07.2050 | | 1.000 | 924 | 0,23 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 29.10.2022 ^ | | 2.100 | 147 | 0,04 |
| 5,250 % fällig am 23.05.2023 ^(g) | | 600 | 42 | 0,01 |
| **SBL Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 13.11.2026 | | 1.000 | 972 | 0,24 |
| **Shriram Transport Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 5,100 % fällig am 16.07.2023 | | 800 | 767 | 0,19 |
| 5,950 % fällig am 24.10.2022 | | 200 | 198 | 0,05 |
| **SL Green Operating Partnership LP** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.10.2022 | | 200 | 200 | 0,05 |
| **SLM Corp.** | | | | |
| 4,200 % fällig am 29.10.2025 | | 500 | 454 | 0,11 |
| **SMBC Aviation Capital Finance DAC** | | | | |
| 3,550 % fällig am 15.04.2024 | | 2.000 | 1.948 | 0,48 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 06.04.2028 (e)(g) | | 400 | 355 | 0,09 |
| 7,375 % fällig am 04.10.2023 (e)(g) | | 300 | 289 | 0,07 |
| **Spirit Realty LP** | | | | |
| 3,200 % fällig am 15.02.2031 | | 100 | 84 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 15.07.2029 | | 200 | 183 | 0,04 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 3,265 % fällig am 18.02.2036 | | 200 | 162 | 0,04 |
| **Stifel Financial Corp.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.05.2030 | | 600 | 558 | 0,14 |
| **STORE Capital Corp.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2028 | | 200 | 195 | 0,05 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | |
| 1,474 % fällig am 08.07.2025 | | 2.000 | 1.840 | 0,45 |
| 3,040 % fällig am 16.07.2029 | | 600 | 535 | 0,13 |
| 3,202 % fällig am 17.09.2029 (g) | | 700 | 621 | 0,15 |
| **Teachers Insurance & Annuity Association of America** | | | | |
| 4,270 % fällig am 15.05.2047 | | 800 | 714 | 0,18 |
| **TP ICAP Finance PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 29.05.2026 | £ | 1.300 | 1.544 | 0,38 |
| **Trust Fibra Uno** | | | | |
| 4,869 % fällig am 15.01.2030 | $ | 800 | 678 | 0,17 |
| 5,250 % fällig am 15.12.2024 | | 300 | 294 | 0,07 |
| **UBS AG** | | | | |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (g) | | 3.050 | 3.059 | 0,75 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 3,126 % fällig am 13.08.2030 | | 900 | 797 | 0,20 |
| **UDR, Inc.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.08.2031 | | 900 | 770 | 0,19 |
| 3,100 % fällig am 01.11.2034 | | 300 | 247 | 0,06 |
| 3,500 % fällig am 15.01.2028 | | 300 | 284 | 0,07 |
| **VICI Properties LP** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.02.2029 | | 300 | 259 | 0,06 |
| 4,500 % fällig am 15.01.2028 | | 100 | 91 | 0,02 |
| 5,125 % fällig am 15.05.2032 | | 600 | 567 | 0,14 |
| 5,750 % fällig am 01.02.2027 | | 100 | 95 | 0,02 |
| **Vonovia SE** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.12.2025 (c) | € | 4.500 | 4.184 | 1,03 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 2,393 % fällig am 02.06.2028 | $ | 800 | 717 | 0,18 |
| 3,196 % fällig am 17.06.2027 | | 4.400 | 4.173 | 1,02 |
| 4,611 % fällig am 25.04.2053 | | 300 | 278 | 0,07 |
| **Weyerhaeuser Co.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 15.03.2032 | | 343 | 397 | 0,10 |
| **Workspace Group PLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 11.03.2028 | £ | 400 | 400 | 0,10 |
| | | | 164.575 | 40,39 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **Adani Transmission Step-One Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 03.08.2026 | $ | 400 | 377 | 0,09 |
| **Air Canada Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,300 % fällig am 15.07.2031 | | 821 | 748 | 0,18 |
| 3,750 % fällig am 15.06.2029 | | 142 | 134 | 0,03 |
| 5,250 % fällig am 01.10.2030 | | 325 | 325 | 0,08 |
| **Alaska Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,800 % fällig am 15.02.2029 | | 706 | 698 | 0,17 |
| **Alcon Finance Corp.** | | | | |
| 2,600 % fällig am 27.05.2030 | | 500 | 426 | 0,10 |
| **Allegion U.S. Holding Co., Inc.** | | | | |
| 3,550 % fällig am 01.10.2027 | $ | 1.100 | $ 1.012 | 0,25 |
| **Amdocs Ltd.** | | | | |
| 2,538 % fällig am 15.06.2030 | | 1.600 | 1.349 | 0,33 |
| **American Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,150 % fällig am 15.08.2033 | | 713 | 633 | 0,16 |
| 3,200 % fällig am 15.12.2029 | | 668 | 612 | 0,15 |
| 3,250 % fällig am 15.04.2030 | | 747 | 626 | 0,15 |
| 3,375 % fällig am 01.11.2028 | | 391 | 351 | 0,09 |
| 3,500 % fällig am 15.08.2033 | | 446 | 372 | 0,09 |
| 3,575 % fällig am 15.07.2029 | | 148 | 137 | 0,03 |
| 3,600 % fällig am 15.04.2031 | | 235 | 206 | 0,05 |
| 4,000 % fällig am 15.01.2027 | | 455 | 419 | 0,10 |
| **Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.** | | | | |
| 5,550 % fällig am 23.01.2049 | | 500 | 512 | 0,13 |
| **Ashtead Capital, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.05.2028 | | 400 | 361 | 0,09 |
| **AstraZeneca PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 17.01.2029 | | 1.400 | 1.395 | 0,34 |
| **Atlantia SpA** | | | | |
| 1,875 % fällig am 12.02.2028 | € | 1.200 | 980 | 0,24 |
| **BAE Systems PLC** | | | | |
| 3,400 % fällig am 15.04.2030 | $ | 200 | 183 | 0,05 |
| **Baptist Healthcare System Obligated Group** | | | | |
| 3,540 % fällig am 15.08.2050 | | 300 | 239 | 0,06 |
| **BAT International Finance PLC** | | | | |
| 1,668 % fällig am 25.03.2026 | | 1.800 | 1.596 | 0,39 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** | | | | |
| 2,839 % fällig am 15.12.2023 | | 900 | 895 | 0,22 |
| 4,250 % fällig am 15.12.2025 | | 1.300 | 1.285 | 0,32 |
| **Berry Global, Inc.** | | | | |
| 1,570 % fällig am 15.01.2026 | | 1.500 | 1.340 | 0,33 |
| **Boardwalk Pipelines LP** | | | | |
| 3,400 % fällig am 15.02.2031 | | 500 | 427 | 0,11 |
| **Boeing Co.** | | | | |
| 5,705 % fällig am 01.05.2040 | | 1.800 | 1.682 | 0,41 |
| 5,930 % fällig am 01.05.2060 | | 700 | 639 | 0,16 |
| **British Airways Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,300 % fällig am 15.06.2034 | | 183 | 164 | 0,04 |
| 4,125 % fällig am 20.03.2033 | | 305 | 276 | 0,07 |
| 4,250 % fällig am 15.05.2034 | | 222 | 214 | 0,05 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | |
| 3,419 % fällig am 15.04.2033 | | 500 | 414 | 0,10 |
| 3,469 % fällig am 15.04.2034 | | 569 | 464 | 0,11 |
| 4,926 % fällig am 15.05.2037 | | 2.670 | 2.397 | 0,59 |
| **Cameron LNG LLC** | | | | |
| 3,302 % fällig am 15.01.2035 | | 1.400 | 1.200 | 0,29 |
| **CDW LLC** | | | | |
| 3,569 % fällig am 01.12.2031 | | 700 | 580 | 0,14 |
| **Centene Corp.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 15.07.2028 | | 1.100 | 920 | 0,23 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 3,850 % fällig am 01.04.2061 | | 2.400 | 1.583 | 0,39 |
| 4,200 % fällig am 15.03.2028 | | 700 | 655 | 0,16 |
| **Cielo USA, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 16.11.2022 | | 600 | 599 | 0,15 |
| **Citrix Systems, Inc.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 01.03.2030 | | 600 | 586 | 0,14 |
| 4,500 % fällig am 01.12.2027 | | 600 | 594 | 0,15 |
| **Continental Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,000 % fällig am 29.04.2026 | | 231 | 222 | 0,05 |
| **Continental Resources, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.01.2031 | | 400 | 387 | 0,10 |
| **CVS Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,789 % fällig am 10.01.2026 | | 49 | 50 | 0,01 |
| 6,036 % fällig am 10.12.2028 | | 152 | 157 | 0,04 |
| **DAE Funding LLC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 15.02.2024 | | 1.950 | 1.848 | 0,45 |
| **Daimler Trucks Finance North America LLC** | | | | |
| 1,930 % fällig am 14.06.2023 | | 2.500 | 2.491 | 0,61 |
| **DaVita, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 01.06.2030 | | 2.200 | 1.723 | 0,42 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 6,020 % fällig am 15.06.2026 | | 1.950 | 2.028 | 0,50 |
| 6,200 % fällig am 15.07.2030 | | 900 | 938 | 0,23 |
| **Delta Air Lines Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,000 % fällig am 10.12.2029 | | 968 | 846 | 0,21 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Devon Energy Corp.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.09.2024 | $ | 32 | $ 33 | 0,01 |
| **Directv Financing LLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.08.2027 | | 1.100 | 942 | 0,23 |
| **Eastern Gas Transmission & Storage, Inc.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 15.11.2049 | | 2.300 | 1.856 | 0,46 |
| **eHi Car Services Ltd.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 21.09.2026 | | 700 | 421 | 0,10 |
| **Embraer Netherlands Finance BV** | | | | |
| 5,050 % fällig am 15.06.2025 | | 100 | 97 | 0,02 |
| **Energy Transfer LP** | | | | |
| 3,900 % fällig am 15.07.2026 | | 1.000 | 962 | 0,24 |
| 4,250 % fällig am 15.03.2023 | | 740 | 740 | 0,18 |
| 4,400 % fällig am 15.03.2027 | | 1.400 | 1.357 | 0,33 |
| 5,150 % fällig am 15.03.2045 | | 800 | 685 | 0,17 |
| 5,950 % fällig am 01.10.2043 | | 100 | 93 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 01.02.2042 | | 100 | 100 | 0,02 |
| **Enterprise Products Operating LLC** | | | | |
| 5,700 % fällig am 15.02.2042 | | 300 | 303 | 0,07 |
| **ERAC USA Finance LLC** | | | | |
| 3,300 % fällig am 01.12.2026 | | 1.000 | 947 | 0,23 |
| **Ferguson Finance PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 02.06.2030 | | 300 | 260 | 0,06 |
| **Fiserv, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.07.2029 | | 870 | 794 | 0,20 |
| **Flex Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.06.2025 | | 300 | 303 | 0,07 |
| **Ford Foundation** | | | | |
| 2,815 % fällig am 01.06.2070 | | 500 | 345 | 0,08 |
| **Fresenius Medical Care U.S. Finance, Inc.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 16.02.2031 | | 700 | 554 | 0,14 |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 2,949 % fällig am 24.01.2024 | € | 300 | 102 | 0,03 |
| 4,950 % fällig am 19.07.2022 | $ | 200 | 155 | 0,04 |
| 5,150 % fällig am 11.02.2026 | | 900 | 292 | 0,07 |
| **Global Payments, Inc.** | | | | |
| 2,900 % fällig am 15.05.2030 | | 600 | 507 | 0,12 |
| **goeasy Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.12.2024 | | 400 | 368 | 0,09 |
| **Greene King Finance PLC** | | | | |
| 5,318 % fällig am 15.09.2031 | £ | 118 | 148 | 0,04 |
| **GSK Consumer Healthcare Capital U.S. LLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 24.03.2029 | $ | 2.650 | 2.482 | 0,61 |
| **Health & Happiness H&H International Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 24.10.2024 | | 600 | 525 | 0,13 |
| **Humana, Inc.** | | | | |
| 2,150 % fällig am 03.02.2032 | | 1.100 | 892 | 0,22 |
| **Hyundai Capital America** | | | | |
| 2,000 % fällig am 15.06.2028 | | 1.600 | 1.347 | 0,33 |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 26.07.2029 | | 1.500 | 1.352 | 0,33 |
| 4,250 % fällig am 21.07.2025 | | 500 | 496 | 0,12 |
| **Incitec Pivot Finance LLC** | | | | |
| 3,950 % fällig am 03.08.2027 | | 500 | 480 | 0,12 |
| **Infor, Inc.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 15.07.2025 | | 600 | 556 | 0,14 |
| **Integris Baptist Medical Center, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.08.2050 | | 500 | 426 | 0,10 |
| **JetBlue Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.11.2033 | | 267 | 232 | 0,06 |
| 4,000 % fällig am 15.05.2034 | | 90 | 84 | 0,02 |
| **Kansas City Southern** | | | | |
| 3,125 % fällig am 01.06.2026 | | 300 | 290 | 0,07 |
| **Las Vegas Sands Corp.** | | | | |
| 2,900 % fällig am 25.06.2025 | | 1.500 | 1.340 | 0,33 |
| 3,200 % fällig am 08.08.2024 | | 650 | 615 | 0,15 |
| 3,500 % fällig am 18.08.2026 | | 100 | 87 | 0,02 |
| 3,900 % fällig am 08.08.2029 | | 1.000 | 818 | 0,20 |
| **Leidos, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.05.2030 | | 600 | 556 | 0,14 |
| **Magallanes, Inc.** | | | | |
| 5,050 % fällig am 15.03.2042 | | 1.200 | 1.023 | 0,25 |
| **Marriott International, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.10.2032 | | 900 | 777 | 0,19 |
| **Marvell Technology, Inc.** | | | | |
| 1,650 % fällig am 15.04.2026 | | 900 | 807 | 0,20 |
| 4,200 % fällig am 22.06.2023 | | 390 | 390 | 0,10 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Melco Resorts Finance Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 06.06.2025 | $ | 1.300 | $ 973 | 0,24 |
| 5,250 % fällig am 26.04.2026 | | 600 | 424 | 0,10 |
| 5,625 % fällig am 17.07.2027 | | 300 | 202 | 0,05 |
| **MGM China Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 18.06.2025 | | 900 | 692 | 0,17 |
| 5,375 % fällig am 15.05.2024 | | 200 | 171 | 0,04 |
| **Micron Technology, Inc.** | | | | |
| 4,663 % fällig am 15.02.2030 | | 950 | 912 | 0,22 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | |
| 6,013 % fällig am 15.12.2030 | £ | 445 | 551 | 0,14 |
| **Moody's Corp.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 20.05.2050 | $ | 900 | 671 | 0,17 |
| **Motorola Solutions, Inc.** | | | | |
| 2,300 % fällig am 15.11.2030 | | 2.300 | 1.802 | 0,44 |
| **MPLX LP** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.12.2022 | | 200 | 200 | 0,05 |
| 4,950 % fällig am 14.03.2052 | | 1.600 | 1.386 | 0,34 |
| **Newcrest Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.11.2041 | | 200 | 198 | 0,05 |
| **Norfolk Southern Corp.** | | | | |
| 4,100 % fällig am 15.05.2049 | | 45 | 40 | 0,01 |
| **NXP BV** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.03.2024 | | 1.900 | 1.920 | 0,47 |
| **ONEOK Partners LP** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.09.2023 | | 200 | 202 | 0,05 |
| **Oracle Corp.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.07.2046 | | 600 | 445 | 0,11 |
| 4,000 % fällig am 15.11.2047 | | 600 | 446 | 0,11 |
| **Pacific National Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 22.03.2028 | | 1.700 | 1.627 | 0,40 |
| **Pactiv Evergreen Group Issuer LLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.10.2028 | | 500 | 426 | 0,10 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | | |
| 4,450 % fällig am 29.01.2026 | | 100 | 99 | 0,02 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 5,950 % fällig am 28.01.2031 | | 600 | 441 | 0,11 |
| 7,690 % fällig am 23.01.2050 | | 100 | 68 | 0,02 |
| **PetSmart, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.02.2028 | | 300 | 260 | 0,06 |
| **Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC** | | | | |
| 3,050 % fällig am 23.01.2025 ^ | | 400 | 122 | 0,03 |
| **Rockies Express Pipeline LLC** | | | | |
| 3,600 % fällig am 15.05.2025 | | 600 | 545 | 0,13 |
| **S&P Global, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.08.2028 | | 600 | 610 | 0,15 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.04.2023 | | 800 | 808 | 0,20 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 2,550 % fällig am 08.03.2027 | | 300 | 219 | 0,05 |
| 3,100 % fällig am 08.03.2029 | | 1.000 | 709 | 0,17 |
| 3,250 % fällig am 08.08.2031 | | 400 | 265 | 0,07 |
| **Santos Finance Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 13.03.2029 | | 300 | 290 | 0,07 |
| **Seagate HDD Cayman** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.01.2031 | | 900 | 737 | 0,18 |
| **Southwest Airlines Co. Pass-Through Trust** | | | | |
| 6,650 % fällig am 01.08.2022 | | 16 | 16 | 0,00 |
| **Spirit AeroSystems, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2025 | | 600 | 556 | 0,14 |
| **Spirit Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,650 % fällig am 15.08.2031 | | 469 | 411 | 0,10 |
| 4,100 % fällig am 01.10.2029 | | 127 | 122 | 0,03 |
| **Studio City Co. Ltd.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.02.2027 | | 1.200 | 1.042 | 0,26 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 4,441 % fällig am 24.04.2023 | | 1.650 | 1.664 | 0,41 |
| 5,182 % fällig am 24.04.2028 | | 2.200 | 2.229 | 0,55 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | | |
| 2,550 % fällig am 15.02.2031 | | 4.000 | 3.370 | 0,83 |
| **Targa Resources Corp.** | | | | |
| 5,200 % fällig am 01.07.2027 (a) | | 1.600 | 1.608 | 0,39 |
| **TD SYNNEX Corp.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 09.08.2026 | | 3.300 | 2.912 | 0,72 |
| **Tencent Music Entertainment Group** | | | | |
| 2,000 % fällig am 03.09.2030 | | 400 | 313 | 0,08 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Tennessee Gas Pipeline Co. LLC** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.10.2028 | $ | 500 | $ 545 | 0,13 |
| **Time Warner Cable LLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.11.2040 | | 1.400 | 1.285 | 0,32 |
| **Transcontinental Gas Pipe Line Co. LLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.03.2028 | | 1.000 | 971 | 0,24 |
| **Transurban Finance Co. Pty. Ltd.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 16.03.2031 | | 150 | 123 | 0,03 |
| **Trimble, Inc.** | | | | |
| 4,150 % fällig am 15.06.2023 | | 100 | 100 | 0,02 |
| **U.S. Airways Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,900 % fällig am 01.04.2026 | | 230 | 229 | 0,06 |
| **Union Pacific Corp.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 05.02.2070 | | 200 | 159 | 0,04 |
| **United Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,700 % fällig am 01.11.2033 | | 364 | 311 | 0,08 |
| 2,875 % fällig am 07.04.2030 | | 410 | 375 | 0,09 |
| 3,100 % fällig am 07.04.2030 | | 229 | 196 | 0,05 |
| 3,700 % fällig am 01.09.2031 | | 500 | 444 | 0,11 |
| 3,750 % fällig am 03.03.2028 | | 635 | 606 | 0,15 |
| 4,000 % fällig am 11.10.2027 | | 185 | 174 | 0,04 |
| 4,150 % fällig am 11.10.2025 | | 557 | 547 | 0,13 |
| 4,150 % fällig am 25.02.2033 | | 199 | 188 | 0,05 |
| 4,550 % fällig am 25.02.2033 | | 80 | 71 | 0,02 |
| **Vale Overseas Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 08.07.2030 | | 100 | 88 | 0,02 |
| **Verisk Analytics, Inc.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.03.2029 | | 200 | 193 | 0,05 |
| **Vmed O2 UK Financing PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 31.01.2031 | € | 1.100 | 890 | 0,22 |
| **VMware, Inc.** | | | | |
| 4,650 % fällig am 15.05.2027 | $ | 750 | 747 | 0,18 |
| 4,700 % fällig am 15.05.2030 | | 900 | 869 | 0,21 |
| **Weibo Corp.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 08.07.2030 | | 700 | 569 | 0,14 |
| **Weir Group PLC** | | | | |
| 2,200 % fällig am 13.05.2026 | | 1.500 | 1.321 | 0,32 |
| **Westinghouse Air Brake Technologies Corp.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.11.2026 | | 100 | 91 | 0,02 |
| **Woodside Finance Ltd.** | | | | |
| 3,650 % fällig am 05.03.2025 | | 1.100 | 1.082 | 0,27 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.10.2027 | | 1.400 | 908 | 0,22 |
| **Xiaomi Best Time International Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 14.07.2031 | | 400 | 310 | 0,08 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.08.2035 | | 228 | 209 | 0,05 |
| | | | 115.539 | 28,35 |

| VERSORGUNGSUNTERNEHMEN | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **AEP Texas, Inc.** | | | | |
| 6,650 % fällig am 15.02.2033 | | 300 | 346 | 0,08 |
| **Ameren Illinois Co.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.03.2050 | | 400 | 314 | 0,08 |
| **American Electric Power Co., Inc.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 01.12.2028 | | 455 | 444 | 0,11 |
| **Appalachian Power Co.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 01.04.2038 | | 900 | 1.047 | 0,26 |
| **Arizona Public Service Co.** | | | | |
| 2,200 % fällig am 15.12.2031 | | 1.700 | 1.376 | 0,34 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 01.12.2057 | | 1.264 | 979 | 0,24 |
| **Black Hills Corp.** | | | | |
| 3,150 % fällig am 15.01.2027 | | 400 | 382 | 0,09 |
| **CenterPoint Energy, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.11.2028 | | 90 | 88 | 0,02 |
| **Clearway Energy Operating LLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.02.2031 | | 200 | 162 | 0,04 |
| **Cleveland Electric Illuminating Co.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.04.2028 | | 1.561 | 1.470 | 0,36 |
| **Consolidated Edison Co. of New York, Inc.** | | | | |
| 5,300 % fällig am 01.03.2035 | | 900 | 937 | 0,23 |
| **Duke Energy Carolinas LLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.01.2038 | | 50 | 56 | 0,01 |
| **Edison International** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.12.2026 (e) | | 500 | 399 | 0,10 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Entergy Corp.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 15.06.2028 | $ | 200 | $ 172 | 0,04 |
| **Entergy Mississippi LLC** | | | | |
| 2,850 % fällig am 01.06.2028 | | 1.700 | 1.568 | 0,38 |
| **Exelon Corp.** | | | | |
| 4,050 % fällig am 15.04.2030 | | 800 | 768 | 0,19 |
| **FirstEnergy Transmission LLC** | | | | |
| 4,350 % fällig am 15.01.2025 | | 1.400 | 1.379 | 0,34 |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC** | | | | |
| 2,950 % fällig am 27.01.2029 | | 3.400 | 1.020 | 0,25 |
| 3,250 % fällig am 25.02.2030 | | 1.100 | 330 | 0,08 |
| **Georgia Power Co.** | | | | |
| 4,700 % fällig am 15.05.2032 | | 1.800 | 1.807 | 0,44 |
| **Greenko Solar Mauritius Ltd.** | | | | |
| 5,550 % fällig am 29.01.2025 | | 500 | 470 | 0,12 |
| 5,950 % fällig am 29.07.2026 | | 800 | 715 | 0,18 |
| **India Green Energy Holdings** | | | | |
| 5,375 % fällig am 29.04.2024 | | 250 | 234 | 0,06 |
| **Interstate Power & Light Co.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 01.04.2029 | | 1.400 | 1.335 | 0,33 |
| **Ipalco Enterprises, Inc.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 01.09.2024 | | 1.500 | 1.484 | 0,36 |
| **Jersey Central Power & Light Co.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 15.01.2026 | | 1.100 | 1.088 | 0,27 |
| **Mississippi Power Co.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 30.03.2028 | | 500 | 487 | 0,12 |
| **New York State Electric & Gas Corp.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 15.09.2049 | | 2.010 | 1.546 | 0,38 |
| **NGPL PipeCo LLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.08.2027 | | 700 | 693 | 0,17 |
| **NiSource, Inc.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 01.05.2030 | | 300 | 275 | 0,07 |
| **Northern States Power Co.** | | | | |
| 2,600 % fällig am 01.06.2051 | | 2.000 | 1.413 | 0,35 |
| **ONEOK, Inc.** | | | | |
| 4,550 % fällig am 15.07.2028 | | 200 | 194 | 0,05 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | | |
| 2,100 % fällig am 01.08.2027 | | 2.300 | 1.930 | 0,47 |
| 2,500 % fällig am 01.02.2031 | | 200 | 153 | 0,04 |
| 3,000 % fällig am 15.06.2028 | | 900 | 776 | 0,19 |
| 3,150 % fällig am 01.01.2026 | | 100 | 92 | 0,02 |
| 3,750 % fällig am 01.07.2028 | | 300 | 265 | 0,07 |
| 4,250 % fällig am 15.03.2046 ^ | | 1.100 | 805 | 0,20 |
| 4,300 % fällig am 15.03.2045 ^ | | 100 | 73 | 0,02 |
| **Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara** | | | | |
| 3,000 % fällig am 30.06.2030 | | 800 | 657 | 0,16 |
| **Piedmont Natural Gas Co., Inc.** | | | | |
| 3,350 % fällig am 01.06.2050 | | 1.400 | 1.046 | 0,26 |
| **Progress Energy, Inc.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.03.2031 | | 204 | 239 | 0,06 |
| **Public Service Co. of Oklahoma** | | | | |
| 2,200 % fällig am 15.08.2031 | | 450 | 376 | 0,09 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | | |
| 8,200 % fällig am 06.04.2028 | | 224 | 233 | 0,06 |
| **San Diego Gas & Electric Co.** | | | | |
| 4,100 % fällig am 15.06.2049 | | 1.100 | 978 | 0,24 |
| **Southern California Edison Co.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 01.08.2029 | | 800 | 710 | 0,17 |
| 3,900 % fällig am 01.12.2041 | | 108 | 88 | 0,02 |
| 4,200 % fällig am 01.03.2029 | | 200 | 193 | 0,05 |
| 5,950 % fällig am 01.02.2038 | | 200 | 207 | 0,05 |
| 6,650 % fällig am 01.04.2029 | | 2.035 | 2.178 | 0,53 |
| **Southern Co. Gas Capital Corp.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.06.2026 | $ | 2.700 | $ 2.595 | 0,64 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.11.2022 | | 300 | 302 | 0,07 |
| **Sprint Corp.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.09.2023 | | 400 | 414 | 0,10 |
| **Systems Energy Resources, Inc.** | | | | |
| 2,140 % fällig am 09.12.2025 | | 800 | 743 | 0,18 |
| **Targa Resources Partners LP** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.03.2030 | | 300 | 287 | 0,07 |
| **Transcanada Trust** | | | | |
| 5,300 % fällig am 15.03.2077 | | 50 | 45 | 0,01 |
| **Washington Gas Light Co.** | | | | |
| 3,650 % fällig am 15.09.2049 | | 600 | 498 | 0,12 |
| | | | 40.861 | 10,03 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 320.975 | 78,77 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.08.2052 | | 3.300 | 3.071 | 0,75 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2052 | | 4.640 | 4.458 | 1,10 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2052 | | 6.700 | 6.598 | 1,62 |
| | | | 14.127 | 3,47 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.02.2052 | | 3.200 | 2.634 | 0,65 |
| 2,875 % fällig am 15.05.2052 | | 3.100 | 2.929 | 0,72 |
| 3,250 % fällig am 15.05.2042 | | 800 | 781 | 0,19 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 1,875 % fällig am 15.02.2032 | | 8.847 | 8.017 | 1,97 |
| 2,875 % fällig am 15.05.2032 | | 3.506 | 3.467 | 0,85 |
| | | | 17.828 | 4,38 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,826 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 38 | 33 | 0,01 |
| **Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust** | | | | |
| 1,482 % fällig am 25.11.2034 | | 195 | 183 | 0,04 |
| | | | 216 | 0,05 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 236 | 226 | 0,05 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,824 % fällig am 25.01.2037 | | 1.153 | 602 | 0,15 |
| **Ellington Loan Acquisition Trust** | | | | |
| 2,724 % fällig am 25.05.2037 | | 223 | 216 | 0,05 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,599 % fällig am 25.07.2034 | | 1.002 | 986 | 0,24 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,329 % fällig am 25.02.2036 | | 182 | 151 | 0,04 |
| | | | 2.181 | 0,53 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Emirate of Abu Dhabi Government International Bond** | | | | |
| 3,125 % fällig am 16.04.2030 | | 600 | 570 | 0,14 |
| **Export-Import Bank of India** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.01.2030 | | 400 | 348 | 0,08 |
| **Italy Government International Bond** | | | | |
| 6,875 % fällig am 27.09.2023 | | 600 | 623 | 0,15 |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,400 % fällig am 12.08.2034 | PEN | 400 | $ 85 | 0,02 |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | | 3.000 | 722 | 0,18 |
| 6,950 % fällig am 12.08.2031 | | 3.900 | 975 | 0,24 |
| 8,200 % fällig am 12.08.2026 | | 7.800 | 2.147 | 0,53 |
| **Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia** | | | | |
| 2,800 % fällig am 23.06.2030 | $ | 300 | 263 | 0,06 |
| **Romania Government International Bond** | | | | |
| 3,750 % fällig am 07.02.2034 | € | 400 | 314 | 0,08 |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 10,500 % fällig am 21.12.2026 | ZAR | 62.900 | 4.066 | 1,00 |
| **Ukraine Government International Bond** | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.09.2022 | $ | 300 | 170 | 0,04 |
| | | | 10.283 | 2,52 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **FINANZWERTE** | | | | |
| **Stearns Holdings LLC 'B' (b)** | | 14.062 | 0 | 0,00 |
| **OPTIONSSCHEINE** | | | | |
| **Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31. Dezember 2060** | | 68 | 0 | 0,00 |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | | |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.09.2026 | | 40.800 | 717 | 0,18 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | | |
| **Future Diamond Ltd.** | | | | |
| 0,363 % fällig am 22.09.2022 | $ | 600 | 560 | 0,14 |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | | |
| 51,049 % fällig am 30.09.2022 (c)(d) | ARS | 47.600 | 160 | 0,04 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 720 | 0,18 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **$ 375.944** | **92,26** |
| | | **AKTIEN** | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (f)** | | 139.306 | 1.183 | 0,29 |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (f)** | | 212.886 | 1.818 | 0,45 |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)** | | 3.096.544 | 30.804 | 7,56 |
| **Summe Investmentfonds** | | | **$33.805** | **8,30** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 1.034 | U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.06.2024 | $ (1.055) | $ 1.034 | $ 1.034 | 0,25 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (1.055)** | **$ 1.034** | **$ 1.034** | **0,25** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month SOFR December Futures | Long | 03.2024 | 158 | $ 90 | 0,02 |
| Euro-Bobl September Futures | Long | 09.2022 | 26 | (1) | 0,00 |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2022 | 93 | 418 | 0,10 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Long | 09.2022 | 399 | (968) | (0,24) |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09.2022 | 79 | (220) | (0,05) |
| | | | | $ (681) | (0,17) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ (681)** | **(0,17)** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Airbus Group Finance BV | 1,000 % | 20.12.2025 | € 200 | $ (4) | 0,00 |
| American International Group, Inc. | 1,000 | 20.12.2026 | $ 500 | (10) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.12.2023 | 1.400 | (16) | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.12.2026 | 900 | (22) | (0,01) |
| Bank of America Corp. | 1,000 | 20.12.2022 | 2.500 | (12) | 0,00 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 | 20.12.2022 | 1.700 | (27) | (0,01) |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.06.2023 | 500 | (4) | 0,00 |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.12.2026 | 500 | (25) | (0,01) |
| Boeing Co. | 1,000 | 20.06.2027 | 2.900 | (31) | (0,01) |
| BP Capital Markets PLC | 1,000 | 20.12.2025 | € 700 | (13) | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.12.2024 | 400 | (4) | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.12.2025 | 200 | (2) | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.12.2027 | 300 | (6) | 0,00 |
| British Telecommunications PLC | 1,000 | 20.06.2028 | 1.100 | (36) | (0,01) |
| Devon Energy Corp. | 1,000 | 20.12.2026 | $ 800 | (19) | 0,00 |
| DISH DBS Corp. | 5,000 | 20.06.2023 | 200 | (22) | (0,01) |
| Enbridge, Inc. | 1,000 | 20.12.2026 | 900 | (10) | 0,00 |
| Exelon Generation Co. LLC | 1,000 | 20.12.2024 | 1.600 | 4 | 0,00 |
| Expedia Group, Inc. | 1,000 | 20.12.2026 | 300 | (15) | 0,00 |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20.12.2024 | 1.300 | (103) | (0,03) |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2023 | 500 | 8 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2024 | 300 | 6 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2026 | 1.200 | (33) | (0,01) |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2026 | 200 | (8) | 0,00 |
| General Motors Co. | 5,000 | 20.12.2026 | 1.900 | (198) | (0,05) |
| Hess Corp. | 1,000 | 20.12.2026 | 1.200 | (31) | (0,01) |
| MetLife, Inc. | 1,000 | 20.12.2022 | 300 | (4) | 0,00 |
| MetLife, Inc. | 1,000 | 20.12.2023 | 200 | (2) | 0,00 |
| MetLife, Inc. | 1,000 | 20.12.2024 | 1.400 | (20) | 0,00 |
| National Rural Utilities Cooperative Finance Corp. | 1,000 | 20.12.2026 | 200 | 0 | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.12.2024 | € 3.300 | 289 | 0,07 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.12.2025 | 1.000 | 4 | 0,00 |
| Sherwin-Williams Co. | 1,000 | 20.12.2022 | $ 300 | (5) | 0,00 |
| Southwest Airlines Co. | 1,000 | 20.12.2026 | 550 | (11) | 0,00 |
| Telefonica Emisiones S.A. | 1,000 | 20.06.2028 | € 800 | (15) | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 | 20.12.2024 | 1.000 | (20) | (0,01) |
| Tesco PLC | 1,000 | 20.12.2027 | 2.400 | (73) | (0,02) |
| Tesco PLC | 1,000 | 20.06.2028 | 500 | (20) | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20.06.2026 | $ 1.200 | (32) | (0,01) |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20.12.2026 | 1.800 | (56) | (0,01) |
| Vodafone Group PLC | 1,000 | 20.06.2023 | € 100 | (2) | 0,00 |
| Vodafone Group PLC | 1,000 | 20.06.2024 | 200 | (3) | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 | 20.06.2028 | 1.600 | (107) | (0,03) |
| | | | | $ (710) | (0,17) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-38 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2027 | $ 28.200 | $ (442) | (0,11) |
| iTraxx Crossover 37 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2027 | € 1.500 | (69) | (0,02) |
| iTraxx Europe Main 36 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2026 | 1.400 | (10) | 0,00 |
| iTraxx Europe Main 37 10-Year Index | 1,000 | 20.06.2027 | 1.300 | (17) | 0,00 |
| | | | | $ (538) | (0,13) |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,500 % | 21.09.2027 | £ | 700 | $ 29 | 0,01 |
| Erhalt[3] | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 | 21.09.2032 | | 5.700 | 449 | 0,11 |
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 1,101 | 21.02.2052 | | 200 | (56) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 1,175 | 28.02.2052 | | 500 | (129) | (0,03) |
| Erhalt | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,300 | 20.03.2028 | ¥ | 231.200 | 50 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 1,000 | 15.06.2027 | $ | 33.700 | 1.486 | 0,37 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,665 | 04.01.2027 | BRL | 26.900 | (117) | (0,03) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,963 | 22.04.2031 | CAD | 3.300 | (321) | (0,08) |
| Zahlung[3] | 3-Month USD-LIBOR | 1,270 | 04.11.2023 | $ | 25.600 | (113) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,195 | 25.04.2027 | ZAR | 22.300 | 44 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,300 | 28.04.2027 | | 3.900 | 7 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 13.05.2027 | € | 3.300 | (107) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.05.2027 | | 1.500 | (49) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 1,000 | 19.09.2023 | HUF | 115.000 | (35) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 1,250 | 19.09.2023 | | 352.100 | (112) | (0,03) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,015 | 03.06.2026 | MXN | 93.700 | (477) | (0,12) |
| | | | | | | $ 549 | 0,13 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | | **$ (699)** | **(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**

## OPTIONSKAUF

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,000 % | 15.03.2023 | 2.310 | $ 263 | $ 1.090 | 0,26 |
| JPM | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,000 | 15.03.2023 | 1.540 | 170 | 727 | 0,18 |
| | | | | | | | $ 433 | $ 1.817 | 0,44 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 % | 20.07.2022 | 1.500 | $ (2) | $ (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Crossover 36 5-Year Index | Verkauf | 5,250 | 20.07.2022 | 500 | (5) | (10) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 4.600 | (13) | (15) | (0,01) |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 1.600 | (3) | (1) | 0,00 |
| BRC | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 400 | (4) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 1.400 | (6) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,600 | 17.08.2022 | 500 | (1) | (1) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 400 | (1) | 0 | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,400 | 17.08.2022 | 800 | (2) | (1) | 0,00 |
| GST | Call - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Kauf | 0,700 | 17.08.2022 | 500 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,300 | 17.08.2022 | 1.500 | (3) | (3) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 95,000 | 17.08.2022 | 300 | (4) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Crossover 37 5-Year Index | Verkauf | 7,000 | 17.08.2022 | 900 | (8) | (10) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 36 5-Year Index | Verkauf | 1,100 | 20.07.2022 | 2.900 | (11) | (11) | (0,01) |
| | Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 900 | (3) | (3) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,250 | 20.07.2022 | 600 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,350 | 17.08.2022 | 1.000 | (2) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ (70) | $ (70) | (0,02) |

## ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,175 % | 15.03.2023 | 6.930 | $ (257) | $ (1.665) | (0,41) |
| CBK | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,600 | 07.07.2022 | 800 | (3) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,000 | 07.07.2022 | 800 | (3) | (1) | 0,00 |
| DUB | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Erhalt | 0,350 | 08.08.2022 | 1.600 | (6) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,550 | 08.08.2022 | 1.600 | (6) | (32) | (0,01) |
| GLM | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,870 | 02.11.2022 | 95.900 | (195) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,270 | 02.11.2022 | 95.900 | (194) | (2.198) | (0,54) |
| JPM | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR | Zahlung | 0,175 | 15.03.2023 | 4.620 | (167) | (1.110) | (0,27) |
| MYC | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,570 | 05.07.2022 | 800 | (3) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,970 | 05.07.2022 | 800 | (3) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | $ (837) | $ (5.007) | (1,23) |

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SAL | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2052 | $ 99,156 | 07.07.2022 | 1.000 | $ (7) | $ (6) | 0,00 |

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag(2) | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2026 | $ 100 | $ (4) | $ (1) | $ (5) | 0,00 |
| BRC | Alibaba Group Holding Ltd. | 1,000 | 20.12.2024 | 400 | 5 | (4) | 1 | 0,00 |
| | Italy Government International Bond | 1,000 | 20.06.2025 | 2.100 | (51) | 64 | 13 | 0,00 |
| | NextEra Energy Capital Holdings, Inc. | 1,000 | 20.12.2025 | 500 | 11 | (5) | 6 | 0,00 |
| | Pertamina Persero PT | 1,000 | 20.12.2024 | 400 | (2) | 4 | 2 | 0,00 |
| | Petroleos Mexicanos | 1,000 | 20.06.2023 | 500 | (27) | 12 | (15) | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 1.000 | (66) | (684) | (750) | (0,18) |
| CBK | Petroleos Mexicanos | 1,000 | 20.06.2023 | 100 | (6) | 3 | (3) | 0,00 |
| DUB | Saudi Arabia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2025 | 300 | 0 | 5 | 5 | 0,00 |
| FBF | Italy Government International Bond | 1,000 | 20.06.2025 | 700 | (11) | 20 | 9 | 0,00 |
| GLM | Italy Government International Bond | 1,000 | 20.06.2025 | 2.300 | (26) | 69 | 43 | 0,01 |
| GST | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 200 | (2) | 2 | 0 | 0,00 |
| | Saudi Arabia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2025 | 300 | 0 | 5 | 5 | 0,00 |
| JPM | Saudi Arabia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2025 | 400 | 0 | 6 | 6 | 0,00 |
| MYC | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 1.000 | (62) | (22) | (84) | (0,02) |
| | Brookfield Asset Management, Inc. | 1,000 | 20.06.2025 | 300 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 100 | (1) | 1 | 0 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2026 | 200 | 1 | (6) | (5) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2027 | 400 | (1) | (12) | (13) | 0,00 |
| | | | | | $ (242) | $ (544) | $ (786) | (0,19) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag(2) | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 % | 5,000 % | 20.12.2023 | $ 100 | $ 12 | $ (8) | $ 4 | 0,00 |
| CBK | CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2023 | 100 | 10 | (6) | 4 | 0,00 |
| GST | CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2023 | 400 | 48 | (30) | 18 | 0,01 |
| JPM | CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2023 | 300 | 33 | (19) | 14 | 0,00 |
| | | | | | $ 103 | $ (63) | $ 40 | 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 | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | AUD 486 | $ 338 | $ 4 | $ 0 | $ 4 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ 338 | AUD 486 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | AUD 689 | $ 479 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ 4.046 | 5.115 | 203 | 0 | 203 | 0,05 |
| | 07.2022 | $ 1.015 | DKK 7.137 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07.2022 | 206 | € 196 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | 1.100 | PEN 4.445 | 67 | 0 | 67 | 0,02 |
| | 07.2022 | ZAR 7.950 | $ 518 | 33 | 0 | 33 | 0,01 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08.2022 | DKK | 7.122 | $ | 1.015 | $ 12 | $ 0 | $ 12 | 0,00 |
| | 08.2022 | MXN | 4.145 | | 190 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 479 | AUD | 689 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 180 | MXN | 3.648 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | | 753 | NOK | 7.173 | 0 | (27) | (27) | (0,01) |
| | 08.2022 | | 308 | PEN | 1.150 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 09.2022 | PEN | 6.834 | $ | 1.769 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| BPS | 07.2022 | BRL | 3.040 | | 590 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 30.607 | | 1.523 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07.2022 | PLN | 33 | | 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 10.465 | € | 9.945 | 0 | (68) | (68) | (0,02) |
| | 07.2022 | | 417 | £ | 342 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 1.521 | MXN | 31.810 | 56 | 0 | 56 | 0,01 |
| | 08.2022 | € | 9.710 | $ | 10.232 | 61 | 0 | 61 | 0,01 |
| | 08.2022 | MXN | 35.963 | | 1.637 | 0 | (134) | (134) | (0,03) |
| | 08.2022 | $ | 585 | BRL | 3.040 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 159 | IDR | 2.349.970 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 27 | INR | 2.079 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | ZAR | 2.725 | $ | 174 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 09.2022 | $ | 1.501 | MXN | 30.607 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | € | 346 | $ | 365 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 103 | | 130 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 1.030 | AUD | 1.426 | 0 | (49) | (49) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 763 | € | 716 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 419 | £ | 343 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 175 | IDR | 2.585.483 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 1.319 | NOK | 12.909 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| CBK | 07.2022 | PEN | 25.372 | $ | 6.455 | 15 | (228) | (213) | (0,05) |
| | 07.2022 | $ | 318 | PEN | 1.195 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07.2022 | ZAR | 22.453 | $ | 1.495 | 127 | 0 | 127 | 0,03 |
| | 08.2022 | $ | 2.320 | PEN | 8.673 | 0 | (46) | (46) | (0,01) |
| | 03.2023 | PEN | 8.086 | $ | 2.093 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| DUB | 07.2022 | DKK | 1.980 | | 293 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 26 | PEN | 94 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 12.2022 | ZAR | 10.977 | $ | 699 | 39 | 0 | 39 | 0,01 |
| GLM | 07.2022 | $ | 612 | BRL | 3.040 | 0 | (31) | (31) | (0,01) |
| | 07.2022 | | 847 | MXN | 17.294 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07.2022 | | 753 | PEN | 2.819 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 10.2022 | MXN | 806 | $ | 39 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 12.2022 | | 14.441 | | 709 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 05.2023 | ZAR | 202 | | 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | £ | 74 | | 91 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 1.326 | | 67 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 207 | ZAR | 3.333 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 336 | IDR | 4.943.312 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | DKK | 6.655 | $ | 987 | 52 | 0 | 52 | 0,01 |
| | 07.2022 | € | 37 | | 39 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | £ | 8 | | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | MXN | 1.203 | | 58 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 213 | DKK | 1.498 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07.2022 | | 293 | £ | 241 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | DKK | 1.495 | $ | 213 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 197 | IDR | 2.908.573 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08.2022 | | 45 | INR | 3.491 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| RYL | 08.2022 | | 165 | ZAR | 2.725 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | € | 10.315 | $ | 11.050 | 267 | 0 | 267 | 0,07 |
| | 07.2022 | $ | 745 | PEN | 2.819 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 08.2022 | NOK | 2.350 | $ | 245 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08.2022 | $ | 947 | PEN | 3.537 | 0 | (20) | (20) | (0,01) |
| | 09.2022 | | 1.534 | CLP | 1.276.602 | 0 | (193) | (193) | (0,05) |
| | 09.2022 | ZAR | 10.010 | $ | 647 | 41 | 0 | 41 | 0,01 |
| | 11.2022 | $ | 977 | COP | 4.152.103 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 11.2022 | ZAR | 10.628 | $ | 704 | 63 | 0 | 63 | 0,02 |
| | | | | | | $ 1.138 | $ (942) | $ 196 | 0,05 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | € | 1.633 | $ | 1.753 | $ 45 | $ 0 | $ 45 | 0,01 |
| BOA | 07.2022 | | 1 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ | 73.538 | € | 68.604 | 0 | (1.816) | (1.816) | (0,45) |
| BPS | 07.2022 | € | 53.522 | $ | 56.295 | 340 | 0 | 340 | 0,08 |
| | 07.2022 | $ | 58.474 | € | 54.418 | 0 | (1.583) | (1.583) | (0,39) |
| | 08.2022 | | 56.398 | | 53.522 | 0 | (339) | (339) | (0,08) |
| BRC | 07.2022 | € | 27.264 | $ | 29.230 | 727 | 0 | 727 | 0,18 |
| | 07.2022 | $ | 70 | € | 66 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPM | 07.2022 | € 2.115 | $ 2.240 | $ 29 | $ 0 | $ 29 | 0,01 |
| MYI | 07.2022 | 317 | 334 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 21 | € 20 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | € 1 | $ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 71.153 | € 66.423 | 0 | (1.711) | (1.711) | (0,42) |
| | | | | $ 1.143 | $ (5.451) | $ (4.308) | (1,06) |

Zum 30. Juni 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | £ 178 | $ 222 | $ 6 | $ 0 | $ 6 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 8.762 | £ 6.930 | 0 | (346) | (346) | (0,08) |
| BPS | 07.2022 | £ 83 | $ 103 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 34 | £ 28 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | £ 32 | $ 39 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 8.997 | £ 7.132 | 0 | (335) | (335) | (0,08) |
| CBK | 07.2022 | £ 1.251 | $ 1.519 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| JPM | 07.2022 | 80 | 97 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MYI | 07.2022 | 188 | 233 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 10 | £ 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | £ 15 | $ 19 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 8.422 | £ 6.699 | 0 | (286) | (286) | (0,07) |
| | | | | $ 14 | $ (968) | $ (954) | (0,23) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **$ (9.078)** | **(2,23)** |

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Uniform Mortgage-Backed Security, TBA** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.07.2052 | $ 2.500 | $ (2.170) | (0,53) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (2.170)** | **(0,53)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 398.155** | **97,71** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ 9.315** | **2,29** |
| **Nettovermögen** | | **$ 407.470** | **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.**

**(h)** **Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeits-datum | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Citigroup, Inc. | 3,785 % | 17.03.2033 | 10.03.2022 | $ 1.300 | $ 1.172 | 0,29 |
| Deutsche Bank AG | 3,035 | 28.05.2032 | 21.06.2021 | 405 | 317 | 0,08 |
| | | | | $ 1.705 | $ 1.489 | 0,37 |

**Barmittel in Höhe von USD 9.706 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 9.450 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 717 | $ 375.227 | $ 0 | $ 375.944 |
| Investmentfonds | 33.805 | 0 | 0 | 33.805 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 1.034 | 0 | 1.034 |
| Finanzderivate[3] | 417 | (10.875) | 0 | (10.458) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (2.170) | 0 | (2.170) |
| **Summen** | **$ 34.939** | **$ 363.216** | **$ 0** | **$ 398.155** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 1.017 | $ 880.499 | $ 10 | $ 881.526 |
| Investmentfonds | 6.571 | 0 | 0 | 6.571 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 686 | 0 | 686 |
| Finanzderivate[3] | 258 | 7.482 | 0 | 7.740 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0 | (3.780) | 0 | (3.780) |
| **Summen** | **$ 7.846** | **$ 884.887** | **$ 10** | **$ 892.743** |

(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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ 45 | $ 0 | $ 45 |
| BOA | (1.950) | 1.960 | 10 |
| BPS | (2.231) | 2.130 | (101) |
| BRC | (432) | 710 | 278 |
| CBK | (125) | 220 | 95 |
| DUB | 25 | 0 | 25 |
| FBF | 9 | 0 | 9 |
| GLM | (2.174) | 2.300 | 126 |
| GST | 20 | 0 | 20 |
| JPM | (369) | 360 | (9) |
| MYC | (104) | 90 | (14) |
| MYI | 52 | (270) | (218) |
| RYL | 1 | 0 | 1 |
| SAL | (6) | 0 | (6) |
| SCX | (1.839) | 1.680 | (159) |

(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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 61,08 | 71,45 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 30,09 | 27,82 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 1,09 | 1,12 |
| Investmentfonds | 8,30 | 0,75 |
| Pensionsgeschäfte | 0,25 | 0,08 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,17) | 0,03 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,17) | (0,19) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (2,23) | 1,04 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (0,53) | (0,43) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | k. A. | (3,02) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 2,18 | 1,85 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 78,77 | 85,36 |
| US-Regierungsbehörden | 3,47 | 1,41 |
| US-Schatzobligationen | 4,38 | 9,92 |
| Non-Agency-MBS | 0,05 | 0,03 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 0,53 | 0,27 |
| Staatsemissionen | 2,52 | 1,37 |
| Stammaktien | 0,00 | 0,00 |
| Optionsscheine | 0,00 | 0,00 |
| Vorzugswertpapiere | 0,18 | 0,12 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,18 | 0,06 |
| Investmentfonds | 8,30 | 0,75 |
| Pensionsgeschäfte | 0,25 | 0,08 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,17) | 0,03 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,17) | 0,07 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | (0,13) | 0,03 |
| Zinsswaps | 0,13 | (0,29) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoptionen | 0,44 | 0,09 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,02) | 0,00 |
| Zinsswapoptionen | (1,23) | (0,17) |
| Optionen auf Wertpapiere | 0,00 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,19) | 0,01 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf | 0,01 | 0,01 |
| Devisenterminkontrakte | 0,05 | (0,07) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (1,29) | 1,17 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (0,53) | (0,43) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 2,29 | (1,67) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Driver Australia Six Trust** | | | | |
| 1,944 % fällig am 21.12.2027 | AUD | 1.453 | $ 998 | 0,04 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ausgrid Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 1,932 % fällig am 30.10.2024 | | 6.100 | 4.199 | 0,17 |
| 3,750 % fällig am 30.10.2024 | | 4.690 | 3.166 | 0,13 |
| 3,850 % fällig am 01.05.2023 | $ | 6.300 | 6.301 | 0,25 |
| **Boral Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.11.2022 | | 2.220 | 2.214 | 0,09 |
| **ING Bank Australia Ltd.** | | | | |
| 1,865 % fällig am 26.05.2025 | AUD | 10.200 | 7.000 | 0,28 |
| **Pacific National Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 07.04.2023 | $ | 1.200 | 1.214 | 0,05 |
| **Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 22.03.2023 | | 6.880 | 6.890 | 0,28 |
| **Toyota Finance Australia Ltd.** | | | | |
| 1,913 % fällig am 09.09.2024 | AUD | 2.000 | 1.361 | 0,05 |
| 2,317 % fällig am 26.03.2024 | | 1.000 | 684 | 0,03 |
| **Transurban Queensland Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 3,793 % fällig am 16.12.2024 | | 1.570 | 1.105 | 0,04 |
| **Victoria Power Networks Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 1,554 % fällig am 23.08.2024 | | 3.000 | 2.042 | 0,08 |
| **Volkswagen Financial Services Australia Pty. Ltd.** | | | | |
| 2,922 % fällig am 14.09.2022 | | 2.000 | 1.377 | 0,06 |
| | | | 37.553 | 1,51 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **FirstMac Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 1,960 % fällig am 08.03.2049 | $ | 183 | 183 | 0,01 |
| Summe Australien | | | 38.734 | 1,56 |
| **BELGIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Barry Callebaut Services NV** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.06.2023 | | 9.119 | 9.177 | 0,37 |
| **BERMUDA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aircastle Ltd.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 25.09.2023 | | 1.000 | 987 | 0,04 |
| 5,000 % fällig am 01.04.2023 | | 8.098 | 8.091 | 0,33 |
| Summe Bermuda | | | 9.078 | 0,37 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Apidos CLO** | | | | |
| 1,974 % fällig am 17.07.2030 | | 1.000 | 986 | 0,04 |
| **Atlas Senior Loan Fund Ltd.** | | | | |
| 1,933 % fällig am 20.04.2028 | | 246 | 245 | 0,01 |
| **Babson CLO Ltd.** | | | | |
| 2,053 % fällig am 20.01.2031 | | 1.500 | 1.476 | 0,06 |
| **Barings CLO Ltd.** | | | | |
| 1,863 % fällig am 20.01.2028 | | 942 | 932 | 0,04 |
| **Catamaran CLO Ltd.** | | | | |
| 2,236 % fällig am 22.04.2030 | | 895 | 884 | 0,04 |
| **CBAM CLO Ltd.** | | | | |
| 2,064 % fällig am 17.04.2031 | | 3.050 | 2.995 | 0,12 |
| 2,183 % fällig am 20.10.2029 | | 963 | 951 | 0,04 |
| **Crestline Denali CLO Ltd.** | | | | |
| 2,183 % fällig am 20.01.2030 | | 5.422 | 5.350 | 0,22 |
| **Dryden Senior Loan Fund** | | | | |
| 1,944 % fällig am 15.04.2029 | | 551 | 546 | 0,02 |
| **Elevation CLO Ltd.** | | | | |
| 2,274 % fällig am 15.10.2029 | | 7.675 | 7.599 | 0,31 |
| **Gallatin CLO Ltd.** | | | | |
| 2,148 % fällig am 21.01.2028 | | 2.637 | 2.616 | 0,10 |
| **LCM LP** | | | | |
| 2,103 % fällig am 20.10.2027 | | 3.367 | 3.347 | 0,13 |
| **Mountain View CLO Ltd.** | | | | |
| 1,841 % fällig am 13.10.2027 | | 1.010 | 1.006 | 0,04 |
| **Nassau Ltd.** | | | | |
| 2,194 % fällig am 15.10.2029 | $ | 1.269 | $ 1.263 | 0,05 |
| **OZLM Ltd.** | | | | |
| 2,114 % fällig am 17.01.2031 | | 2.378 | 2.330 | 0,09 |
| 2,213 % fällig am 20.01.2031 | | 500 | 490 | 0,02 |
| **Sound Point CLO Ltd.** | | | | |
| 2,194 % fällig am 18.04.2031 | | 4.600 | 4.534 | 0,18 |
| **Telos CLO Ltd.** | | | | |
| 1,994 % fällig am 17.04.2028 | | 169 | 169 | 0,01 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | |
| 1,924 % fällig am 15.04.2027 | | 6.639 | 6.567 | 0,26 |
| 1,924 % fällig am 15.07.2027 | | 500 | 500 | 0,02 |
| 2,163 % fällig am 20.01.2029 | | 5.684 | 5.629 | 0,23 |
| 2,401 % fällig am 07.09.2030 | | 1.600 | 1.578 | 0,06 |
| | | | 51.993 | 2,09 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ADCB Finance Cayman Ltd.** | | | | |
| 1,907 % fällig am 25.10.2022 | AUD | 5.100 | 3.513 | 0,14 |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.02.2025 | $ | 2.500 | 2.303 | 0,09 |
| 5,125 % fällig am 01.10.2023 | | 3.300 | 3.268 | 0,13 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2023 | | 2.700 | 2.708 | 0,11 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2023 | | 4.000 | 3.986 | 0,16 |
| 5,250 % fällig am 15.08.2022 | | 12.837 | 12.838 | 0,52 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 17.06.2024 | | 32.100 | 30.579 | 1,24 |
| | | | 59.195 | 2,39 |
| Summe Cayman Inseln | | | 111.188 | 4,48 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Danske Bank A/S** | | | | |
| 1,171 % fällig am 08.12.2023 | | 17.200 | 16.974 | 0,68 |
| 2,781 % fällig am 12.09.2023 | | 4.096 | 4.099 | 0,17 |
| 5,375 % fällig am 12.01.2024 | | 12.800 | 12.924 | 0,52 |
| Summe Dänemark | | | 33.997 | 1,37 |
| **FINNLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Nordea Bank Abp** | | | | |
| 2,370 % fällig am 06.06.2025 | | 2.700 | 2.690 | 0,11 |
| 2,538 % fällig am 30.08.2023 | | 6.000 | 5.992 | 0,24 |
| Summe Finnland | | | 8.682 | 0,35 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 2,927 % fällig am 28.02.2024 | AUD | 1.800 | 1.247 | 0,05 |
| 3,375 % fällig am 09.01.2025 | $ | 1.500 | 1.467 | 0,06 |
| 3,493 % fällig am 16.12.2022 | AUD | 800 | 552 | 0,02 |
| 3,800 % fällig am 10.01.2024 | $ | 6.650 | 6.611 | 0,27 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 3,173 % fällig am 22.03.2024 | | 9.400 | 9.431 | 0,38 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 1,998 % fällig am 21.01.2026 | | 8.975 | 8.655 | 0,35 |
| 2,625 % fällig am 22.01.2025 | | 11.600 | 11.040 | 0,44 |
| 3,875 % fällig am 28.03.2024 | | 2.500 | 2.477 | 0,10 |
| 4,250 % fällig am 14.09.2023 | | 2.700 | 2.705 | 0,11 |
| Summe Frankreich | | | 44.185 | 1,78 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,898 % fällig am 28.05.2024 (e) | | 4.100 | 3.844 | 0,16 |
| 0,962 % fällig am 08.11.2023 | | 5.500 | 5.273 | 0,21 |
| 1,665 % fällig am 08.11.2023 | | 2.000 | 1.977 | 0,08 |
| 2,112 % fällig am 30.01.2023 | AUD | 1.500 | 1.031 | 0,04 |
| 2,222 % fällig am 18.09.2024 | $ | 1.500 | 1.447 | 0,06 |
| 2,601 % fällig am 16.11.2022 | | 4.000 | 3.999 | 0,16 |
| 2,783 % fällig am 27.02.2023 | | 2.502 | 2.499 | 0,10 |
| 3,700 % fällig am 30.05.2024 | | 1.200 | 1.180 | 0,05 |
| 3,950 % fällig am 27.02.2023 | | 11.261 | 11.239 | 0,45 |
| **HSH Portfoliomanagement AoeR** | | | | |
| 0,500 % fällig am 09.09.2022 | $ | 2.200 | $ 2.192 | 0,09 |
| Summe Deutschland | | | 34.681 | 1,40 |
| **INDIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Export-Import Bank of India** | | | | |
| 2,505 % fällig am 21.08.2022 | | 11.200 | 11.213 | 0,45 |
| **IRLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Black Diamond CLO DAC** | | | | |
| 0,980 % fällig am 15.05.2032 | € | 5.500 | 5.619 | 0,23 |
| 2,012 % fällig am 03.10.2029 | $ | 393 | 392 | 0,02 |
| **BNPP AM Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,600 % fällig am 15.04.2031 | € | 2.000 | 2.032 | 0,08 |
| **Cairn CLO DAC** | | | | |
| 0,650 % fällig am 20.10.2028 | | 141 | 147 | 0,01 |
| **Carlyle Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,700 % fällig am 15.01.2031 | | 20.000 | 20.429 | 0,82 |
| **Contego CLO DAC** | | | | |
| 0,640 % fällig am 23.01.2030 | | 13.487 | 13.861 | 0,56 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | | 307 | 320 | 0,01 |
| 0,650 % fällig am 26.06.2030 | | 9.305 | 9.561 | 0,38 |
| **Oak Hill European Credit Partners DAC** | | | | |
| 0,740 % fällig am 20.10.2031 | | 1.400 | 1.425 | 0,06 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** | | | | |
| 0,730 % fällig am 15.07.2031 | | 4.671 | 4.788 | 0,19 |
| 0,780 % fällig am 15.04.2031 | | 6.553 | 6.766 | 0,27 |
| **Tikehau CLO BV** | | | | |
| 0,870 % fällig am 04.08.2034 | | 15.000 | 15.288 | 0,62 |
| **Voya Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.10.2030 | | 11.027 | 11.342 | 0,46 |
| | | | 91.970 | 3,71 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 1,150 % fällig am 29.10.2023 | $ | 12.950 | 12.348 | 0,50 |
| 1,650 % fällig am 29.10.2024 | | 5.000 | 4.622 | 0,19 |
| **Perrigo Finance Unlimited Co.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 15.12.2024 | | 1.133 | 1.062 | 0,04 |
| **SMBC Aviation Capital Finance DAC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.07.2022 | | 4.850 | 4.849 | 0,20 |
| 3,550 % fällig am 15.04.2024 | | 3.700 | 3.603 | 0,14 |
| 4,125 % fällig am 15.07.2023 | | 2.000 | 1.984 | 0,08 |
| | | | 28.468 | 1,15 |
| Summe Irland | | | 120.438 | 4,86 |
| **ISRAEL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Israel Electric Corp. Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 12.11.2024 | | 3.200 | 3.242 | 0,13 |
| 6,875 % fällig am 21.06.2023 | | 4.500 | 4.620 | 0,19 |
| Summe Israel | | | 7.862 | 0,32 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Eni SpA** | | | | |
| 4,000 % fällig am 12.09.2023 | | 2.000 | 1.991 | 0,08 |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aozora Bank Ltd.** | | | | |
| 1,050 % fällig am 09.09.2024 | | 27.300 | 25.527 | 1,03 |
| 2,550 % fällig am 09.09.2022 | | 2.000 | 1.999 | 0,08 |
| **Mitsubishi HC Capital, Inc.** | | | | |
| 2,652 % fällig am 19.09.2022 | | 8.700 | 8.700 | 0,35 |
| 3,960 % fällig am 19.09.2023 | | 1.500 | 1.501 | 0,06 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | |
| 1,979 % fällig am 10.07.2024 | | 4.000 | 3.985 | 0,16 |
| 2,154 % fällig am 25.05.2024 | | 5.900 | 5.837 | 0,23 |
| 2,275 % fällig am 08.09.2024 | | 9.200 | 9.102 | 0,37 |
| 2,571 % fällig am 13.09.2023 | | 8.890 | 8.882 | 0,36 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Nissan Motor Co. Ltd.** | | | | |
| 3,043 % fällig am 15.09.2023 | $ | 12.00 | $ 11.805 | 0,48 |
| **Nomura Holdings, Inc.** | | | | |
| 1,851 % fällig am 16.07.2025 | | 16.800 | 15.407 | 0,62 |
| 2,329 % fällig am 22.01.2027 | | 4.400 | 3.899 | 0,16 |
| 2,648 % fällig am 16.01.2025 | | 6.400 | 6.113 | 0,25 |
| **ORIX Corp.** | | | | |
| 2,900 % fällig am 18.07.2022 | | 5.552 | 5.552 | 0,22 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | |
| 1,613 % fällig am 16.10.2024 | AUD | 9.700 | 6.681 | 0,27 |
| 2,778 % fällig am 18.10.2022 | $ | 5.000 | 5.003 | 0,20 |
| Summe Japan | | | 119.993 | 4,84 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **SES S.A.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 04.04.2023 | | 2.000 | 1.978 | 0,08 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Delos Finance SARL** | | | | |
| 4,000 % fällig am 06.10.2023 | | 210 | 208 | 0,01 |
| Summe Luxemburg | | | 2.186 | 0,09 |
| **MULTINATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **NXP BV** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.03.2024 | | 2.530 | 2.556 | 0,10 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **CNH Industrial NV** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.08.2023 | | 1.612 | 1.626 | 0,06 |
| **Enel Finance International NV** | | | | |
| 2,650 % fällig am 10.09.2024 | | 1.500 | 1.454 | 0,06 |
| **Iberdrola International BV** | | | | |
| 5,810 % fällig am 15.03.2025 | | 1.100 | 1.166 | 0,05 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 2,521 % fällig am 01.04.2027 | | 5.000 | 4.789 | 0,19 |
| 3,151 % fällig am 28.03.2026 | | 13.100 | 13.070 | 0,53 |
| **JDE Peet's NV** | | | | |
| 0,800 % fällig am 24.09.2024 | | 5.000 | 4.650 | 0,19 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 2,875 % fällig am 24.10.2024 | | 2.900 | 2.780 | 0,11 |
| **Stellantis NV** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.04.2023 | | 18.537 | 18.699 | 0,75 |
| Summe Niederlande | | | 48.234 | 1,94 |
| **SAUDI-ARABIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Saudi Arabian Oil Co.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 24.11.2023 | | 600 | 581 | 0,02 |
| 1,625 % fällig am 24.11.2025 | | 2.200 | 2.034 | 0,08 |
| Summe Saudi-Arabien | | | 2.615 | 0,10 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 18.09.2022 | | 7.345 | 7.339 | 0,30 |
| 3,322 % fällig am 26.09.2023 | | 1.700 | 1.699 | 0,07 |
| 4,375 % fällig am 02.05.2023 | | 2.000 | 2.013 | 0,08 |
| Summe Singapur | | | 11.051 | 0,45 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Hana Bank** | | | | |
| 2,977 % fällig am 02.10.2022 | | 7.600 | 7.607 | 0,31 |
| **Korea Southern Power Co. Ltd.** | | | | |
| 1,682 % fällig am 30.10.2024 | AUD | 5.300 | 3.645 | 0,15 |
| **KT Corp.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 21.01.2027 | $ | 5.000 | 4.469 | 0,18 |
| **SK Broadband Co. Ltd.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 13.08.2023 | | 1.500 | 1.507 | 0,06 |
| **SK Hynix, Inc.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 19.01.2024 | | 5.700 | 5.446 | 0,22 |
| **SK Telecom Co. Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 16.04.2023 | $ | 3.305 | $ 3.313 | 0,13 |
| **Woori Bank** | | | | |
| 2,156 % fällig am 01.02.2023 | | 1.200 | 1.202 | 0,05 |
| | | | 27.189 | 1,10 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Export-Import Bank of Korea** | | | | |
| 2,425 % fällig am 27.04.2023 | | 1.029 | 1.037 | 0,04 |
| **Korea Development Bank** | | | | |
| 0,500 % fällig am 27.10.2023 | | 500 | 482 | 0,02 |
| **Korea Expressway Corp.** | | | | |
| 1,956 % fällig am 02.09.2023 | AUD | 9.000 | 6.185 | 0,25 |
| | | | 7.704 | 0,31 |
| Summe Südkorea | | | 34.893 | 1,41 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 0,875 % fällig am 18.09.2023 | $ | 4.800 | 4.633 | 0,19 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 2,013 % fällig am 19.01.2023 | AUD | 1.200 | 827 | 0,03 |
| 3,848 % fällig am 12.04.2023 | $ | 2.400 | 2.399 | 0,10 |
| Summe Spanien | | | 7.859 | 0,32 |
| **SUPRANATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung** | | | | |
| 0,650 % fällig am 10.02.2026 | | 10.000 | 9.151 | 0,37 |
| 0,850 % fällig am 10.02.2027 | | 18.800 | 16.900 | 0,68 |
| Summe Supranational | | | 26.051 | 1,05 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 2,235 % fällig am 26.05.2023 | AUD | 3.900 | 2.685 | 0,11 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 2,193 % fällig am 05.06.2026 | $ | 2.500 | 2.269 | 0,09 |
| 2,713 % fällig am 08.03.2024 | AUD | 1.000 | 685 | 0,03 |
| 2,961 % fällig am 12.06.2024 | $ | 1.000 | 1.002 | 0,04 |
| 2,997 % fällig am 14.12.2023 | | 10.530 | 10.462 | 0,42 |
| **UBS AG** | | | | |
| 1,582 % fällig am 30.07.2025 | AUD | 7.225 | 4.951 | 0,20 |
| 1,585 % fällig am 26.02.2026 | | 3.000 | 2.024 | 0,08 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 2,789 % fällig am 12.05.2026 | $ | 15.000 | 14.980 | 0,61 |
| 2,859 % fällig am 15.08.2023 | | 6.000 | 5.998 | 0,24 |
| Summe Schweiz | | | 45.056 | 1,82 |
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **First Abu Dhabi Bank PJSC** | | | | |
| 1,375 % fällig am 19.02.2023 | £ | 900 | 1.083 | 0,04 |
| 2,180 % fällig am 18.02.2025 | AUD | 1.040 | 713 | 0,03 |
| Summe Vereinigte Arabische Emirate | | | 1.796 | 0,07 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 2,791 % fällig am 16.05.2024 | $ | 13.950 | 13.947 | 0,56 |
| 3,505 % fällig am 15.06.2023 | AUD | 3.500 | 2.421 | 0,10 |
| 3,650 % fällig am 16.03.2025 | $ | 2.500 | 2.449 | 0,10 |
| 3,917 % fällig am 26.06.2024 | AUD | 2.750 | 1.927 | 0,08 |
| 4,338 % fällig am 16.05.2024 | $ | 300 | 300 | 0,01 |
| **BP Capital Markets PLC** | | | | |
| 2,746 % fällig am 19.09.2022 | | 375 | 375 | 0,02 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 2,100 % fällig am 16.02.2024 | AUD | 6.000 | 4.124 | 0,17 |
| 2,827 % fällig am 10.03.2026 | $ | 3.500 | 3.466 | 0,14 |
| 2,951 % fällig am 11.03.2025 | | 15.500 | 15.391 | 0,62 |
| 3,033 % fällig am 22.11.2023 | | 8.000 | 7.965 | 0,32 |
| 3,101 % fällig am 12.09.2026 | | 2.820 | 2.801 | 0,11 |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 26.07.2024 | | 8.000 | 7.753 | 0,31 |
| 3,500 % fällig am 11.02.2023 | | 1.969 | 1.958 | 0,08 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 2,636 % fällig am 07.03.2025 | AUD | 2.360$ | 1.610 | 0,06 |
| 2,907 % fällig am 07.11.2023 | $ | 5.000 | 4.984 | 0,20 |
| 3,136 % fällig am 20.03.2023 | AUD | 3.300 | 2.274 | 0,09 |
| **NatWest Group PLC** | | | | |
| 2,359 % fällig am 22.05.2024 | $ | 1.600 | 1.572 | 0,06 |
| 3,875 % fällig am 12.09.2023 | | 1.500 | 1.496 | 0,06 |
| **NatWest Markets PLC** | | | | |
| 2,957 % fällig am 22.03.2025 | | 8.900 | 8.925 | 0,36 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 1,089 % fällig am 15.03.2025 | | 19.000 | 17.755 | 0,72 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 1,319 % fällig am 14.10.2023 | | 3.666 | 3.640 | 0,15 |
| 2,209 % fällig am 23.11.2025 | | 14.600 | 14.269 | 0,58 |
| 3,253 % fällig am 30.03.2026 | | 12.000 | 12.007 | 0,48 |
| | | | 133.409 | 5,38 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Avon Finance PLC** | | | | |
| 1,690 % fällig am 20.09.2048 | £ | 12.258 | 14.812 | 0,60 |
| **Canada Square Funding PLC** | | | | |
| 1,550 % fällig am 17.06.2058 | | 6.855 | 8.164 | 0,33 |
| **Eurohome UK Mortgages PLC** | | | | |
| 1,739 % fällig am 15.06.2044 | | 418 | 495 | 0,02 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | |
| 1,775 % fällig am 16.12.2069 | | 4.659 | 5.632 | 0,23 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 1,048 % fällig am 18.06.2038 | | 44 | 52 | 0,00 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | | |
| 1,703 % fällig am 25.05.2053 | | 10.008 | 12.131 | 0,49 |
| **Precise Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,551 % fällig am 12.03.2055 | | 760 | 920 | 0,04 |
| 1,870 % fällig am 16.10.2056 | | 2.141 | 2.574 | 0,10 |
| **Residential Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 2,040 % fällig am 20.06.2070 | | 148 | 179 | 0,01 |
| **RMAC PLC** | | | | |
| 1,571 % fällig am 12.06.2046 | | 871 | 1.051 | 0,04 |
| 1,841 % fällig am 12.06.2046 | | 3.221 | 3.914 | 0,16 |
| **Sage AR Funding PLC** | | | | |
| 1,858 % fällig am 17.11.2030 | | 3.000 | 3.616 | 0,15 |
| **Stratton Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2060 | | 18.639 | 22.460 | 0,91 |
| 1,652 % fällig am 12.03.2052 | | 4.948 | 5.937 | 0,24 |
| 1,674 % fällig am 25.09.2051 | | 6.674 | 8.062 | 0,32 |
| 1,853 % fällig am 25.05.2051 | | 2.016 | 2.450 | 0,10 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,361 % fällig am 20.07.2045 | | 5.768 | 6.996 | 0,28 |
| 1,605 % fällig am 20.10.2051 | | 883 | 1.069 | 0,04 |
| **Tudor Rose Mortgages** | | | | |
| 1,390 % fällig am 20.06.2048 | | 6.263 | 7.516 | 0,30 |
| | | | 108.030 | 4,36 |
| Summe Großbritannien | | | 241.439 | 9,74 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,749 % fällig am 25.03.2035 | $ | 700 | 691 | 0,03 |
| 4,249 % fällig am 25.03.2034 | | 29 | 30 | 0,00 |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,974 % fällig am 25.10.2037 | | 2.712 | 2.701 | 0,11 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 2,179 % fällig am 25.06.2036 | | 258 | 254 | 0,01 |
| 3,124 % fällig am 25.10.2034 | | 980 | 971 | 0,04 |
| **EFS Volunteer LLC** | | | | |
| 2,034 % fällig am 25.10.2035 | | 247 | 245 | 0,01 |
| **EquiFirst Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,624 % fällig am 25.10.2034 | | 582 | 580 | 0,02 |
| **Finance America Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,449 % fällig am 25.08.2034 | | 827 | 796 | 0,03 |
| **First NLC Trust** | | | | |
| 1,694 % fällig am 25.08.2037 | | 242 | 137 | 0,01 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 2,359 % fällig am 25.01.2035 | | 380 | 371 | 0,01 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 2,569 % fällig am 25.06.2034 | | 700 | 684 | 0,03 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,599 % fällig am 25.04.2035 | $ | 1.521 | $ 1.504 | 0,06 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,324 % fällig am 25.09.2034 | | 944 | 908 | 0,04 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 2,674 % fällig am 25.09.2033 | | 722 | 706 | 0,03 |
| **Navient Private Education Loan Trust** | | | | |
| 2,650 % fällig am 15.12.2028 | | 1.138 | 1.128 | 0,04 |
| 2,774 % fällig am 16.07.2040 | | 3.321 | 3.312 | 0,13 |
| 2,924 % fällig am 15.10.2031 | | 7.200 | 7.108 | 0,29 |
| **Nelnet Student Loan Trust** | | | | |
| 2,224 % fällig am 27.02.2051 | | 1.446 | 1.423 | 0,06 |
| 2,324 % fällig am 27.09.2038 | | 2.849 | 2.783 | 0,11 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,284 % fällig am 25.01.2036 | | 1.180 | 1.167 | 0,05 |
| **RAAC Trust** | | | | |
| 3,724 % fällig am 25.05.2044 | | 1.586 | 1.538 | 0,06 |
| **SBA Tower Trust** | | | | |
| 3,869 % fällig am 15.10.2049 | | 3.000 | 2.955 | 0,12 |
| **SLC Student Loan Trust** | | | | |
| 1,471 % fällig am 15.05.2029 | | 1.524 | 1.502 | 0,06 |
| 1,939 % fällig am 15.03.2027 | | 90 | 90 | 0,00 |
| **SLM Private Credit Student Loan Trust** | | | | |
| 2,159 % fällig am 15.06.2039 | | 5.381 | 5.129 | 0,21 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 1,784 % fällig am 25.10.2029 | | 2.428 | 2.411 | 0,10 |
| 2,074 % fällig am 25.06.2043 | | 6.070 | 5.910 | 0,24 |
| 2,084 % fällig am 25.07.2023 | | 877 | 859 | 0,03 |
| 2,274 % fällig am 27.12.2038 | | 1.296 | 1.256 | 0,05 |
| 2,684 % fällig am 25.04.2023 | | 904 | 900 | 0,04 |
| 2,884 % fällig am 25.07.2023 | | 210 | 209 | 0,01 |
| **SMB Private Education Loan Trust** | | | | |
| 1,600 % fällig am 15.09.2054 | | 3.301 | 3.010 | 0,12 |
| 2,074 % fällig am 15.10.2035 | | 1.640 | 1.619 | 0,06 |
| 2,474 % fällig am 15.09.2054 | | 6.836 | 6.724 | 0,27 |
| 2,774 % fällig am 17.02.2032 | | 140 | 140 | 0,01 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 2,174 % fällig am 25.09.2034 | | 1.763 | 1.630 | 0,07 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 3,349 % fällig am 25.11.2035 | | 1.775 | 1.771 | 0,07 |
| | | | 65.152 | 2,63 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **7-Eleven, Inc.** | | | | |
| 0,625 % fällig am 10.02.2023 | | 5.900 | 5.788 | 0,23 |
| 0,800 % fällig am 10.02.2024 | | 4.700 | 4.457 | 0,18 |
| **Air Lease Corp.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.01.2023 | | 4.600 | 4.554 | 0,18 |
| 2,750 % fällig am 15.01.2023 | | 1.500 | 1.490 | 0,06 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 3,050 % fällig am 05.06.2023 | | 6.000 | 5.938 | 0,24 |
| **Altria Group, Inc.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 09.08.2022 | | 1.700 | 1.700 | 0,07 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.06.2023 | | 4.291 | 4.247 | 0,17 |
| 3,500 % fällig am 31.01.2023 | | 3.723 | 3.723 | 0,15 |
| 5,000 % fällig am 15.02.2024 | | 1.000 | 1.012 | 0,04 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 2,301 % fällig am 15.02.2023 | | 7.700 | 7.702 | 0,31 |
| 3,106 % fällig am 19.09.2023 | AUD | 2.000 | 1.382 | 0,06 |
| 3,450 % fällig am 19.09.2023 | | 3.100 | 2.117 | 0,09 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 2,816 % fällig am 21.07.2023 | $ | 1.680 | 1.679 | 0,07 |
| 2,843 % fällig am 02.04.2026 | | 6.800 | 6.714 | 0,27 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | |
| 2,291 % fällig am 15.08.2022 | | 2.950 | 2.948 | 0,12 |
| 2,789 % fällig am 06.09.2024 | | 2.900 | 2.808 | 0,11 |
| 3,222 % fällig am 15.08.2024 | | 14.750 | 14.353 | 0,58 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** | | | | |
| 2,839 % fällig am 15.12.2023 | | 6.400 | 6.368 | 0,26 |
| 3,375 % fällig am 15.07.2024 | | 360 | 354 | 0,01 |
| 3,875 % fällig am 15.12.2023 | | 7.500 | 7.489 | 0,30 |
| **Berry Global, Inc.** | | | | |
| 0,950 % fällig am 15.02.2024 | | 4.000 | 3.791 | 0,15 |
| 4,875 % fällig am 15.07.2026 | | 10.100 | 9.658 | 0,39 |
| **Boeing Co.** | | | | |
| 1,433 % fällig am 04.02.2024 | $ | 8.400 | $ 8.031 | 0,32 |
| 1,875 % fällig am 15.06.2023 | | 3.300 | 3.222 | 0,13 |
| 4,508 % fällig am 01.05.2023 | | 27.500 | 27.576 | 1,11 |
| **Brandywine Operating Partnership LP** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.02.2023 | | 2.000 | 1.996 | 0,08 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | |
| 3,459 % fällig am 15.09.2026 | | 1.678 | 1.610 | 0,07 |
| **Cantor Fitzgerald LP** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.05.2024 | | 4.550 | 4.573 | 0,18 |
| **Capital One Financial Corp.** | | | | |
| 2,519 % fällig am 09.05.2025 | | 2.000 | 1.973 | 0,08 |
| **CenterPoint Energy Resources Corp.** | | | | |
| 2,111 % fällig am 02.03.2023 | | 4.198 | 4.187 | 0,17 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 2,936 % fällig am 01.02.2024 | | 35.210 | 35.490 | 1,43 |
| 4,908 % fällig am 23.07.2025 | | 1.000 | 1.004 | 0,04 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 2,249 % fällig am 27.10.2023 | AUD | 1.631 | 1.132 | 0,05 |
| 2,544 % fällig am 17.05.2024 | $ | 12.733 | 12.629 | 0,51 |
| 2,603 % fällig am 01.06.2024 | | 5.500 | 5.465 | 0,22 |
| 3,035 % fällig am 17.03.2026 (e) | | 4.000 | 3.975 | 0,16 |
| **CNH Industrial Capital LLC** | | | | |
| 1,950 % fällig am 02.07.2023 | | 5.007 | 4.895 | 0,20 |
| **CNO Global Funding** | | | | |
| 1,650 % fällig am 06.01.2025 | | 900 | 850 | 0,03 |
| **CommonSpirit Health** | | | | |
| 2,950 % fällig am 01.11.2022 | | 2.000 | 2.001 | 0,08 |
| **ConocoPhillips Co.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 08.03.2024 | | 9.800 | 9.613 | 0,39 |
| **DAE Funding LLC** | | | | |
| 1,550 % fällig am 01.08.2024 | | 5.600 | 5.249 | 0,21 |
| **Daimler Finance North America LLC** | | | | |
| 2,175 % fällig am 04.05.2023 | | 2.000 | 1.997 | 0,08 |
| **Daimler Trucks Finance North America LLC** | | | | |
| 1,125 % fällig am 14.12.2023 | | 4.700 | 4.515 | 0,18 |
| 2,230 % fällig am 13.12.2024 | | 4.300 | 4.249 | 0,17 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 5,450 % fällig am 15.06.2023 | | 14.379 | 14.529 | 0,59 |
| **Discovery Communications LLC** | | | | |
| 2,950 % fällig am 20.03.2023 | | 7.500 | 7.451 | 0,30 |
| **Dominion Energy, Inc.** | | | | |
| 2,359 % fällig am 15.09.2023 | | 500 | 498 | 0,02 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 2,366 % fällig am 03.08.2022 | | 300 | 299 | 0,01 |
| 2,979 % fällig am 03.08.2022 | | 300 | 300 | 0,01 |
| 3,350 % fällig am 01.11.2022 | | 5.000 | 4.973 | 0,20 |
| 3,370 % fällig am 17.11.2023 | | 1.000 | 976 | 0,04 |
| 3,550 % fällig am 07.10.2022 | | 1.400 | 1.395 | 0,06 |
| 4,250 % fällig am 20.09.2022 | | 2.500 | 2.499 | 0,10 |
| **FS KKR Capital Corp.** | | | | |
| 1,650 % fällig am 12.10.2024 | | 2.000 | 1.781 | 0,07 |
| **GA Global Funding Trust** | | | | |
| 1,625 % fällig am 15.01.2026 | | 3.500 | 3.175 | 0,13 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 2,439 % fällig am 17.11.2023 | | 8.000 | 7.888 | 0,32 |
| 3,250 % fällig am 05.01.2023 | | 12.335 | 12.317 | 0,50 |
| 4,150 % fällig am 19.06.2023 | | 3.000 | 3.003 | 0,12 |
| 4,250 % fällig am 15.05.2023 | | 500 | 502 | 0,02 |
| 5,100 % fällig am 17.01.2024 | | 10.520 | 10.633 | 0,43 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 0,523 % fällig am 08.03.2023 | | 2.000 | 1.961 | 0,08 |
| 0,925 % fällig am 21.10.2024 | | 6.700 | 6.411 | 0,26 |
| 1,217 % fällig am 06.12.2023 | | 4.400 | 4.242 | 0,17 |
| 2,184 % fällig am 24.07.2023 | | 2.500 | 2.498 | 0,10 |
| 2,200 % fällig am 16.05.2023 | AUD | 3.000 | 2.066 | 0,08 |
| 2,220 % fällig am 09.12.2026 | $ | 4.300 | 4.127 | 0,17 |
| 2,250 % fällig am 02.05.2024 | AUD | 3.000 | 2.078 | 0,08 |
| 2,255 % fällig am 23.02.2023 | $ | 1.600 | 1.598 | 0,06 |
| 2,905 % fällig am 24.07.2023 | | 3.890 | 3.889 | 0,16 |
| 2,988 % fällig am 28.10.2027 | | 700 | 692 | 0,03 |
| **GSK Consumer Healthcare Capital U.S. LLC** | | | | |
| 3,024 % fällig am 24.03.2024 | | 3.500 | 3.450 | 0,14 |
| **Harley-Davidson Financial Services, Inc.** | | | | |
| 3,350 % fällig am 15.02.2023 | | 1.500 | 1.494 | 0,06 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2024 | $ | 10.235 | $ 10.290 | 0,42 |
| **Hyatt Hotels Corp.** | | | | |
| 1,300 % fällig am 01.10.2023 | | 5.700 | 5.522 | 0,22 |
| 2,563 % fällig am 01.10.2023 | | 2.400 | 2.396 | 0,10 |
| **Hyundai Capital America** | | | | |
| 0,875 % fällig am 14.06.2024 | | 1.800 | 1.684 | 0,07 |
| 1,150 % fällig am 10.11.2022 | | 22.000 | 21.846 | 0,88 |
| 1,250 % fällig am 18.09.2023 | | 1.300 | 1.260 | 0,05 |
| 2,375 % fällig am 10.02.2023 | | 5.100 | 5.036 | 0,20 |
| 2,850 % fällig am 01.11.2022 | | 1.000 | 998 | 0,04 |
| 3,250 % fällig am 20.09.2022 | | 764 | 764 | 0,03 |
| 5,750 % fällig am 06.04.2023 | | 4.000 | 4.061 | 0,16 |
| **Infor, Inc.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 15.07.2023 | | 1.000 | 973 | 0,04 |
| **International Flavors & Fragrances, Inc.** | | | | |
| 0,697 % fällig am 15.09.2022 | | 3.495 | 3.479 | 0,14 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.08.2022 | | 8.104 | 8.120 | 0,33 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 2,074 % fällig am 23.07.2024 | | 2.800 | 2.789 | 0,11 |
| 2,272 % fällig am 22.09.2027 | | 5.000 | 4.719 | 0,19 |
| **Kansas City Southern** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.05.2023 | | 2.000 | 1.994 | 0,08 |
| **Komatsu Finance America, Inc.** | | | | |
| 2,437 % fällig am 11.09.2022 | | 2.000 | 1.997 | 0,08 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 2,222 % fällig am 10.08.2022 | | 3.000 | 2.995 | 0,12 |
| **Leidos, Inc.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 15.05.2023 | | 9.505 | 9.416 | 0,38 |
| **Lennar Corp.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.11.2022 | | 7.200 | 7.212 | 0,29 |
| **Magallanes, Inc.** | | | | |
| 3,259 % fällig am 15.03.2024 | | 3.400 | 3.391 | 0,14 |
| 3,428 % fällig am 15.03.2024 | | 2.200 | 2.159 | 0,09 |
| 3,788 % fällig am 15.03.2025 | | 3.000 | 2.911 | 0,12 |
| **Marvell Technology, Inc.** | | | | |
| 4,200 % fällig am 22.06.2023 | | 1.087 | 1.086 | 0,04 |
| **Microchip Technology, Inc.** | | | | |
| 0,983 % fällig am 01.09.2024 | | 5.000 | 4.667 | 0,19 |
| **Mylan, Inc.** | | | | |
| 4,200 % fällig am 29.11.2023 | | 1.000 | 997 | 0,04 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.01.2023 | | 4.200 | 4.171 | 0,17 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,066 % fällig am 21.03.2024 | | 15.600 | 15.490 | 0,62 |
| **Nissan Motor Acceptance Co. LLC** | | | | |
| 1,671 % fällig am 13.07.2022 | | 500 | 500 | 0,02 |
| 2,600 % fällig am 28.09.2022 | | 1.000 | 995 | 0,04 |
| 2,650 % fällig am 13.07.2022 | | 3.000 | 3.000 | 0,12 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | | |
| 2,924 % fällig am 28.09.2022 | | 15.300 | 15.249 | 0,62 |
| **OGE Energy Corp.** | | | | |
| 0,703 % fällig am 26.05.2023 | | 4.400 | 4.289 | 0,17 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | | |
| 1,700 % fällig am 15.11.2023 | | 3.000 | 2.893 | 0,12 |
| 3,250 % fällig am 15.06.2023 ^ | | 1.700 | 1.676 | 0,07 |
| 3,400 % fällig am 15.08.2024 ^ | | 500 | 481 | 0,02 |
| 3,750 % fällig am 15.02.2024 ^ | | 1.700 | 1.663 | 0,07 |
| 3,850 % fällig am 15.11.2023 ^ | | 300 | 296 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 01.08.2023 | | 1.700 | 1.691 | 0,07 |
| **Piper Sandler Cos.** | | | | |
| 5,200 % fällig am 15.10.2023 | | 3.500 | 3.452 | 0,14 |
| **RELX Capital, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 16.03.2023 | | 10.200 | 10.189 | 0,41 |
| **Reynolds American, Inc.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 12.06.2025 | | 2.624 | 2.612 | 0,11 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.04.2023 | | 23.945 | 24.179 | 0,98 |
| 5,750 % fällig am 15.05.2024 | | 1.500 | 1.531 | 0,06 |
| **Santander Holdings USA, Inc.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 18.01.2023 | | 6.000 | 5.992 | 0,24 |
| **SL Green Operating Partnership LP** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.10.2022 | | 4.700 | 4.689 | 0,19 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **SL Green Realty Corp.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.12.2022 | $ | 1.920 | $ 1.923 | 0,08 |
| **Southern California Edison Co.** | | | | |
| 2,343 % fällig am 01.04.2024 | | 4.500 | 4.454 | 0,18 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.11.2022 | | 500 | 504 | 0,02 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.04.2025 | | 3.800 | 3.721 | 0,15 |
| **TD SYNNEX Corp.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 09.08.2024 | | 8.000 | 7.473 | 0,30 |
| **Thermo Fisher Scientific, Inc.** | | | | |
| 0,797 % fällig am 18.10.2023 | | 9.300 | 9.016 | 0,36 |
| 1,215 % fällig am 18.10.2024 | | 8.900 | 8.442 | 0,34 |
| 1,405 % fällig am 18.10.2024 | | 11.500 | 11.380 | 0,46 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | |
| 2,235 % fällig am 17.02.2023 | AUD | 4.400 | 3.031 | 0,12 |
| 2,511 % fällig am 15.05.2025 | $ | 5.221 | 5.193 | 0,21 |
| **VMware, Inc.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 15.08.2024 | | 2.500 | 2.341 | 0,09 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 12.05.2023 | | 580 | 576 | 0,02 |
| 3,950 % fällig am 06.06.2025 | | 15.700 | 15.422 | 0,62 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 2,295 % fällig am 25.04.2026 | | 18.400 | 18.096 | 0,73 |
| | | | 662.601 | 26,72 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Pennsylvania Higher Education Assistance Agency Revenue Bonds, Series 2006** | | | | |
| 1,314 % fällig am 25.10.2036 | | 832 | 823 | 0,03 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 2,224 % fällig am 25.09.2045 | | 1.845 | 1.666 | 0,07 |
| **Ashford Hospitality Trust** | | | | |
| 2,224 % fällig am 15.04.2035 | | 1.213 | 1.179 | 0,05 |
| **Atrium Hotel Portfolio Trust** | | | | |
| 2,274 % fällig am 15.06.2035 | | 11.300 | 10.948 | 0,44 |
| **Barclays Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,324 % fällig am 15.07.2037 | | 900 | 877 | 0,03 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 3,383 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 4 | 3 | 0,00 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 3,074 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 14 | 9 | 0,00 |
| **BX Trust** | | | | |
| 2,124 % fällig am 15.05.2035 | | 2.775 | 2.702 | 0,11 |
| **Citigroup Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 3,251 % fällig am 10.05.2035 | | 1.065 | 1.042 | 0,04 |
| **Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 1,830 % fällig am 10.03.2046 | | 142 | 142 | 0,01 |
| 3,178 % fällig am 10.02.2035 | | 3.000 | 2.868 | 0,12 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Trust** | | | | |
| 2,074 % fällig am 15.07.2032 | | 2.000 | 1.900 | 0,08 |
| 2,688 % fällig am 25.03.2059 | | 3.936 | 3.804 | 0,15 |
| 3,196 % fällig am 10.07.2034 | | 1.900 | 1.898 | 0,08 |
| **DBCG Mortgage Trust** | | | | |
| 2,025 % fällig am 15.06.2034 | | 21.800 | 21.326 | 0,86 |
| **DBGS Mortgage Trust** | | | | |
| 2,119 % fällig am 15.06.2033 | | 2.600 | 2.512 | 0,10 |
| **DBWF Mortgage Trust** | | | | |
| 2,625 % fällig am 19.12.2030 | | 5.100 | 4.956 | 0,20 |
| **Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates** | | | | |
| 3,144 % fällig am 28.09.2036 | | 1.414 | 1.419 | 0,06 |
| **GS Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 3,648 % fällig am 10.01.2047 | | 404 | 403 | 0,02 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,037 % fällig am 25.06.2034 | | 53 | 52 | 0,00 |
| 3,146 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 135 | 120 | 0,00 |
| **Impac CMB Trust** | | | | |
| 2,264 % fällig am 25.03.2035 | | 98 | 92 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 4,128 % fällig am 05.07.2031 | | 4.500 | 4.431 | 0,18 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,710 % fällig am 15.06.2035 | | 2.229 | 2.173 | 0,09 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 2,120 % fällig am 25.05.2033 | $ | 208 | $ 204 | 0,01 |
| 3,586 % fällig am 25.03.2033 | | 358 | 341 | 0,01 |
| **Mill City Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,750 % fällig am 25.07.2059 | | 572 | 569 | 0,02 |
| **Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust** | | | | |
| 2,918 % fällig am 15.02.2046 | | 11.856 | 11.791 | 0,47 |
| **New Residential Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,500 % fällig am 25.12.2057 | | 457 | 447 | 0,02 |
| 4,500 % fällig am 25.05.2058 | | 216 | 215 | 0,01 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | | |
| 2,275 % fällig am 20.10.2034 | | 557 | 516 | 0,02 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,769 % fällig am 25.03.2034 | | 10 | 10 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 2,255 % fällig am 19.10.2034 | | 404 | 386 | 0,02 |
| **Towd Point Mortgage Trust** | | | | |
| 3,750 % fällig am 25.05.2058 | | 10.040 | 9.829 | 0,40 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,084 % fällig am 25.04.2045 | | 2 | 1 | 0,00 |
| 2,164 % fällig am 25.12.2045 | | 34 | 33 | 0,00 |
| 2,851 % fällig am 25.10.2035 | | 269 | 256 | 0,01 |
| **Wells Fargo Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 4,218 % fällig am 15.07.2046 | | 800 | 799 | 0,03 |
| **Wells Fargo-RBS Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 3,071 % fällig am 15.03.2045 | | 14.401 | 14.347 | 0,58 |
| 3,337 % fällig am 15.06.2046 | | 14.400 | 14.185 | 0,57 |
| | | | 120.451 | 4,86 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 1,150 % fällig am 25.11.2047 | | 3.309 | 3.274 | 0,13 |
| 1,250 % fällig am 25.08.2050 | | 2.072 | 2.049 | 0,08 |
| 1,874 % fällig am 25.01.2037 | | 38 | 38 | 0,00 |
| 1,934 % fällig am 25.04.2037 | | 9 | 9 | 0,00 |
| 1,954 % fällig am 25.04.2037 | | 8 | 8 | 0,00 |
| 1,974 % fällig am 25.07.2037 | | 41 | 41 | 0,00 |
| 1,994 % fällig am 25.05.2037 | | 32 | 32 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 25.08.2038 | | 6.394 | 6.088 | 0,25 |
| 2,014 % fällig am 25.04.2037 | | 411 | 410 | 0,02 |
| 2,024 % fällig am 25.05.2037 - 25.10.2040 | | 36 | 35 | 0,00 |
| 2,044 % fällig am 25.05.2037 | | 51 | 51 | 0,00 |
| 2,074 % fällig am 25.10.2030 - 25.06.2060 | | 20.679 | 20.615 | 0,83 |
| 2,124 % fällig am 25.08.2037 | | 55 | 55 | 0,00 |
| 2,174 % fällig am 25.12.2049 | | 14 | 14 | 0,00 |
| 2,294 % fällig am 25.03.2038 | | 66 | 66 | 0,00 |
| 2,304 % fällig am 25.12.2037 | | 48 | 49 | 0,00 |
| 2,324 % fällig am 25.01.2041 | | 73 | 73 | 0,00 |
| 2,405 % fällig am 01.10.2037 | | 112 | 116 | 0,01 |
| 2,624 % fällig am 25.05.2037 | | 202 | 206 | 0,01 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | | |
| 0,800 % fällig am 27.11.2023 (g) | | 20.000 | 19.377 | 0,78 |
| 0,830 % fällig am 10.02.2027 (f) | | 37.000 | 33.289 | 1,34 |
| 0,900 % fällig am 26.02.2027 (f) | | 36.500 | 32.757 | 1,32 |
| 0,920 % fällig am 26.02.2027 (f) | | 29.100 | 26.167 | 1,06 |
| 1,000 % fällig am 23.03.2026 (g) | | 26.803 | 24.635 | 0,99 |
| 1,020 % fällig am 24.02.2027 (f)(g) | | 27.000 | 24.350 | 0,98 |
| 1,115 % fällig am 26.02.2027 (f) | | 31.500 | 28.690 | 1,16 |
| **Freddie Mac** | | | | |
| 0,800 % fällig am 28.10.2026 (f)(g) | | 50.000 | 44.933 | 1,81 |
| 1,150 % fällig am 15.01.2038 - 15.10.2040 | | 28.692 | 28.560 | 1,15 |
| 1,295 % fällig am 15.01.2038 (a) | | 799 | 45 | 0,00 |
| 1,624 % fällig am 15.05.2037 | | 52 | 51 | 0,00 |
| 1,724 % fällig am 15.02.2034 - 15.08.2056 | | 7.692 | 7.666 | 0,31 |
| 1,734 % fällig am 15.06.2037 | | 611 | 609 | 0,03 |
| 1,774 % fällig am 15.10.2036 - 15.06.2042 | | 50 | 51 | 0,00 |
| 1,804 % fällig am 15.10.2040 | | 79 | 79 | 0,00 |
| 1,824 % fällig am 15.11.2050 | | 79 | 79 | 0,00 |
| 1,844 % fällig am 15.05.2036 - 15.12.2041 | | 176 | 177 | 0,01 |
| 1,876 % fällig am 25.07.2044 | | 4 | 4 | 0,00 |
| 2,024 % fällig am 25.07.2050 | | 10.489 | 10.371 | 0,42 |
| 2,500 % fällig am 25.10.2048 | $ | 848 | $ 803 | 0,03 |
| 3,000 % fällig am 25.09.2045 | | 2.362 | 2.271 | 0,09 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2048 | | 1.668 | 1.672 | 0,07 |
| **Ginnie Mae** | | | | |
| 0,706 % fällig am 20.12.2068 | | 1.119 | 1.082 | 0,04 |
| 1,171 % fällig am 20.06.2051 | | 52.605 | 48.119 | 1,94 |
| 1,263 % fällig am 20.02.2067 | | 894 | 887 | 0,04 |
| 1,521 % fällig am 20.06.2051 | | 14.879 | 13.161 | 0,53 |
| 1,553 % fällig am 20.12.2065 - 20.08.2067 | | 3.127 | 3.115 | 0,13 |
| 1,603 % fällig am 20.01.2066 | | 475 | 473 | 0,02 |
| 1,625 % fällig am 20.08.2024 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 1,653 % fällig am 20.11.2066 | | 883 | 882 | 0,04 |
| 1,750 % fällig am 20.11.2029 | | 2 | 2 | 0,00 |
| 1,968 % fällig am 20.04.2067 | | 3.823 | 3.778 | 0,15 |
| 2,095 % fällig am 20.10.2037 | | 157 | 158 | 0,01 |
| 2,271 % fällig am 20.06.2071 | | 7.717 | 8.003 | 0,32 |
| 2,500 % fällig am 20.01.2049 | | 811 | 771 | 0,03 |
| 2,595 % fällig am 20.05.2071 | | 6.103 | 6.276 | 0,25 |
| 2,600 % fällig am 20.06.2071 | | 6.465 | 6.636 | 0,27 |
| 2,625 % fällig am 20.03.2027 - 20.03.2030 | | 33 | 32 | 0,00 |
| 3,096 % fällig am 20.09.2066 | | 1.571 | 1.621 | 0,07 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.09.2049 | | 4.129 | 4.118 | 0,17 |
| | | | 418.980 | 16,89 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 2,250 % fällig am 31.03.2024 (g) | | 170.900 | 168.770 | 6,81 |
| 2,500 % fällig am 30.04.2024 (g) | | 51.000 | 50.563 | 2,04 |
| 2,500 % fällig am 31.05.2024 (g) | | 117.700 | 116.647 | 4,70 |
| 2,750 % fällig am 15.05.2025 | | 72.200 | 71.653 | 2,89 |
| | | | 407.633 | 16,44 |
| Summe USA | | | 1.675.640 | 67,57 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | | |
| **Pacific Gas and Electric Co.** | | | | |
| 0,303 % fällig am 14.11.2022 | | 1.725 | 1.718 | 0,07 |
| **ISRAEL TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,050) % fällig am 07.10.2022 (b)(c) | ILS | 3.400 | 968 | 0,04 |
| (0,020) % fällig am 07.12.2022 (b)(c) | | 5.000 | 1.424 | 0,06 |
| 1,184 % fällig am 02.03.2023 (b)(c) | | 12.900 | 3.652 | 0,14 |
| | | | 6.044 | 0,24 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 7.762 | 0,31 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere** | | | **$ 2.658.357** | **107,20** |
| **AKTIEN** | | | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc -PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)** | | 3.515 | 35 | 0,00 |
| **EXCHANGE-TRADED FUNDS** | | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (d)** | | 2.534.112 | 250.743 | 10,11 |
| **Summe Investmentfonds** | | | **$ 250.778** | **10,11** |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 0,400 % | 30.06.2022 | 01.07.2022 | $ 3.866 | U.S. Treasury Notes 3,000% fällig am 30.06.2024 | $ (3.943) | $ 3.866 | $ 3.866 | 0,16 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (3.943)** | **$ 3.866** | **$ 3.866** | **0,16** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Long | 09.2022 | 608 | $ (568) | (0,02) |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 6.787 | 3.745 | 0,15 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09.2022 | 61 | 58 | 0,00 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2022 | 837 | 577 | 0,02 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2022 | 19 | 85 | 0,01 |
| | | | | $ 3.897 | 0,16 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 3.897** | **0,16** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-37 5-Year Index | (1,000) % | 20.12.2026 | $ 181.200 | $ 3.952 | 0,16 |
| CDX.IG-38 5-Year Index | (1,000) | 20.06.2027 | 144.100 | 1.260 | 0,05 |
| | | | | $ 5.212 | 0,21 |

## ZINSSWAPS - BASISSWAPS

| Zahlung variabler Zinssatzindex | Erhalt variabler Zinssatzindex | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month USD-LIBOR | 1-Month USD-LIBOR + 0,098 % | 13.01.2023 | $ 52.000 | $ 26 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR | 1-Month USD-LIBOR + 0,098 % | 13.01.2023 | 39.800 | 20 | 0,00 |
| | | | | $ 46 | 0,00 |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung[3] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,686 % | 31.03.2024 | $ 117.400 | $ (687) | (0,03) |
| Zahlung[3] | 1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS | 2,703 | 31.03.2024 | 276.400 | (1.540) | (0,06) |
| | | | | | $ (2.227) | (0,09) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 3.031** | **0,12** |

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

(2) 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 Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-38 5-Year Index | Verkauf | 1,200 % | 20.07.2022 | 12.200 | $ (18) | $ (9) | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-37 5-Year Index | Verkauf | 1,200 | 20.07.2022 | 10.500 | (19) | (4) | 0,00 |
| | | | | | | $ (37) | $ (13) | 0,00 |

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

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07.2022 | £ 94.753 | $ 119.804 | $ 4.732 | $ 0 | $ 4.732 | 0,19 |
| BPS | 07.2022 | $ 93.219 | € 88.628 | 0 | (563) | (563) | (0,02) |
| | 07.2022 | 2.566 | £ 2.100 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 08.2022 | € 88.628 | $ 93.389 | 561 | 0 | 561 | 0,02 |
| | 08.2022 | $ 638 | MXN 14.024 | 52 | 0 | 52 | 0,00 |
| | 03.2023 | ILS 12.700 | $ 3.741 | 52 | 0 | 52 | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | $ 1.288 | £ 1.065 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| CBK | 10.2022 | ILS 3.402 | $ 1.087 | 110 | 0 | 110 | 0,00 |
| | 12.2022 | 3.701 | 1.203 | 134 | 0 | 134 | 0,01 |
| JPM | 07.2022 | 100 | 29 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08.2022 | 26.496 | 8.190 | 614 | 0 | 614 | 0,03 |
| | 12.2022 | 1.300 | 422 | 46 | 0 | 46 | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | CAD 457 | 362 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 07.2022 | € 88.628 | 95.576 | 2.920 | 0 | 2.920 | 0,12 |
| | 07.2022 | $ 1.010 | £ 821 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 08.2022 | AUD 12.633 | $ 8.958 | 268 | 0 | 268 | 0,01 |
| MYI | 07.2022 | € 45 | 47 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RBC | 08.2022 | AUD 105.897 | 75.285 | 2.440 | 0 | 2.440 | 0,10 |
| SCX | 07.2022 | $ 7.817 | ILS 26.353 | 0 | (289) | (289) | (0,01) |
| | | | | $ 11.943 | $ (879) | $ 11.064 | 0,45 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2022 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07.2022 | € 12 | $ 13 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| BOA | 07.2022 | 9.885 | 10.615 | 281 | 0 | 281 | 0,01 |
| | 07.2022 | $ 3.990 | € 3.778 | 0 | (40) | (40) | 0,00 |
| BRC | 07.2022 | € 320 | $ 344 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 2.017 | € 1.921 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| MBC | 07.2022 | € 97.697 | $ 102.777 | 641 | 0 | 641 | 0,03 |
| | 07.2022 | $ 101.881 | € 94.474 | 0 | (3.114) | (3.114) | (0,13) |
| | 08.2022 | 102.964 | 97.697 | 0 | (638) | (638) | (0,03) |
| MYI | 07.2022 | 386 | 366 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| SCX | 07.2022 | € 3 | $ 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 103.258 | € 96.634 | 18 | (2.250) | (2.232) | (0,09) |
| UAG | 07.2022 | € 2.194 | $ 2.320 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| | 07.2022 | $ 102.291 | € 95.189 | 0 | (2.775) | (2.775) | (0,11) |
| | | | | $ 977 | $ (8.828) | $ (7.851) | (0,32) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **$ 3.200** | **0,13** |
| **Summe Anlagen** | | | | | | **$ 2.923.129** | **117,88** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | | | | | **$ (443.444)** | **(17,88)** |
| **Nettovermögen** | | | | | | **$ 2.479.685** | **100,00** |

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

* Auf Null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.
^ Das Wertpapier ist in Verzug.
(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
(b) Nullkuponwertpapier.
(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
(d) Mit dem Fonds verbunden.

**(e) Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeits-datum | Kauf-datum | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Citigroup, Inc. | 3,035 % | 17.03.2026 | 10.03.2022 | $ 4.000 | $ 3.975 | 0,16 |
| Deutsche Bank AG | 0,898 | 28.05.2024 | 25.05.2021 - 31.03.2022 | 4.040 | 3.844 | 0,16 |
| | | | | $ 8.040 | $ 7.819 | 0,32 |

**(f) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 157.663 als Sicherheiten verpfändet.**

**(g) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 303.739 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.**

**Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 280 als Sicherheiten erhalten.**

**Barmittel in Höhe von USD 21.403 wurden zum 30. Juni 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2022 Barmittel in Höhe von USD 4.660 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2022 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 | $ 2.658.357 | $ 0 | $ 2.658.357 |
| Investmentfonds | 35 | 250.743 | 0 | 250.778 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 3.866 | 0 | 3.866 |
| Finanzderivate[3] | 0 | 10.128 | 0 | 10.128 |
| **Summen** | **$ 35** | **$ 2.923.094** | **$ 0** | **$ 2.923.129** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 2.807.383 | $ 0 | $ 2.807.383 |
| Investmentfonds | 269.578 | 0 | 0 | 269.578 |
| Pensionsgeschäfte | 0 | 1.571 | 0 | 1.571 |
| Finanzderivate[3] | (7.684) | (3.708) | 0 | (11.392) |
| **Summen** | **$ 261.894** | **$ 2.805.246** | **$ 0** | **$ 3.067.140** |

(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 2022:**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 1,590 % | 24.06.2022 | 08.07.2022 | $ (105.388) | $ (105.421) | (4,25) |
| | 1,650 | 27.06.2022 | 05.07.2022 | (51.975) | (51.984) | (2,10) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (157.405)** | **(6,35)** |

**Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2022:**

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPG | 1,660 % | 29.06.2022 | 06.07.2022 | $ (65.509) | $ (65.515) | (2,64) |
| BRC | 0,750 | 30.06.2022 | 05.07.2022 | (116.875) | (116.877) | (4,71) |
| | 1,460 | 28.06.2022 | 01.07.2022 | (31.371) | (31.375) | (1,27) |
| | 1,550 | 29.06.2022 | 05.07.2022 | (90.819) | (90.826) | (3,66) |
| **Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte** | | | | | **$ (304.593)** | **(12,28)** |

(1) In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 40 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 2022:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 4.964 | $ (5.080) | $ (116) |
| BPS | 83 | 0 | 83 |
| BRC | 8 | (10) | (2) |
| CBK | 244 | (80) | 164 |
| JPM | 660 | (560) | 100 |
| MBC | 73 | 0 | 73 |
| MYI | (3) | (140) | (143) |
| RBC | 2.440 | (2.350) | 90 |
| SCX | (2.521) | 2.170 | (351) |
| UAG | (2.748) | 2.490 | (258) |

[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 2022:

| | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 61,43 | 50,83 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 45,44 | 55,09 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere | 0,33 | 0,01 |
| Investmentfonds | 10,11 | 10,17 |
| Pensionsgeschäfte | 0,16 | 0,06 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,16 | (0,33) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,12 | 0,00 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,13 | (0,10) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (6,35) | (8,12) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (12,28) | (8,97) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2022 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2022 (%) | 31. Dez. 2021 (%) |
|---|---|---|
| Australien | 1,56 | 0,22 |
| Belgien | 0,37 | 0,12 |
| Bermuda | 0,37 | 0,35 |
| Cayman-Inseln | 4,48 | 3,47 |
| Dänemark | 1,37 | 1,14 |
| Finnland | 0,35 | 0,23 |
| Frankreich | 1,78 | 0,36 |
| Deutschland | 1,40 | 0,39 |
| Indien | 0,45 | 0,82 |
| Irland | 4,86 | 4,63 |
| Israel | 0,32 | 0,38 |
| Italien | 0,08 | k. A. |
| Japan | 4,84 | 5,23 |
| Luxemburg | 0,09 | 0,08 |
| Multinational | 0,10 | 0,04 |
| Niederlande | 1,94 | 1,12 |
| Saudi-Arabien | 0,10 | 0,10 |
| Singapur | 0,45 | 0,51 |
| Südkorea | 1,41 | 0,82 |
| Spanien | 0,32 | 0,03 |
| Supranational | 1,05 | 1,06 |
| Schweiz | 1,82 | 0,47 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 0,07 | 0,66 |
| Großbritannien | 9,74 | 10,25 |
| USA | 67,57 | 72,26 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,31 | 1,19 |
| Investmentfonds | 10,11 | 10,17 |
| Pensionsgeschäfte | 0,16 | 0,06 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,16 | (0,33) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | 0,21 | 0,00 |
| Zinsswaps — Basisswaps | 0,00 | 0,00 |
| Zinsswaps | (0,09) | k. A. |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | 0,00 | k. A. |
| Optionen auf Wertpapiere | k. A. | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | 0,45 | (0,19) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (0,32) | 0,09 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (17,88) | (15,73) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

## 1. ALLGEMEINE INFORMATIONEN

Die einzelnen in diesem Bericht beschriebenen Fonds (nachfolgend jeweils als ein „Fonds“ und gemeinsam als die „Fonds“ bezeichnet) sind Teilfonds der PIMCO Funds: Global Investors Series plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft des Umbrella-Typs mit variablem Kapital und mit gesonderter Haftung zwischen den Fonds und mit beschränkter Haftung, die gemäß dem Companies Act von 2014 unter der Register-Nr. 276928 in Irland eingetragen und von der Zentralbank von Irland (die „Zentralbank“) nach den Rechtsvorschriften der Europäischen Gemeinschaften von 2011 (Organismen für die gemeinsame Anlage in übertragbaren Wertpapieren („OGAW“)) (Verordnung Nr. 352 von 2011) in der jeweils geltenden Fassung (die „OGAW-Richtlinien“) genehmigt wurde. Bei der Gesellschaft handelt es sich um eine Umbrella-Gesellschaft, die aus verschiedenen Fonds besteht, die jeweils eine oder mehrere Anteilsklassen umfassen. Nach dem Ermessen des Verwaltungsrats (der „Verwaltungsrat“ oder die „Verwaltungsratsmitglieder“) dürfen für einen Fonds mehrere Anteilsklassen („Klassen“) ausgegeben werden. Für jeden einzelnen Fonds wird ein gesondertes Vermögenswertportfolio geführt, welches in Übereinstimmung mit den Anlagezielen und der Anlagepolitik, die auf diesen Fonds zutreffen, angelegt wird. Der Verwaltungsrat darf mit vorheriger schriftlicher Zustimmung der Zentralbank zu gegebener Zeit zusätzliche Fonds auflegen. Der Verwaltungsrat darf gemäß den Anforderungen der Zentralbank zu gegebener Zeit Klassen Fonds auflegen. Die Gesellschaft wurde am 10. Dezember 1997 gegründet.

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

Wie im Verkaufsprospekt der Gesellschaft vorgesehen, wurden Pacific Investment Management Company LLC, PIMCO Europe Ltd und PIMCO Europe GmbH (jeweils eine „Anlageberatungsgesellschaft“) als Anlageberatungsgesellschaften für verschiedene Fonds der Gesellschaft bestellt. PIMCO Asia Limited und PIMCO Asia Pte Ltd (jeweils eine „Anlageberatungsgesellschaft“) haben von der Zentralbank die Genehmigung erhalten, als Anlageberatungsgesellschaft für irische Fonds zu agieren.

Gemäß dem Verkaufsprospekt der Gesellschaft kann jede Anlageberatungsgesellschaft die diskretionäre Anlageverwaltung der Fonds vorbehaltlich aller gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Anforderungen einer oder mehreren Unter-Anlageberatungsgesellschaften übertragen. dWenn für einen bestimmten Teilfonds eine Anlageberatungsgesellschaft bestellt wurde, hat die Anlageberatungsgesellschaft die jeweils übrigen Anlageberatungsgesellschaften, PIMCO Asia Limited und PIMCO Asia Pte Ltd., als Unter-Anlageberatungsgesellschaft bezüglich des bzw. der jeweiligen Fonds bestellt. Die Gebühren der einzelnen entsprechend bestellten Unter-Anlageberatungsgesellschaften sind von der Verwaltungsgesellschaft oder von den Anlageberatungsgesellschaften im Namen der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr zu begleichen.

Der Sitz der Gesellschaft befindet sich in 78 Sir John Rogerson’s Quay, Dublin 2, D02 HD32, Irland.

## 2. WICHTIGE BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN

Die bei der Erstellung dieses Abschlusses verwendeten wesentlichen Rechnungslegungs- und Schätzungsmethoden sind mit denen konform, die die Gesellschaft für den geprüften Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (der „geprüfte Jahresabschluss“) verwendet hat. Der Abschluss wird für alle Fonds auf Basis der Fortführung der Unternehmenstätigkeit erstellt.

### Erstellungsgrundlage

Bei dem vorliegenden Abschluss handelt es sich um den ungeprüften verkürzten Abschluss für den Sechsmonatszeitraum zum 30. Juni 2022. Er wurde gemäß Financial Reporting Standard („FRS“) 104: „Zwischenberichterstattung“, wie vom Financial Reporting Council („FRC“) veröffentlicht, und den OGAW-Richtlinien veröffentlicht.

Der ungeprüfte verkürzte Abschluss sollte in Verbindung mit dem geprüften Jahresabschluss, der von den Abschlussprüfern einen uneingeschränkten Bestätigungsvermerk erhalten hat und der im Einklang mit den in Irland allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen (FRS 102), dem Irischen Statut, bestehend aus dem Companies Act (Gesetz über Aktiengesellschaften) von 2014 und den OGAW-Richtlinien erstellt wurde, gelesen werden. Bei den in Irland allgemein für die Erstellung von Rechnungsabschlüssen anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen handelt es sich um diejenigen, die vom FRC herausgegeben werden.

Die in der Aufstellung der ausgewiesenen Gesamtgewinne und -verluste sowie in einer Überleitung der Eigenkapitalveränderungen aufzuführenden Angaben sind nach Meinung des Verwaltungsrats in der Betriebsergebnisrechnung sowie im Ausweis der Nettovermögensänderungen enthalten.

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

Dieser Abschluss wurde nach der Anschaffungskostenregelung unter Zugrundelegung der Neubewertung der ergebniswirksam zum Marktwert bewerteten Finanzvermögen und -verbindlichkeiten aufgestellt.

Alle Beträge wurden, sofern nicht anders angegeben, auf die nächsten Tausend gerundet. Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. In der Aufstellung der Finanzanlagen bestimmter Fonds finden sich gegebenenfalls übertragbare Wertpapiere, die sowohl einen Nennwert als auch einen beizulegenden Zeitwert von null aufweisen, wenn der tatsächliche Nennwert und beizulegende Zeitwert auf das nächste Tausend gerundet werden.

Die von der Gesellschaft im Berichtszeitraum angewandte Swing-Pricing-Methode ist mit derjenigen konform, die im geprüften Jahresabschluss angewandt wurde.

Zum 30. Juni 2022 wurde Swing Pricing für den Commodity Real Return Fund, den Diversified Income Duration Hedged Fund, den Dynamic Bond Fund, den Emerging Markets Bond ESG Fund, den Low Average Duration Fund, den Mortgage Opportunities Fund, den StocksPLUS™ Fund und den PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund angewandt. Zum 31. Dezember 2021 wurde kein Swing Pricing für die Fonds angewandt.

Der NIW je Anteil ist in Erläuterung 16 angegeben und kann eine Swing Pricing-Anpassung enthalten. Diese Anpassung ist in der Vermögensaufstellung, der Aufwands- und Ertragsrechnung sowie den Veränderungen des Nettovermögens nicht erfasst.

## 3. ANLAGEN ZUM MARKTWERT UND MARKTBEWERTUNGSHIERARCHIE

Die Gesellschaft muss Angaben bezüglich der Marktbewertungshierarchie machen, in die die Bewertungen zum beizulegenden Zeitwert für Vermögenswerte und Verbindlichkeiten eingestuft werden. Die Angaben beruhen auf einer dreistufigen Marktbewertungshierarchie für die in Bewertungsverfahren zur Bemessung des beizulegenden Zeitwerts verwendeten Inputfaktoren.

Der beizulegende Zeitwert ist definiert als der Betrag, zu dem in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ein Vermögenswert ausgetauscht, eine Verbindlichkeit beglichen oder ein Eigenkapitalinstrument gewährt würde. Es sind getrennte Angaben zur Marktbewertungshierarchie für jede Hauptklasse von Aktiva und Passiva erforderlich, die die Bewertung zum Marktwert in Stufen teilt (Stufen 1, 2 und 3). Diese Inputfaktoren oder Verfahren zur Bewertung von Wertpapieren geben nicht unbedingt das Risiko wieder, dass mit der Anlage in diesen Wertpapieren verbunden ist. Die Stufen 1, 2 und 3 der Marktbewertungshierarchie sind wie folgt definiert:

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

Eine Analyse der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der einzelnen Teilfonds zum 30. Juni 2022 und zum 31. Dezember 2021 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 Fonds und nach Maßgabe der von der Zentralbank jeweils festgesetzten Grenzen und des laut Prospektbestimmungen erlaubten Umfangs sind die Finanzderivate und Anlagetechniken von allen Fonds für eine effiziente Portfolioverwaltung einzusetzen. Die Fonds können diese Finanzderivate und Anlagetechniken zur Absicherung gegen Zinsänderungen, Devisenkursänderungen in anderen Währungen als der Funktionswährung, gegen Änderungen in Wertpapierkursen oder als Teil ihrer allgemeinen Anlagestrategie einsetzen.

Der durch die Pensionsgeschäfte im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt USD 15.018.247/ (USD 1.166.271) (30. Juni 2021: USD 801.665/(USD 2.493.637)).

Der durch die umgekehrten Pensionsgeschäfte im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) insgesamt betrug USD 8.488.913/(USD 9.218.518) (30. Juni 2021: USD 2.300.919/(USD 6.866.201)).

Der durch die Sale-BuybackGeschäfte im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2022 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt USD 223.876/ (USD 954.715) (30. Juni 2021 USD 235.411/(USD 132.328)).

## 5. DIVIDENDENAUSSCHÜTTUNGSPOLITIK

Wie in der jeweiligen Fondsergänzung angegeben, können Dividendenausschüttungen festgesetzt werden auf:

(i) Nettokapitalerträge, die aus Zinsen und Dividenden abzüglich Aufwendungen bestehen.
(ii) Realisierte Gewinne aus der Veräußerung von Anlagen abzüglich realisierter und nicht realisierter Verluste (einschließlich Gebühren und Aufwendungen). Für den Fall, dass die bei der Veräußerung von Anlagen realisierten Gewinne abzüglich der realisierten und nicht realisierten Verluste negativ sind, können die Fonds dennoch Dividenden aus den Nettokapitalerträgen und/oder Kapital bezahlen.
(iii) Andere Mittel (einschließlich Kapital), die nach dem Gesetz aus dem betreffenden Fonds bzw. der betreffenden Anteilsklasse des betreffenden Fonds ausgeschüttet werden können.

Verwaltungsgebühren und andere Gebühren oder ein Teil davon können dem Kapital belastet werden. Das kann dazu führen, dass das Kapital sinkt und Erträge mit einem verminderten Potenzial für zukünftiges Kapitalwachstum erwirtschaftet werden. Dieser Zyklus kann sich solange fortsetzen, bis das Kapital aufgezehrt ist. Der Grund für die Belastung des Kapitals ist, den an die Anteilinhaber ausschüttbaren Betrag zu maximieren.

Für die Anteilsklasse Income II kann der Verwaltungsrat in seinem Ermessen entscheiden, die Gebühren aus dem Kapital zu bezahlen und das Renditedifferenzial zwischen den jeweiligen abgesicherten Anteilsklassen und den grundlegenden Anteilsklassen zu berücksichtigen (was einer Ausschüttung aus dem Kapital entspricht). Das Renditedifferenzial kann positiv oder negativ sein und wird unter Berücksichtigung des Beitrags der Anteilsklassenbesicherung aus den besicherten Klassen berechnet.

Im Fall der Anteilsklassen M Retail, des PIMCO Asia High Yield Bond Fund, des Asia Strategic Interest Bond Fund, des Euro Income Bond Fund, des Euro Short-Term Fund, des Income Fund, des Low Duration Income Fund, des Mortgage Opportunities Fund und des US Short-Term Fund werden, mit Ausnahme der Anteilsklassen G Institutional, G Retail, Class E ausschüttend Q, Class E ausschüttend II Q und Investor ausschüttend A, Dividendenausschüttungen monatlich festgesetzt und je nach Wahl des Anteilinhabers monatlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Im Fall der Anteilsklassen Administrative des Diversified Income Fund wird die Dividendenausschüttung ab dem 1. Januar 2022 monatlich festgesetzt.

Im Fall der Anteilsklassen N Retail wird die Dividendenausschüttung des Diversified Income Fund monatlich festgesetzt.

Für die Anteilsklassen BE Retail, BM Retail und BN Retail werden 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 Fonds zurück. Die Anteilinhaber können sich entscheiden, die Dividendenausschüttungen in zusätzliche Anteile zu reinvestieren oder sich die Dividendenausschüttungen bar auszahlen zu lassen, indem sie das entsprechende Kästchen im Antragsformular auswählen.

Für die nachfolgenden Fonds wurde ein Teil der Dividendenausschüttungen gemäß der Betriebsergebnisrechnung aus dem Kapital gezahlt (Angaben in Tausend):

| Fonds | Am 30. Juni 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2021 abgeschlossener Berichtszeitraum |
|---|---|---|
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund | $ 50 | $ 0 |
| PIMCO Capital Securities Fund | 32 | 0 |
| PIMCO Climate Bond Fund | 1 | 0 |
| Diversified Income Fund | 6,698 | 0 |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | 1,317 | 810 |
| Dynamic Bond Fund | 331 | 0 |
| Dynamic Multi-Asset Fund | € 2,994 | € 3,474 |
| Global Bond Fund | $ 944 | $ 0 |
| Global Bond Ex-US Fund | 0 | 1 |
| PIMCO Global Core Asset Allocation Fund | 1,533 | 885 |
| Global High Yield Bond Fund | 1,504 | 0 |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund | 0 | 5 |
| Global Low Duration Real Return Fund | 21 | 41 |
| Global Real Return Fund | 883 | 0 |
| Income Fund | 191 | 0 |
| Low Average Duration Fund | 115 | 0 |
| Low Duration Opportunities Fund | 772 | 0 |
| Total Return Bond Fund | 123 | 0 |
| UK Corporate Bond Fund | £ 319 | £ 0 |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | 67 | 28 |

## 6. SOFT COMMISSIONS

Die Gesellschaft bzw. ihre Anlageberatungsgesellschaft kann Transaktionen im Namen der Fonds über oder mit Unterstützung von Ausführungsmaklern durchführen, die zusätzlich zur routinemäßigen Order-Ausführung gelegentlich Güter, Dienstleistungen oder andere Vorteile wie etwa Research- und Beratungsdienste für die Gesellschaft oder ihre Beauftragten bereitstellen oder beschaffen können. Die Gesellschaft bzw. ihre Anlageberatungsgesellschaft kann diesen Brokern Full-Service-Provisionssätze zahlen, die teilweise für die Bereitstellung zulässiger Güter oder Dienstleistungen verwendet werden können. Diejenigen Anlageberatungsgesellschaften, bei denen es sich um Wertpapierfirmen handelt, die der Richtlinie über Märkte für Finanzinstrumente („MiFID“) unterliegen oder die gleichwertigen aufsichtsrechtlichen Bestimmungen unterworfen sind, müssen Research-Leistungen Dritter, die sie im Zusammenhang mit der Verwaltung des Vermögens der einzelnen Fonds kaufen, direkt aus ihren eigenen Mitteln bezahlen.

## 7. GETRENNTE HAFTUNG

Die Gesellschaft ist eine offene Investmentgesellschaft des Umbrella-Typs mit variablem Kapital und Haftungstrennung zwischen ihren Teilfonds. 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. ÄNDERUNGEN AM PROSPEKT, AN DER GRÜNDUNGSUKRUNDE UND DER SATZUNG

Am 7. Februar 2022 wurden der Prospekt und die Ergänzungen für die Gesellschaft aufgrund der Auflegung von Back-End-Anteilsklassen, und zwar „BE Retail“, „BN Retail“ und „BM Retail“ (die „Back-End-Anteilsklassen“), im Diversified Income Fund, dem Dynamic Multi-Asset Fund, dem Emerging Markets Bond Fund, dem Global High Yield Bond Fund und dem StockPLUS™ Fund aktualisiert. Darüber hinaus wird für die GBP-Anteilsklassen in Bezug auf jeden Fonds kein Ausgabeaufschlag erhoben und der Abschreibungszeitraum für den PIMCO Climate Bond Fund, den PIMCO ESG Income Fund und den Income Fund II wurde von einem Jahr auf drei Jahre verlängert.

Am 13. April 2022 wurde im Abschnitt „ESG“ des Verkaufsprospekts eine Definition für „festverzinsliche ESG-Wertpapiere“ hinzugefügt, die beschreibt, was eine grüne Anleihe, eine soziale Anleihe, eine nachhaltige Anleihe und eine nachhaltigkeitsbezogene Anleihe ist. Am selben Tag wurde die Ergänzung für den PIMCO Climate Bond Fund im Zusammenhang mit der Beschreibung der „festverzinslichen ESG-Wertpapiere“ aktualisiert, um klarzustellen, dass der Fonds auch in andere Arten von festverzinslichen ESG-Wertpapieren investieren kann, einschließlich solcher aus dem Sektor der fossilen Brennstoffe. Am selben Tag wurden die Ergänzungen für den UK Sterling Long Average Duration Fund, den US Small Cap StocksPLUS™ Fund, den PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund und den PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund aus dem Verkaufsprospekt entfernt.

Am 13. April 2022 wurde die Ergänzung für den PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund aktualisiert, um die Angaben zum Gebührenverzicht zu berücksichtigen, und die Ergänzung für den Inflation Multi-Asset Fund wurde geändert, um die Namensänderung des Fonds von „Inflation Strategy Fund“ in „Inflation Multi-Asset Fund“ zu berücksichtigen. Darüber hinaus wurde die Ergänzung aktualisiert, um die vom Fonds verwendete Benchmark zu ändern und die Senkung der einheitlichen Verwaltungsgebühr widerzuspiegeln, die der Fonds für die verschiedenen Anteilsklassen erhebt. Die Angaben zu den Anlagen des Fonds in Aktien bzw. aktienähnlichen Wertpapieren wurden ebenfalls geändert. Die Ergänzung für den PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund wurde geändert, um die Senkung der vom Fonds erhobenen Verwaltungsgebühr widerzuspiegeln. In dieser Hinsicht wurde die Verwaltungsgebühr für die Class E, die Class M Retail, die Class G Retail und die Class T jeweils um 31 Basispunkte gesenkt. Die in Bezug auf die Class R erhobene Verwaltungsgebühr wurde um 17 Basispunkte gesenkt.

Am 22. April 2022 wurden die Ergänzungen für den PIMCO European Short-Term Opportunities Fund und den Euro Short-Term Fund aktualisiert, um eine Änderung der Definition in Bezug auf den „Handelstag“ für die Fonds von „jeder Tag, an dem die Banken in München, Deutschland, für den Geschäftsverkehr geöffnet sind …“ in „jeder Tag, an dem die Banken in England für den Geschäftsverkehr geöffnet sind …“, zu berücksichtigen, nachdem bestimmte Portfoliomanager der PIMCO Europe GmbH von München in die Niederlassung London umgezogen sind.

Am 01. Juni 2022 wurde die Ergänzung für den PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund aktualisiert, um einen Gebührenverzicht von 0,30 % zu berücksichtigen, der ab dem 1. Juni 2022 in Bezug auf die Verwaltungsgebühr für alle Anteilsklassen des Fonds (mit Ausnahme der Class Z) gilt, am 1. Juni 2023 auf 0,15 % gesenkt wird und am 1. Juni 2024 vollständig ausläuft.

Am 8. Juni 2022 wurden der Low Duration Fund, der Diversified Income ESG Fund und der Emerging Local Bond ESG Fund von der Zentralbank zugelassen, und die Ergänzungen für diese Fonds wurden in den konsolidierten Verkaufsprospekt aufgenommen.

Am 13. Juni 2022 wurden die Ergänzungen für den PIMCO ESG Income Fund, den Global Bond ESG Fund, den Emerging Markets Bond ESG Fund und den Global Investment Grade Credit ESG Fund aktualisiert, in Übereinstimmung mit den Klassifizierungsanforderungen von Artikel 8 und um eindeutig festzulegen, dass die Fonds im Rahmen ihres Ansatzes für nachhaltige Anlagen ökologische und soziale Merkmale bewerben müssen (mit der Feststellung, dass nachhaltige Anlagen zwar weiterhin Teil des Ziels der Fonds sein werden, „nachhaltige Investitionen“ jedoch nicht Teil des jeweiligen Anlageziels sind). Die Fonds werden weiterhin in nachhaltige Anlagen investieren, ein ökologisches und soziales Ausschlussscreening durchführen und mit Emittenten bezüglich deren ESG-Praktiken in Dialog treten.

An der Gründungsurkunde und der Satzung der Gesellschaft wurden während des Geschäftsjahres keine Änderungen vorgenommen.

## 9. GEBÜHREN UND KOSTEN

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

Mit Ausnahme der BN Retail-Anteile, der BM Retail-Anteile und der BE Retail-Anteile, wie in der entsprechenden Fondsergänzung offengelegt, darf die Gesamtgebühr 2,50 % p. a. des Nettoinventarwerts des jeweiligen Fonds nicht übersteigen.

### (b) Verwaltungsgebühr

Die Verwaltungsgesellschaft erbringt oder liefert für jeden Fonds, wie im Verkaufsprospekt beschrieben, Anlageberatungs-, Administrations-, Verwahr- und sonstige Dienste, für die jeder Fonds eine einzige Verwaltungsgebühr an die Verwaltungsgesellschaft zahlt. Die Verwaltungsgebühr (wie im Verkaufsprospekt definiert) für jeden Fonds läuft an jedem Handelstag (wie in der Ergänzung für den jeweiligen Fonds definiert) auf und ist monatlich rückwirkend zahlbar. Die Verwaltungsgesellschaft kann die Verwaltungsgebühr vollständig oder teilweise an die Anlageberatungsgesellschaften entrichten, um die von diesen erbrachten Anlageberatungs- und anderen Dienste zu bezahlen und damit die Anlageberatungsgesellschaften die Kosten für die Administrations-, Verwahr- und anderen Dienste begleichen können, die die Verwaltungsgesellschaft für die Fonds erbracht hat.

Die Verwaltungsgebühr für die einzelnen Klassen der einzelnen Fonds (angegeben in Prozent pro Jahr ihres NIW) lautet wie folgt:

| | Anteilsklassen G Inst'l; Inv, Admin (%) | H Inst'l (%) | BE Retail BM Retail BN Retail E Class, G Retail, M Retail, N Retail, T Class (%) | Class R (%) | Class W (%) |
|---|---|---|---|---|---|
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund | 0,65 | 0,82 | 1,55 | k. A. | k. A. |
| Asia Strategic Interest Bond Fund | 0,65 | k. A. | 1,50 | k. A. | k. A. |
| PIMCO Capital Securities Fund | 0,79 | k. A. | 1,69 | 0,93 | k. A. |
| PIMCO Climate Bond Fund[1] | 0,52 | k. A. | 1,42 | k. A. | k. A. |
| Commodity Real Return Fund | 0,74 | 0,91 | 1,64 | k. A. | k. A. |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | 0,90 | k. A. | 1,80 | k. A. | k. A. |
| Diversified Income Fund | 0,69 | 0,86 | 1,59 | k. A. | 0,55 |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | 0,69 | k. A. | 1,59 | k. A. | k. A. |
| Dynamic Bond Fund | 0,90 | 1,07 | 1,80 | 0,99 | k. A. |
| Dynamic Multi-Asset Fund | 0,85 | 1,02 | 1,85 | k. A. | k. A. |
| Emerging Local Bond Fund | 0,89 | 1,06 | 1,89 | k. A. | k. A. |
| Emerging Markets Bond Fund | 0,79 | 0,96 | 1,69 | k. A. | k. A. |
| Emerging Markets Bond ESG Fund | 0,89 | k. A. | 1,74 | k. A. | k. A. |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | 0,95 | k. A. | 1,85 | k. A. | k. A. |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund[2] | 0,65 | k. A. | 1,55 | k. A. | k. A. |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 0,85 | k. A. | 1,75 | k. A. | k. A. |
| PIMCO ESG Income Fund | 0,59 | k. A. | 1,49 | 0,82 | k. A. |
| Euro Bond Fund | 0,46 | k. A. | 1,36 | k. A. | k. A. |
| Euro Credit Fund[3] | 0,46 | 0,38 | 1,36 | k. A. | k. A. |
| Euro Income Bond Fund | 0,49 | k. A. | 1,39 | k. A. | k. A. |
| Euro Long Average Duration Fund | 0,46 | k. A. | k. A. | k. A. | k. A. |
| Euro Short-Term Fund[4] | 0,29 | k. A. | 1,04 | k. A. | k. A. |
| PIMCO European High Yield Bond Fund | 0,55 | k. A. | k. A. | k. A. | k. A. |
| PIMCO European Short-Term Opportunities Fund[5] | 0,32 | 0,49 | 0,82 | k. A. | k. A. |
| Global Advantage Fund | 0,70 | k. A. | 1,70 | k. A. | k. A. |
| Global Bond Fund | 0,49 | 0,66 | 1,39 | 0,76 | 0,39 |
| Global Bond ESG Fund | 0,52 | k. A. | 1,42 | k. A. | k. A. |
| Global Bond Ex-US Fund | 0,49 | 0,66 | 1,39 | k. A. | k. A. |

| | Anteilsklassen G Inst'l; Inv, Admin (%) | H Inst'l (%) | BE Retail BM Retail BN Retail E Class, G Retail, M Retail, N Retail, T Class (%) | Class R (%) | Class W (%) |
|---|---|---|---|---|---|
| PIMCO Global Core Asset Allocation Fund | 0,95 | 1,12 | 2,15 | k. A. | k. A. |
| Global High Yield Bond Fund | 0,55 | 0,72 | 1,45 | 0,80 | k. A. |
| Global Investment Grade Credit Fund | 0,49 | 0,66 | 1,39 | 0,76 | 0,39 |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund | 0,52 | k. A. | 1,42 | k. A. | k. A. |
| Global Low Duration Real Return Fund | 0,49 | k. A. | 1,39 | k. A. | k. A. |
| Global Real Return Fund | 0,49 | 0,66 | 1,39 | 0,76 | k. A. |
| Income Fund | 0,55 | 0,72 | 1,45 | 0,80 | k. A. |
| Income Fund II(6) | 0,55 | k. A. | 1,45 | k. A. | k. A. |
| Inflation Multi-Asset Fund | 0,79 | k. A. | 1,69 | k. A. | k. A. |
| Low Average Duration Fund | 0,46 | 0,63 | 1,36 | 0,75 | k. A. |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 0,49 | k. A. | 1,39 | k. A. | k. A. |
| Low Duration Income Fund(7) | 0,55 | 0,72 | 1,45 | k. A. | k. A. |
| Low Duration Opportunities Fund | 0,49 | k. A. | 1,20 | k. A. | k. A. |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | 0,99 | k. A. | 1,89 | k. A. | k. A. |
| Mortgage Opportunities Fund | 0,69 | 0,86 | 1,59 | k. A. | k. A. |
| StocksPLUS™ Fund | 0,55 | 0,72 | 1,45 | k. A. | k. A. |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | 0,69 | k. A. | k. A. | k. A. | k. A. |
| Strategic Income Fund | 0,85 | k. A. | 1,75 | k. A. | k. A. |
| Total Return Bond Fund | 0,50 | 0,67 | 1,40 | 0,77 | k. A. |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 1,40 | k. A. | 2,50 | k. A. | k. A. |
| UK Corporate Bond Fund | 0,46 | k. A. | k. A. | k. A. | k. A. |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | 0,46 | k. A. | k. A. | k. A. | k. A. |
| US High Yield Bond Fund | 0,55 | 0,72 | 1,45 | 0,80 | k. A. |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | 0,49 | k. A. | 1,39 | k. A. | k. A. |
| US Short-Term Fund(8) | 0,45 | 0,62 | 0,85 | k. A. | k. A. |

(1) Bei allen Klassen wird bei dieser Zahl ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,30 % p. a. berücksichtigt. Der Gebührenverzicht wird am 1. Juni 2023 auf 0,15 % reduziert. Der Gebührenverzicht läuft am 1. Juni 2024 ab und kann bis zu dem Zeitpunkt verlängert werden, zu dem der Manager durch vorherige schriftliche Mitteilung an die Anteilinhaber des Fonds entscheidet, künftig diese Gebühr aufzuheben, nicht mehr anzuwenden oder zu reduzieren.

(2) Bei allen Klassen ist ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,30 % p. a. nicht berücksichtigt. Der Gebührenverzicht wird am 1. Juni 2023 auf 0,15 % p. a. gesenkt. Die Gebührenverzichte läuft zum 1. Juni 2024 ab und kann sich bis zu dem Zeitpunkt verlängern, zu dem der Manager durch vorherige schriftliche Mitteilung an die Anteilinhaber des Teilfonds entscheidet, diese Gebühr aufzuheben oder künftig nicht mehr anzuwenden.

(3) Bei der Class H Institutional wird ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,25 % p. a. berücksichtigt. Der Gebührenverzicht verlängert sich bis zum 30. Juni 2023 und läuft zum 01. Juli 2023 ab.

(4) Die Sätze der Klasse Institutional und der Klasse E berücksichtigen einen Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,11 % p. a. Der Gebührenverzicht gilt bis zum 19. Januar 2023.

(5) Die Sätze der Klassen Institutional und H Institutional berücksichtigen einen Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,14 % p. a. Der Satz der Klasse E berücksichtigt einen Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,54 % p. a. Der Gebührenverzicht läuft am 18. Januar 2023 ab.

(6) Bei allen Klassen wird bei dieser Zahl ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,04 % p.a. berücksichtigt. Der Gebührenverzicht läuft zum 01. Januar 2023 ab.

(7) Bei allen Klassen wird bei dieser Zahl ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,05 % p. a. berücksichtigt. Der Gebührenverzicht für alle Klassen verlängert sich bis zum 31. Dezember 2022 und läuft zum 01. Januar 2023 ab.

(8) 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, der sich bis zu dem Zeitpunkt verlängert, zu dem der Manager durch vorherige schriftliche Mitteilung an die Anteilinhaber des Teilfonds entscheidet, diesen Gebührenverzicht künftig nicht mehr anzuwenden oder zu reduzieren.

Die Verwaltungsgebühren für alle Fonds (mit Ausnahme des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund, Inflation Multi-Asset Fund and PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund) blieben gegenüber dem 31. Dezember 2021 unverändert, mit Ausnahme der oben genannten Änderungen in Bezug auf den Gebührenverzicht.

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 Fonds direkt oder indirekt erbringen. Da es sich bei der Verwaltungsgebühr um einen festen Betrag handelt, wird das Risiko von Preiserhöhungen bei den Kosten für durch die Verwaltungsgebühr abgedeckte Dienste von der Verwaltungsgesellschaft und nicht von den 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 kämen alle Preissenkungen für von der Verwaltungsgebühr abgedeckte Dienste der Verwaltungsgesellschaft und nicht den Anteilinhabern zugute. Dies betrifft u.a. geringere Kosten (in Prozent des Nettovermögens) aufgrund eines steigenden Nettovermögens.

Aufgrund der Art der Emission von Class Z wird in der Betriebsergebnisrechnung keine Verwaltungsgebühr ausgewiesen (die Class Z werden primär für andere Fonds der Gesellschaft oder für Direktanlagen durch institutionelle Anleger angeboten, die mit den Anlageberatungsgesellschaften oder einem verbundenen Unternehmen von PIMCO eine Anlageverwaltungsvereinbarung oder sonstige Vereinbarung abgeschlossen haben). Um doppelte Gebühren zu vermeiden, wird die Verwaltungsgebühr für die Class Z auf 0,00 % pro Jahr festgesetzt.

### (c) Anlageberatungsdienste

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft Anlageberatungsdienstleistungen. Zu diesen Dienstleistungen gehören die Anlage und Wiederanlage der Vermögenswerte jedes Fonds. Die Gebühren der Anlageberatungsgesellschaften (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr beglichen.

### (d) Administrations-, Verwahr- sowie sonstige Dienste

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft Administrations-, Verwahr- und sonstige Dienste. Diese Dienste beinhalten Administrations-, Übertragungsstellen-, Fondsbuchhaltungs-, Verwahr- und Unterdepotdienste für die einzelnen Fonds. Die Gebühren und Aufwendungen des Administrators und der Verwahrstelle (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr bzw. von den Anlageberatungsgesellschaften gezahlt.

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft bestimmte sonstige Dienste. Diese können enthalten: Dienste der Notierungs- und Zahlstellen- sowie sonstige Vertretungsdienste vor Ort, Buchhaltungs-, Prüf-, Rechts- sowie sonstige Dienste qualifizierter Berater, Gesellschaftssekretärsdienste, Druck-, Veröffentlichungs- und Übersetzungsdienste sowie die Erbringung und Koordination bestimmter Aufsichts-, Administrations- und Anteilinhaberdienste, die für den Betrieb der Fonds erforderlich sind. Gebühren und ordentliche Aufwendungen für diese Dienste (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft oder von den Anlageberatungsgesellschaften für die Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr gezahlt.

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

Die Gesellschaft bezahlte den unabhängigen Verwaltungsratsmitgliedern während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2022 Honorare in Höhe von €90.000 (30. Juni 2021: €90.000). Darüber hinaus werden jedem unabhängigen Verwaltungsratsmitglied alle angemessenen Auslagen erstattet. Nicht unabhängige Verwaltungsratsmitglieder haben keinen Anspruch auf eine gesonderte Vergütung für ihre Tätigkeit als Verwaltungsratsmitglied der Fonds. 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 Fondsanteile als Finanzierungsmittel verwenden, und um sonstige verbundene Aufwendungen (wie in der Ergänzung für den jeweiligen Fonds definiert) zu erstatten. Die Verwaltungsgesellschaft erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle 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 Fonds 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 Fonds relevant sind.

Pläne oder Programme, die Fondsanteile 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 Fonds, der auf die Investor Classes entfällt. Die Servicegebühr hat sich seit dem 31. Dezember 2021 nicht geändert. Die Servicegebühr wird aus dem NIW gezahlt, der auf den NIW der Investor Classes dieser Fonds entfällt. Die Servicegebühr für die einzelnen Fonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich im Nachhinein zahlbar. Die Verwaltungsgesellschaft darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Servicegebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

**Bestandspflegegebühr** Die Bestandspflegegebühr für Administrative-Anteilsklassen ist zahlbar an die Vertriebsstelle für persönliche Dienstleistungen, die sie den Anteilinhabern der Fonds 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 Fondsanteilen liefern, Informationen von der Gesellschaft an die Anteilinhaber weitergeben, laufende Beratungsleistungen in Bezug auf die Eignung bestimmter vom Fonds 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 Fonds berechnet und den jeweiligen Anteilsklassen der betreffenden Fonds wie im Verkaufsprospekt angegeben zugewiesen. Die Bestandspflegegebühr für die einzelnen Fonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich rückwirkend zahlbar. Die Vertriebsstelle darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Bestandspflegegebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

Die Bestandspflegegebühr für die einzelnen 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 seit dem 31. Dezember 2021 nicht geändert.

**(e) Vertriebsgebühr**
Die Vertriebsgebühr, die für die Anteilsklassen der Class T anwendbar ist, wird an die Vertriebsstelle für Dienstleistungen bezahlt, die diese Anteilinhabern des Fonds erbracht hat.

Die Vertriebsstelle erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Inhaber von Anteilsklassen der T Class. Die Vertriebsgebühr errechnet sich jährlich aus 0,40 % des NIW des jeweiligen Teilfonds, der auf die Anteilsklassen der Class T entfällt, außer in Bezug auf den PIMCO Asia High Yield Bond Fund, den PIMCO Credit Opportunities Bond Fund, den Dynamic Bond Fund, den Euro Bond Fund, den Global Bond Fund, den Global Bond ESG Fund, den Global Bond Ex-US Fund, den Global Low Duration Real Return Fund, den Global Real Return Fund, den Low Duration Opportunities Fund, den PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund und den Total Return Bond Fund. Für diese Teilfonds wird eine Vertriebsgebühr in Höhe von 0,30 % p.a. auf den NIW der Anteilsklasse Class T dieser Teilfonds bezahlt.

Lediglich in Bezug auf die Anteilsklassen BE Retail, BM Retail und BN Retail kann die Vertriebsgebühr, sofern in der entsprechenden Ergänzung angegeben, bis zu 1 % des NIW betragen, so dass die Gesamtgebühr 2,50 % des NIW der Anteilsklassen BE Retail, BM Retail und BN Retail übersteigen kann.

Die Vertriebsgebühr für die einzelnen Fonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich im Nachhinein zahlbar. Die Vertriebsstelle darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Vertriebsgebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

**(f) Ausgabenbegrenzung (einschließlich Verzicht auf und Nachzahlung von Verwaltungsgebühren)**
Gemäß der geltenden Fassung des Verwaltungsvertrags zwischen der Gesellschaft und der Verwaltungsgesellschaft vom 28. Januar 1998 ist die Verwaltungsgesellschaft mit der Gesellschaft übereingekommen, die gesamten jährlichen Betriebskosten eines Fonds für alle Klassen des Fonds zu verwalten, wobei sie auf ihre Verwaltungsgebühr ganz oder teilweise verzichtet bzw. diese ganz oder teilweise reduziert oder erstattet, falls (und für den Zeitraum, in dem) diese Betriebskosten aufgrund gezahlter Gründungskosten sowie anteiliger Verwaltungsratshonorare die Summe aus der Verwaltungsgebühr der Klasse dieses Fonds (vor Anrechnung eines etwa anwendbaren Verzichts auf die Verwaltungsgebühr) aus etwa anfallenden Service- und Bestandspflegegebühren sowie aus sonstigen von dieser Fondsklasse zu tragenden Kosten, die die oben beschriebene Verwaltungsgebühr nicht abdeckt, (ausgenommen Gründungskosten und anteilige Verwaltungsratshonorare) zzgl. 0,0049 % pro Jahr (täglich auf Basis des Fonds-NIW berechnet) überschreiten.

In jedem Monat, in dem der Verwaltungsvertrag gilt, darf die Verwaltungsgesellschaft von einem 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 13 offengelegt.

Zum 30. Juni 2022 hielt die Verwaltungsgesellschaft 1.763.095 (31. Dezember 2021: 2.203.631) Anteile des US Short-Term Fund.

Jeder der Fonds kann in die anderen Fonds der Gesellschaft und/oder andere Organismen für gemeinsame Anlagen investieren, die von der Anlageberatungsgesellschaft oder mit dieser verbundenen Unternehmen verwaltet werden („verbundene Fonds“).

Die folgenden Teilfonds hielten im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022 Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds. Diese Anlagen wurden zum Zweck der Darstellung der Summe der Fonds der Gesellschaft eliminiert.

| | 30. Juni 2022 |
|---|---|
| **Fonds** | **Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds** |
| Diversified Income Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Diversified Income Fund | Asia Strategic Interest Bond Fund |
| Diversified Income Fund | PIMCO European High Yield Bond Fund |
| Diversified Income Fund | US Short-Term Fund |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | Asia Strategic Interest Bond Fund |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | PIMCO European High Yield Bond Fund |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | US Short-Term Fund |
| Dynamic Bond Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Dynamic Bond Fund | Asia Strategic Interest Bond Fund |
| Dynamic Bond Fund | US Short-Term Fund |

| Fonds | 30. Juni 2022<br>Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds |
|---|---|
| Dynamic Multi-Asset Fund | PIMCO Capital Securities Fund |
| Dynamic Multi-Asset Fund | Income Fund |
| Emerging Local Bond Fund | PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund |
| Emerging Local Bond Fund | Asia Strategic Interest Bond Fund |
| Emerging Markets Bond Fund | PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund |
| Emerging Markets Bond Fund | Asia Strategic Interest Bond Fund |
| Euro Income Bond Fund | PIMCO European High Yield Bond Fund |
| Euro Income Bond Fund | US Short-Term Fund |
| Global Bond Fund | PIMCO European High Yield Bond Fund |
| Global Bond Fund | Global Bond Ex-US Fund |
| Global Bond Fund | UK Corporate Bond Fund |
| Global Bond Fund | US Short-Term Fund |
| Global Bond ESG Fund | Global Investment Grade Credit ESG Fund |
| Global High Yield Bond Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Global High Yield Bond Fund | PIMCO European High Yield Bond Fund |
| Global Investment Grade Credit Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Global Investment Grade Credit Fund | Asia Strategic Interest Bond Fund |
| Global Investment Grade Credit Fund | PIMCO European High Yield Bond Fund |
| Global Libor Plus Bond Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Global Libor Plus Bond Fund | Asia Strategic Interest Bond Fund |
| Low Average Duration Fund | US Short-Term Fund |
| Total Return Bond Fund | US Short-Term Fund |
| US High Yield Bond Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | Asia Strategic Interest Bond Fund |

Die folgenden Teilfonds hielten zum 31. Dezember 2021 Umbrellafonds-interne Überkreuzinvestitionen. Diese Anlagen wurden zum Zweck der Darstellung der Summe der Gesellschaft im vergleichenden Finanzstatus der Teilfonds eliminiert.

| Fonds | 31. Dez. 2021<br>Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds |
|---|---|
| Diversified Income Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Diversified Income Fund | Asia Strategic Interest Bond Fund |
| Diversified Income Fund | PIMCO European High Yield Bond Fund |
| Diversified Income Fund | US Short-Term Fund |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | Asia Strategic Interest Bond Fund |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | PIMCO European High Yield Bond Fund |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | US Short-Term Fund |
| Dynamic Bond Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Dynamic Bond Fund | Asia Strategic Interest Bond Fund |
| Dynamic Bond Fund | US Short-Term Fund |
| Dynamic Multi-Asset Fund | PIMCO Capital Securities Fund |
| Dynamic Multi-Asset Fund | Income Fund |
| Emerging Local Bond Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Emerging Local Bond Fund | Asia Strategic Interest Bond Fund |
| Emerging Markets Bond Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Emerging Markets Bond Fund | Asia Strategic Interest Bond Fund |
| Euro Income Bond Fund | PIMCO European High Yield Bond Fund |
| Euro Income Bond Fund | US Short-Term Fund |
| Global Bond Fund | PIMCO European High Yield Bond Fund |
| Global Bond Fund | Global Bond Ex-US Fund |
| Global Bond Fund | UK Corporate Bond Fund |
| Global Bond Fund | US Short-Term Fund |
| Global Bond ESG Fund | Global Investment Grade Credit ESG Fund |
| PIMCO Global Core Asset Allocation Fund | Mortgage Opportunities Fund |
| Global High Yield Bond Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Global High Yield Bond Fund | PIMCO European High Yield Bond Fund |
| Global Investment Grade Credit Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Global Investment Grade Credit Fund | Asia Strategic Interest Bond Fund |

| Fonds | 31. Dez. 2021<br>Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds |
|---|---|
| Global Investment Grade Credit Fund | PIMCO European High Yield Bond Fund |
| Low Average Duration Fund | US Short-Term Fund |
| Low Duration Opportunities Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Low Duration Opportunities Fund | Asia Strategic Interest Bond Fund |
| Total Return Bond Fund | US Short-Term Fund |
| US High Yield Bond Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | Asia Strategic Interest Bond Fund |

Die folgenden Teilfonds hielten im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2021 Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds. Diese Anlagen wurden zum Zweck der Darstellung der Summe der Gesellschaft in der vergleichenden Betriebsergebnisrechnung und im Ausweis der Nettovermögensänderungen der Teilfonds eliminiert.

| Fonds | 30. Juni 2021<br>Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds |
|---|---|
| Diversified Income Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Diversified Income Fund | Asia Strategic Interest Bond Fund |
| Diversified Income Fund | PIMCO European High Yield Bond Fund |
| Diversified Income Fund | US Short-Term Fund |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | Asia Strategic Interest Bond Fund |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | PIMCO European High Yield Bond Fund |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | US Short-Term Fund |
| Dynamic Bond Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Dynamic Bond Fund | Asia Strategic Interest Bond Fund |
| Dynamic Bond Fund | US Short-Term Fund |
| Dynamic Multi-Asset Fund | PIMCO Capital Securities Fund |
| Dynamic Multi-Asset Fund | Income Fund |
| Emerging Local Bond Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Emerging Local Bond Fund | Asia Strategic Interest Bond Fund |
| Emerging Markets Bond Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Emerging Markets Bond Fund | Asia Strategic Interest Bond Fund |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Euro Income Bond Fund | PIMCO European High Yield Bond Fund |
| Euro Income Bond Fund | US Short-Term Fund |
| Global Bond Fund | PIMCO European High Yield Bond Fund |
| Global Bond Fund | Global Bond Ex-US Fund |
| Global Bond Fund | UK Corporate Bond Fund |
| Global Bond Fund | US Short-Term Fund |
| Global Bond ESG Fund | Global Investment Grade Credit ESG Fund |
| PIMCO Global Core Asset Allocation Fund | Mortgage Opportunities Fund |
| Global High Yield Bond Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Global High Yield Bond Fund | PIMCO European High Yield Bond Fund |
| Global Investment Grade Credit Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Global Investment Grade Credit Fund | Asia Strategic Interest Bond Fund |
| Global Investment Grade Credit Fund | PIMCO European High Yield Bond Fund |
| Low Average Duration Fund | US Short-Term Fund |
| Low Duration Opportunities Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| Low Duration Opportunities Fund | Asia Strategic Interest Bond Fund |
| Total Return Bond Fund | US Short-Term Fund |
| US High Yield Bond Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | Asia Strategic Interest Bond Fund |

Bestimmte Fonds investieren in die Class Z des PIMCO China Bond Fund und des PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund, die als mit der Gesellschaft verbunden gelten. Aufgrund der Ausgestaltung des Angebots der Class Z und um doppelte Gebühren zu vermeiden, beträgt die Verwaltungsgebühr für die Class Z beider Fonds 0,00 % pro Jahr.

Bestimmte Fonds investieren in den PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF, den PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF, den PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF und den PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF, und diese gelten als mit der Gesellschaft verbunden. Da diese Fonds keine gebührenfreien Anteilsklassen haben, wird die Verwaltungsgebühr vom Dachfonds und dem verbundenen Zielfonds bezahlt. Ein Verzicht auf die Anlageberatungsgebühr wird daher vor der Zahlung durch den Fonds an die Verwaltungsgesellschaft ausgeglichen, was in der Betriebsergebnisrechnung innerhalb der Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft ausgewiesen wird.

Während der Berichtszeiträume zum 30. Juni 2022 und zum 30. Juni 2021 kauften und verkauften die unten erwähnten Teilfonds Wertpapiere verbundener Teilfonds, sie nahmen Käufe und Verkäufe in Bezug auf Überkreuzinvestitionen und Käufe und Verkäufe von Anlagen in verbundenen Teilfonds vor (Angaben in Tausend):

| | 30. Juni 2022 | |
|---|---|---|
| Fonds | Käufe | Verkäufe |
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund | $ 450.898 | $ 528.533 |
| Asia Strategic Interest Bond Fund | 82.359 | 82.711 |
| PIMCO Capital Securities Fund | 80.074 | 524.621 |
| PIMCO Climate Bond Fund | 449 | 17.338 |
| Commodity Real Return Fund | 79.289 | 0 |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | 3.412 | 5.157 |
| Diversified Income Fund | 303.492 | 1.096.849 |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | 30.777 | 86.520 |
| Dynamic Bond Fund | 105.264 | 171.389 |
| Dynamic Multi-Asset Fund | 647 | 0 |
| Emerging Local Bond Fund | 886.434 | 905.374 |
| Emerging Markets Bond Fund | 476.521 | 763.429 |
| Emerging Markets Bond ESG Fund | 185.351 | 65.552 |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | 50.466 | 53.126 |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | 72.028 | 68.693 |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 796 | 952 |
| Euro Bond Fund | 255.645 | 189.222 |
| Euro Credit Fund | 80.048 | 111.228 |
| Euro Income Bond Fund | 209.995 | 297.005 |
| Euro Long Average Duration Fund | 5.104 | 4.123 |
| Euro Short-Term Fund | 30.546 | 42.154 |
| PIMCO European High Yield Bond Fund | 4.107 | 6.694 |
| PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | 34.936 | 36.870 |
| Global Advantage Fund | 91.947 | 77.527 |
| Global Bond Fund | 785.238 | 769.426 |
| Global Bond ESG Fund | 3.729 | 730 |
| Global Bond Ex-US Fund | 330.925 | 295.371 |
| PIMCO Global Core Asset Allocation Fund | 526.757 | 648.111 |
| Global High Yield Bond Fund | 634.659 | 964.028 |
| Global Investment Grade Credit Fund | 1.864.705 | 2.994.709 |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund | 59.019 | 63.891 |
| Global Low Duration Real Return Fund | 114.718 | 122.898 |
| Global Real Return Fund | 352.063 | 281.345 |
| Income Fund | 632.501 | 1.884.444 |
| Income Fund II | 3.404 | 3.000 |
| Inflation Multi-Asset Fund | 47.808 | 9.500 |
| Low Average Duration Fund | 315.626 | 247.122 |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 182.053 | 155.605 |
| Low Duration Income Fund | 115.594 | 151.082 |
| Low Duration Opportunities Fund | 83.207 | 71.406 |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | 16.121 | 13.400 |
| Mortgage Opportunities Fund | 826.458 | 912.334 |
| StocksPLUS™ Fund | 30.955 | 317.619 |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | 201 | 400 |
| Strategic Income Fund | 139.264 | 118.155 |
| Total Return Bond Fund | 363.416 | 571.790 |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 28.707 | 21.000 |

| | 30. Juni 2022 | |
|---|---|---|
| Fonds | Käufe | Verkäufe |
| UK Corporate Bond Fund | 7.714 | 6.714 |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | $ 6.832 | $ 10.266 |
| US High Yield Bond Fund | 720.899 | 966.445 |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | 151.908 | 163.585 |
| US Short-Term Fund | 415.891 | 385.870 |

| | 30. Juni 2021 | |
|---|---|---|
| Fonds | Käufe | Verkäufe |
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund | $ 476.155 | $ 310.434 |
| Asia Strategic Interest Bond Fund | 69.996 | 64.354 |
| PIMCO Capital Securities Fund | 845.165 | 1.191.736 |
| PIMCO Climate Bond Fund | 11.968 | 1.494 |
| Commodity Real Return Fund | 22.307 | 0 |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | 44.767 | 49.432 |
| Diversified Income Fund | 973.923 | 537.584 |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | 130.376 | 134.615 |
| Dynamic Bond Fund | 276.373 | 195.696 |
| Dynamic Multi-Asset Fund | 66.749 | 512 |
| Emerging Local Bond Fund | 1.523.472 | 1.681.711 |
| Emerging Markets Bond Fund | 1.455.269 | 1.411.919 |
| Emerging Markets Bond ESG Fund | 332.845 | 138.221 |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | 80.292 | 81.268 |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | 81.047 | 90.757 |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 4.216 | 11.101 |
| Euro Bond Fund | 246.021 | 385.391 |
| Euro Credit Fund | 185.502 | 181.361 |
| Euro Income Bond Fund | 165.192 | 143.934 |
| Euro Long Average Duration Fund | 9.359 | 19.356 |
| Euro Short-Term Fund | 218.575 | 47.256 |
| PIMCO European High Yield Bond Fund | 5.053 | 17.913 |
| PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | 64.040 | 37.222 |
| Global Advantage Fund | 84.451 | 77.945 |
| Global Bond Fund | 728.342 | 862.621 |
| Global Bond ESG Fund | 81.937 | 68.338 |
| Global Bond Ex-US Fund | 164.934 | 113.836 |
| PIMCO Global Core Asset Allocation Fund | 307.471 | 221.627 |
| Global High Yield Bond Fund | 882.601 | 847.028 |
| Global Investment Grade Credit Fund | 3.381.312 | 6.920.596 |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund | 55.455 | 42.453 |
| Global Low Duration Real Return Fund | 133.023 | 130.500 |
| Global Real Return Fund | 311.792 | 243.309 |
| Income Fund | 14.970.668 | 16.293.363 |
| Income Fund II | 5.201 | 2.800 |
| Inflation Multi-Asset Fund | 32.814 | 28.623 |
| Low Average Duration Fund | 271.544 | 150.048 |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 222.950 | 160.522 |
| Low Duration Income Fund | 212.426 | 210.954 |
| Low Duration Opportunities Fund | 562.966 | 308.701 |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | 35.204 | 27.500 |
| Mortgage Opportunities Fund | 1.481.018 | 1.550.800 |
| StocksPLUS™ Fund | 98.263 | 187.221 |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | 500 | 300 |
| Strategic Income Fund | 191.956 | 234.073 |
| Total Return Bond Fund | 523.024 | 931.031 |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 12.402 | 8.900 |
| UK Corporate Bond Fund | 41.989 | 205.885 |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | 33.182 | 51.886 |
| US High Yield Bond Fund | 692.948 | 634.867 |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | 123.870 | 167.666 |
| US Short-Term Fund | 151.853 | 1.137.458 |

Die folgende Tabelle zeigt den Wert der umlaufenden Anteile im Besitz der Allianz-Gruppe, von Fonds der Gesellschaft, von mit der Gesellschaft verbundenen Fonds und von Mitarbeitern der Anlageberatungsgesellschaften in ihrer Eigenschaft als verbundene Parteien der Gesellschaft. Dabei handelt es sich zum 30. Juni 2022 und zum 31. Dezember 2021 um über 20 % des Nettovermögens des Fonds.

| Fonds | 30. Juni 2022 % Gehalten | 31. Dez. 2021 % Gehalten |
|---|---|---|
| Asia Strategic Interest Bond Fund | 53,51 | 55,13 |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | 24,55 | 25,07 |
| Emerging Markets Bond Fund | 20,62 | 34,74 |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | 21,80 | k. A. |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 32,46 | 22,84 |
| Euro Credit Fund | k. A. | 20,77 |
| Euro Income Bond Fund | 20,23 | 26,26 |
| PIMCO European High Yield Bond Fund | 95,64 | 95,52 |
| PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | 29,98 | k. A. |
| PIMCO Global Core Asset Allocation Fund | 35,79 | 34,62 |
| Income Fund II | 71,13 | 91,35 |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | 85,45 | 94,07 |
| US Short-Term Fund | 30,73 | 38,70 |

Während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2022 verkaufte der Income Fund Wertpapiere im Wert von null USD (30. Juni 2021: USD null) an Repack Bond Collateral Ltd. (die „Körperschaft“), eine nach dem Recht der Kaimaninseln gegründete befreite Gesellschaft mit beschränkter Haftung, die eine verbundene Partei der Anlageberatungsgesellschaft ist. Es wurden keine Gebühren von der Körperschaft an die Anlageberatungsgesellschaft gezahlt. Zum 30. Juni 2022 hielt der Income Fund 9.694 Schuldverschreibungen (31. Dezember 2021: 9.694 Schuldverschreibungen) von BNP Paribas Issuance BV., die durch von der Körperschaft begebene Schuldverschreibungen besichert sind.

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

Zum 30. Juni 2022 hielt V. Mangala Ananthanarayanan 8.187,77 (31. Dezember 2021: 8.187,77) Anteile des PIMCO Asia High Yield Bond Fund, 8.757,87 (31. Dezember 2021: 8.757,87) Anteile des Dynamic Multi-Asset Fund, 22.515,83 (31. Dezember 2021: 22.028,26) Anteile des Income Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 30. Juni 2022 hielt Craig A. Dawson 18.118,23 (31. Dezember 2021: 18.118,23) Anteile des PIMCO Capital Securities Fund, 97.370,98 (31. Dezember 2021: 97.370,98) Anteile des Low Duration Income Fund, wobei es sich jeweils um Teilfonds der Gesellschaft handelt und 92.850,51 (31. Dezember 2021: 92.850,51) Anteile des Low Duration Opportunities Fund.

Zum 30. Juni 2022 hielt David M. Kennedy 4.587,18 (31. Dezember 2021: 4.729,05) Anteile des Emerging Markets Bond Fund und 16.786,79 (31. Dezember 2021: 16.786,79) Anteile des PIMCO Global Core Asset Allocation Fund. Beide sind Fonds der Gesellschaft.

Während der zum 30. Juni 2022 und 30. Juni 2021 endenden Berichtszeiträume hielt kein anderes Verwaltungsratsmitglied eine Beteiligung an Anteilen der Gesellschaft.

Während der zum 30. Juni 2022 und 30. Juni 2021 endenden Berichtszeiträume hielt der Sekretär keine Beteiligung an Anteilen der Gesellschaft.

Die Gesellschaft hatte während der Berichtszeiträume zum 30. Juni 2022 oder 30. Juni 2021 keine Angestellten.

## 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 und Finanzdaten für die Gesellschaft zu erhalten (was nach irischem Gesellschaftsrecht erforderlich ist), wurden die Beträge im Finanzstatus zu dem am 30. Juni 2022 geltenden Wechselkurs von Euro in US-Dollar (USD/EUR 0,95653) umgerechnet (31. Dezember 2021: USD/EUR 0,87935) und von Pfund Sterling in US-Dollar (USD/GBP 0,82342) (31. Dezember 2021: USD/GBP 0,73831) umgerechnet. Die Beträge in der Betriebsergebnisrechnung und im Ausweis der Nettovermögensänderungen wurden zu einem durchschnittlichen während des am 30. Juni 2022 endenden Berichtszeitraums geltenden Wechselkurs von Euro in US-Dollar (USD/EUR 0,91527) (30. Juni 2021: USD/EUR 0,82989) und von Pfund Sterling in US-Dollar (USD/GBP 0,77097) (30. Juni 2021: USD/GBP 0,72041) umgerechnet.

Die folgende Tabelle gibt die für die Umrechnung der Anlagen und sonstigen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf von der Funktionswährung des jeweiligen Fonds abweichende Währungen lauten, in Pfund Sterling, Euro und US-Dollar, die Funktionswährungen von Fonds der Gesellschaft, verwendeten Wechselkurse wieder.

Der Wechselkurs für den Argentinischen Peso („ARS“) zum 30. Juni 2022 enthält einen 109%igen Abschlag (31. Dezember 2021: 96 %) aufgrund der Abweichung zwischen dem offiziellen und dem inoffiziellen Wechselkurs Argentiniens.

| Fremd-währung | 30. Juni 2022 Präsentationswährung EUR | GBP | USD |
|---|---|---|---|
| AED | k. A. | k. A. | 3,67310 |
| ARS | 273,46878 | k. A. | 261,58000 |
| AUD | 1,52032 | 1,76609 | 1,45423 |
| BRL | 5,46713 | k. A. | 5,22945 |
| CAD | 1,34858 | 1,56658 | 1,28995 |
| CHF | 1,00086 | k. A. | 0,95735 |
| CLP | 979,44541 | k. A. | 936,86500 |
| CNH | 7,00891 | 8,14192 | 6,70420 |
| CNY | 6,99856 | k. A. | 6,69430 |
| COP | 4.350,22153 | k. A. | 4.161,10000 |
| CZK | 24,73550 | k. A. | 23,66015 |
| DKK | 7,43665 | 8,63881 | 7,11335 |
| DOP | k. A. | k. A. | 54,65000 |
| EGP | k. A. | k. A. | 18,80000 |
| EUR (or €) | 1,00000 | 1,16165 | 0,95653 |
| GBP (or £) | 0,86084 | 1,00000 | 0,82342 |
| GHS | k. A. | k. A. | 8,02000 |
| HKD | 8,20359 | k. A. | 7,84695 |
| HUF | 396,79000 | k. A. | 379,53995 |
| IDR | 15.574,58971 | k. A. | 14.897,50000 |
| ILS | 3,66132 | k. A. | 3,50215 |
| INR | 82,56179 | k. A. | 78,97250 |
| JPY (or ¥) | 142,02959 | 164,98911 | 135,85500 |
| KES | k. A. | k. A. | 117,90000 |
| KRW | 1.357,41214 | k. A. | 1.298,40000 |
| KZT | k. A. | k. A. | 470,25000 |
| MXN | 21,09274 | 24,50244 | 20,17575 |
| MYR | k. A. | k. A. | 4,40750 |
| NGN | k. A. | k. A. | 415,00000 |
| NOK | 10,32878 | 11,99846 | 9,87975 |
| NZD | 1,68146 | k. A. | 1,60836 |
| PEN | 3,97349 | k. A. | 3,80075 |
| PHP | k. A. | k. A. | 54,98500 |
| PKR | k. A. | k. A. | 204,62500 |
| PLN | 4,70019 | k. A. | 4,49585 |
| RON | k. A. | k. A. | 4,73145 |
| RSD | k. A. | k. A. | 112,24000 |
| RUB | 57,23838 | k. A. | 54,75000 |
| SEK | 10,71314 | 12,44496 | 10,24740 |
| SGD | 1,45495 | 1,69015 | 1,39170 |
| THB | k. A. | k. A. | 35,35500 |
| TRY | 17,45535 | 20,27706 | 16,69650 |
| TWD | 31,08488 | k. A. | 29,73350 |

| Fremd-währung | 30. Juni 2022 Präsentationswährung EUR | GBP | USD |
|---|---|---|---|
| UGX | k. A. | k. A. | 3.751,00000 |
| USD (oder $) | 1,04545 | 1,21445 | 1,00000 |
| UYU | k. A. | k. A. | 39,81500 |
| VND | k. A. | k. A. | 23.265,00000 |
| ZAR | 17,12708 | k. A. | 16,3825 |
| ZMW | k. A. | k. A. | 16,825 |

| Fremd-währung | 31. Dez. 2021 Präsentationswährung EUR | GBP | USD |
|---|---|---|---|
| AED | k. A. | k. A. | 3,67305 |
| ARS | 228,82733 | k. A. | 201,22000 |
| AUD | 1,56413 | 1,86294 | 1,37542 |
| BRL | 6,33420 | k. A. | 5,57000 |
| CAD | 1,43645 | 1,71087 | 1,26315 |
| CHF | 1,03616 | k. A. | 0,91115 |
| CLP | 968,89418 | k. A. | 852,00000 |
| CNH | 7,23151 | 8,61302 | 6,35905 |
| CNY | 7,24777 | k. A. | 6,37335 |
| COP | 4.628,40293 | k. A. | 4.070,00000 |
| CZK | 24,84997 | k. A. | 21,85190 |
| DKK | 7,43757 | 8,85844 | 6,54025 |
| DOP | k. A. | k. A. | 57,26000 |
| EGP | k. A. | k. A. | 15,71000 |
| EUR (oder €) | 1,00000 | 1,19104 | 0,87935 |
| GBP (oder £) | 0,83960 | 1,00000 | 0,73831 |
| GHS | k. A. | k. A. | 6,17500 |
| HKD | 8,86595 | k. A. | 7,79630 |
| HUF | 368,56496 | k. A. | 324,09870 |
| IDR | 16.207,93925 | k. A. | 14.252,50000 |
| ILS | 3,53942 | k. A. | 3,11240 |
| INR | 84,53448 | k. A. | 74,33565 |
| JPY (oder ¥) | 130,95424 | 155,97170 | 115,15500 |
| KRW | 1.351,84619 | k. A. | 1.188,75000 |
| KZT | k. A. | k. A. | 434,80500 |
| MXN | 23,27279 | 27,71882 | 20,46500 |
| MYR | k. A. | k. A. | 4,16600 |
| NGN | k. A. | k. A. | 413,75000 |
| NOK | 10,02817 | 11,94395 | 8,81830 |
| NZD | 1,66099 | k. A. | 1,46060 |
| PEN | 4,53828 | k. A. | 3,99075 |
| PHP | k. A. | k. A. | 50,99250 |
| PLN | 4,58337 | k. A. | 4,03040 |
| RON | k. A. | k. A. | 4,35170 |
| RSD | k. A. | k. A. | 103,39000 |
| RUB | 85,29709 | k. A. | 75,00625 |
| SEK | 10,29604 | 12,26299 | 9,05385 |
| SGD | 1,53312 | 1,82600 | 1,34815 |
| THB | k. A. | k. A. | 33,40500 |
| TRY | 15,10173 | 17,98676 | 13,27975 |
| TWD | 31,46291 | k. A. | 27,66700 |
| UAH | k. A. | k. A. | 27,28250 |
| UGX | k. A. | k. A. | 3.545,00000 |
| USD (oder $) | 1,13720 | 1,35445 | 1,00000 |
| UYU | k. A. | k. A. | 44,70000 |
| VND | k. A. | k. A. | 22.790,00000 |
| ZAR | 18,14971 | k. A. | 15,96000 |
| ZMW | k. A. | k. A. | 16,66810 |

## 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 2021 angegeben sind.

## 14. TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN FÜR DIE IN HONGKONG VERTRIEBENEN FONDS

Verbundene Personen der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageberatungsgesellschaften und/oder der Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und der Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sind jene, die im Code on Unit Trusts and Mutual Funds der Securities and Futures Commission of Hong Kong (der „SFC-Code“) definiert sind. Alle Transaktionen, die während des Geschäftsjahres zwischen den durch die SFC zugelassenen Fonds („durch die SFC zugelassene Fonds“), wie im Abschnitt zu den allgemeinen Merkmalen des Jahresberichts beschrieben, und der Verwaltungsgesellschaft, den Anlageberatungsgesellschaften und/oder den Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und den Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sowie deren jeweiligen verbundenen Personen eingegangen wurden, wurden im Rahmen der normalen Geschäftstätigkeit und zu den üblichen Geschäftsbedingungen abgeschlossen.

Folgende Transaktionen wurden in den Berichtszeiträumen zum 30. Juni 2022 und 30. Juni 2021 über einen Broker ausgeführt, bei dem es sich um eine verbundene Person der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageberatungsgesellschaften und/oder der Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und der Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft handelt:

| Fonds | 30. Juni 2022 Summe Käufe und Verkäufe ('000) | % Summe Käufe und Verkäufe | 30. Juni 2021 Summe Käufe und Verkäufe ('000) | % Summe Käufe und Verkäufe |
|---|---|---|---|---|
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund | $ 14.107.219 | 32,23 | $ 429.899 | 4,14 |
| Asia Strategic Interest Bo nd Fund | 416.002 | 20,01 | 142.892 | 9,77 |
| Commodity Real Return Fund | 1.806.911 | 5,27 | 370.838 | 2,30 |
| Diversified Income Fund | 9.713.714 | 6,03 | 6.447.302 | 2,68 |
| Emerging Local Bond Fund | 1.380.942 | 3,20 | 1.476.831 | 3,86 |
| Emerging Markets Bond Fund | 1.558.214 | 7,00 | 1.448.877 | 8,69 |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 40.078 | 5,17 | 52.453 | 3,84 |
| Global Bond Fund | 2.405.893 | 1,08 | 5.879.245 | 2,24 |
| Global High Yield Bond Fund | 791.283 | 2,95 | 1.910.927 | 5,55 |
| Global Investment Grade Credit Fund | 1.014.463 | 0,97 | 10.347.102 | 4,87 |
| Global Real Return Fund | 569.391 | 0,71 | 3.280.330 | 4,26 |
| Income Fund | 12.902.695 | 1,00 | 32.362.843 | 3,69 |
| Income Fund II | 214 | 0,07 | 2.517 | 0,47 |
| Low Average Duration Fund | 1.304.128 | 2,66 | 59.789 | 0,46 |
| Total Return Bond Fund | 1.095.290 | 1,49 | 888.078 | 1,27 |
| US High Yield Bond Fund | 705.505 | 6,87 | 370.385 | 2,57 |

Es wurde in den Berichtszeiträumen zum 30. Juni 2022 und 30. Juni 2021 keine Provision für die Transaktionen in der vorstehenden Tabelle erhoben.

Einzelheiten zu Aktien, die in dem Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022 und dem Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 durch Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft in durch die SFC zugelassenen Fonds gehalten wurden, sind Erläuterung 10 zu entnehmen. Einzelheiten zu Gebühren, die in den Berichtszeiträumen zum 30. Juni 2022 und 30. Juni 2021 an Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft gezahlt wurden, sind Erläuterung 9 zu entnehmen.

Einzelheiten zum Wert der umlaufenden Anteile, die zum 30. Juni 2022 und 31. Dezember 2021 durch verbundene Personen der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageberatungsgesellschaften und/oder der Unter-Anlageberatungsgesellschaften gehalten wurden und über 20 % des Nettovermögens von durch die SFC zugelassenen Fonds betragen, sind Erläuterung 10 zu entnehmen. Einzelheiten zu Gebühren, die an die Verwaltungsgesellschaft, die Anlageberatungsgesellschaften und/oder Unter-Anlageberatungsgesellschaften gezahlt wurden, sind Erläuterung 9 und der Betriebsergebnisrechnung zu entnehmen.

Verwaltungsratsmitglieder und leitende Angestellte der Verwahrstelle hielten in den Berichtszeiträumen zum 30. Juni 2022 und 30. Juni 2021 keine Anteile der durch die SFC zugelassenen Fonds. Wie in Erläuterung 9 angegeben, wurden die Gebühren und Aufwendungen der Verwahrstelle durch die Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr oder durch die Anlageberatungsgesellschaften gezahlt. Alle Bankguthaben der durch die SFC zugelassenen Fonds wurden entweder von State Street Bank and Trust Co. in ihrer Eigenschaft als Vertreterin der Verwahrstelle oder direkt bei einer Unterverwahrstelle gehalten. Gegebenenfalls wurden den durch die SFC zugelassenen Fonds durch die Verwahrstelle Zinsen auf diese Barsalden gezahlt oder berechnet.

## 15. GRUNDKAPITAL

### (a) Genehmigte Anteile

Das genehmigte Grundkapital der Gesellschaft beträgt 38.092 € und ist in 30.000 Zeichneranteile zu je 1,27 € und 500.000.000.000 Aktien ohne Nennwert aufgeteilt, die 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 Fonds. Rückgabe- und gewinnberechtigte Anteile werden auf Antrag des Anteilinhabers zurückgenommen und sind als Finanzverbindlichkeiten klassifiziert.

## 16. NETTOINVENTARWERTE

Im Folgenden sind das rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhabern zuzuschreibende Nettovermögen der einzelnen Teilfonds, die ausgegebenen und umlaufenden Anteile und der NIW je Anteil der vergangenen drei Jahre (Angaben in Tausend, ausgenommen Beträge je Anteil) aufgeführt. Der NIW je Anteil kann gemäß FRS 102 erforderliche Anpassungen beinhalten, wodurch der NIW oder die Gesamtrenditen der Anteilsinhaber von jenen abweichen können, die in diesem Abschluss veröffentlicht werden. Das Nettovermögen geteilt durch die Anzahl der ausgegebenen und umlaufenden Anteile kann vom NIW aufgrund gerundeter Werte abweichen:

| | Zum 30. Juni 2022 | | Zum 31. Dez. 2021 | | Zum 31. Dez. 2020 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | PIMCO Asia High Yield Bond Fund | | | | | |
| Nettovermögen | $ | 3.031.126 | $ | 3.411.923 | $ | 890.928 |
| Institutional: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 1.595.288 | $ | 1.221.240 | $ | 265.889 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 191.030 | | 117.953 | | 23.044 |
| NIW je Anteil | $ | 8,35 | $ | 10,35 | $ | 11,54 |
| Erträge | $ | 115.597 | $ | 248.734 | $ | 43.289 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 16.702 | | 28.125 | | 4.163 |
| NIW je Anteil | $ | 6,92 | $ | 8,84 | $ | 10,40 |
| Institutional AUD (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | AUD | 191.545 | AUD | 12 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 27.274 | | 1 | | k. A. |
| NIW je Anteil | AUD | 7,02 | AUD | 9,00 | | k. A. |
| Institutional CHF (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | CHF | 5.078 | CHF | 35.166 | CHF | 6.108 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 684 | | 3.797 | | 586 |
| NIW je Anteil | CHF | 7,43 | CHF | 9,26 | CHF | 10,43 |
| Erträge | CHF | 2.153 | CHF | 5.135 | CHF | 860 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 318 | | 591 | | 83 |
| NIW je Anteil | CHF | 6,76 | CHF | 8,69 | CHF | 10,32 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 422.523 | € | 653.189 | € | 38.336 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 56.693 | | 70.200 | | 3.662 |
| NIW je Anteil | € | 7,45 | € | 9,30 | € | 10,47 |
| Erträge | € | 63.148 | € | 75.650 | € | 11.559 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 9.338 | | 8.695 | | 1.120 |
| NIW je Anteil | € | 6,76 | € | 8,70 | € | 10,32 |

| | Zum 30. Juni 2022 | | Zum 31. Dez. 2021 | | Zum 31. Dez. 2020 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Forts.) | | | | | |
| Institutional GBP (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | £ | 14.157 | £ | 18.246 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.922 | | 1.996 | | k. A. |
| NIW je Anteil | £ | 7,36 | £ | 9,14 | | k. A. |
| Erträge | £ | 20.326 | £ | 59.979 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.067 | | 7.061 | | k. A. |
| NIW je Anteil | £ | 6,63 | £ | 8,50 | | k. A. |
| Institutional RMB (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | CNH | 49 | CNH | 61 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 | | k. A. |
| NIW je Anteil | CNH | 72,11 | CNH | 91,17 | | k. A. |
| Institutional SGD (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | SGD | 427 | SGD | 85 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 61 | | 9 | | k. A. |
| NIW je Anteil | SGD | 7,06 | SGD | 9,01 | | k. A. |
| Investor: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 11.296 | $ | 19.282 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.602 | | 2.201 | | k. A. |
| NIW je Anteil | $ | 7,05 | $ | 8,76 | | k. A. |
| Erträge | $ | 119.389 | $ | 273.632 | $ | 66.319 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 17.595 | | 31.566 | | 6.506 |
| NIW je Anteil | $ | 6,79 | $ | 8,67 | $ | 10,19 |
| Investor AUD (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | AUD | 3.747 | AUD | 5.081 | AUD | 366 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 548 | | 579 | | 35 |
| NIW je Anteil | AUD | 6,84 | AUD | 8,77 | AUD | 10,34 |
| Investor EUR (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | € | 981 | € | 935 | € | 226 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 148 | | 110 | | 22 |
| NIW je Anteil | € | 6,62 | € | 8,52 | € | 10,11 |
| Investor RMB (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | CNH | 16.850 | CNH | 24.873 | CNH | 8.387 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 235 | | 275 | | 81 |
| NIW je Anteil | CNH | 71,55 | CNH | 90,46 | CNH | 103,59 |
| Investor SGD (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | SGD | 5.017 | SGD | 6.528 | SGD | 1.175 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 738 | | 753 | | 115 |
| NIW je Anteil | SGD | 6,79 | SGD | 8,67 | SGD | 10,19 |
| Administrative: | | | | | | |
| Erträge | $ | 31.788 | $ | 41.320 | $ | 18.459 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 4.591 | | 4.672 | | 1.775 |
| NIW je Anteil | $ | 6,92 | $ | 8,84 | $ | 10,40 |
| Class E: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 68.087 | $ | 78.405 | $ | 6.725 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 8.840 | | 8.175 | | 624 |
| NIW je Anteil | $ | 7,70 | $ | 9,59 | $ | 10,79 |
| Erträge | $ | 64.261 | $ | 100.159 | $ | 25.374 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 9.282 | | 11.325 | | 2.440 |
| NIW je Anteil | $ | 6,92 | $ | 8,84 | $ | 10,40 |
| Class E CHF (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | CHF | 1.010 | CHF | 1.263 | CHF | 89 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 138 | | 138 | | 9 |
| NIW je Anteil | CHF | 7,32 | CHF | 9,16 | CHF | 10,41 |
| Erträge | CHF | 231 | CHF | 280 | CHF | 31 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 34 | | 32 | | 3 |
| NIW je Anteil | CHF | 6,77 | CHF | 8,69 | CHF | 10,33 |
| Class E EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 51.087 | € | 61.580 | € | 20.246 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 6.956 | | 6.687 | | 1.938 |
| NIW je Anteil | € | 7,34 | € | 9,21 | € | 10,45 |
| Erträge | € | 9.473 | € | 10.041 | € | 1.020 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.401 | | 1.154 | | 99 |
| NIW je Anteil | € | 6,76 | € | 8,70 | € | 10,32 |

| | Zum 30. Juni 2022 | | Zum 31. Dez. 2021 | | Zum 31. Dez. 2020 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Forts.) | | | | | |
| Class E HKD (Unhedged): | | | | | | |
| Erträge | HKD | 6.358 | HKD | 4.540 | HKD | 2.458 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 918 | | 516 | | 239 |
| NIW je Anteil | HKD | 6,93 | HKD | 8,79 | HKD | 10,28 |
| Class E SGD (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | SGD | 17.510 | SGD | 25.623 | SGD | 12.464 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.551 | | 2.924 | | 1.211 |
| NIW je Anteil | SGD | 6,86 | SGD | 8,76 | SGD | 10,29 |
| H Institutional: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 1.243 | $ | 182 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 172 | | 20 | | k. A. |
| NIW je Anteil | $ | 7,22 | $ | 8,96 | | k. A. |
| Erträge | $ | 523 | $ | 686 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 78 | | 80 | | k. A. |
| NIW je Anteil | $ | 6,73 | $ | 8,60 | | k. A. |
| M Retail: | | | | | | |
| ausschüttend II | $ | 17.884 | $ | 22.700 | $ | 12.308 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.722 | | 2.684 | | 1.219 |
| NIW je Anteil | $ | 6,57 | $ | 8,46 | $ | 10,10 |
| M Retail HKD (Unhedged): | | | | | | |
| ausschüttend II | HKD | 6.490 | HKD | 6.482 | HKD | 1.567 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 988 | | 771 | | 157 |
| NIW je Anteil | HKD | 6,57 | HKD | 8,41 | HKD | 9,98 |
| M Retail SGD (Hedged): | | | | | | |
| ausschüttend II | SGD | 8.667 | SGD | 11.492 | SGD | 7.080 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.331 | | 1.372 | | 708 |
| NIW je Anteil | SGD | 6,51 | SGD | 8,38 | SGD | 10,00 |
| Class Z: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 221.788 | $ | 300.885 | $ | 339.431 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 25.962 | | 28.503 | | 29.046 |
| NIW je Anteil | $ | 8,54 | $ | 10,56 | $ | 11,69 |
| | Asia Strategic Interest Bond Fund | | | | | |
| Nettovermögen | $ | 312.574 | $ | 361.011 | $ | 167.716 |
| Institutional: | | | | | | |
| Erträge | $ | 41.534 | $ | 64.997 | $ | 3.652 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 5.216 | | 6.958 | | 362 |
| NIW je Anteil | $ | 7,96 | $ | 9,34 | $ | 10,10 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | € | 106.677 | € | 102.975 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 13.557 | | 11.068 | | k. A. |
| NIW je Anteil | € | 7,87 | € | 9,30 | | k. A. |
| Institutional GBP (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | £ | 151 | £ | 174 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 19 | | 19 | | k. A. |
| NIW je Anteil | £ | 7,99 | £ | 9,41 | | k. A. |
| Institutional SGD (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | SGD | 4.567 | SGD | 5.354 | SGD | 4.213 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 566 | | 566 | | 412 |
| NIW je Anteil | SGD | 8,06 | SGD | 9,46 | SGD | 10,22 |
| Class E: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 291 | $ | 12 | $ | 10 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 35 | | 1 | | 1 |
| NIW je Anteil | $ | 8,38 | $ | 9,69 | $ | 10,19 |
| Erträge | $ | 26.471 | $ | 24.934 | $ | 23.579 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.775 | | 3.015 | | 2.605 |
| NIW je Anteil | $ | 7,01 | $ | 8,27 | $ | 9,05 |

| | Zum 30. Juni 2022 | | Zum 31. Dez. 2021 | | Zum 31. Dez. 2020 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Asia Strategic Interest Bond Fund (Forts.) | | | | | |
| Class E EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 5.295 | € | 5.060 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 648 | | 532 | | k. A. |
| NIW je Anteil | € | 8,17 | € | 9,51 | | k. A. |
| Class E EUR (Unhedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 23.616 | € | 25.443 | € | 14.254 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.680 | | 1.703 | | 976 |
| NIW je Anteil | € | 14,05 | € | 14,94 | € | 14,60 |
| Class E HKD (Unhedged): | | | | | | |
| Erträge | HKD | 2.936 | HKD | 3.401 | HKD | 79 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 364 | | 362 | | 8 |
| NIW je Anteil | HKD | 8,06 | HKD | 9,40 | HKD | 10,10 |
| Class E SGD (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | SGD | 292 | SGD | 337 | SGD | 355 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 36 | | 36 | | 35 |
| NIW je Anteil | SGD | 8,07 | SGD | 9,46 | SGD | 10,22 |
| M Retail HKD (Unhedged): | | | | | | |
| Erträge | HKD | 33.050 | HKD | 39.857 | HKD | 49.317 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 5.383 | | 5.540 | | 6.298 |
| NIW je Anteil | HKD | 6,14 | HKD | 7,19 | HKD | 7,83 |
| Class Z: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 94.266 | $ | 109.270 | $ | 113.208 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 11.110 | | 11.219 | | 11.220 |
| NIW je Anteil | $ | 8,49 | $ | 9,74 | $ | 10,09 |
| | PIMCO Capital Securities Fund | | | | | |
| Nettovermögen | $ | 5.951.061 | $ | 9.110.409 | $ | 7.958.322 |
| Institutional: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 1.537.682 | $ | 2.296.596 | $ | 1.983.832 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 81.223 | | 103.846 | | 94.295 |
| NIW je Anteil | $ | 18,93 | $ | 22,12 | $ | 21,04 |
| Erträge | $ | 473.190 | $ | 728.260 | $ | 435.050 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 48.292 | | 62.402 | | 37.992 |
| NIW je Anteil | $ | 9,80 | $ | 11,67 | $ | 11,45 |
| Institutional AUD (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | AUD | 12 | AUD | 14 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 | | k. A. |
| NIW je Anteil | AUD | 8,27 | AUD | 9,90 | | k. A. |
| Institutional BRL (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 28.328 | $ | 47.342 | $ | 8.585 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.661 | | 5.855 | | 1.079 |
| NIW je Anteil | $ | 7,74 | $ | 8,09 | $ | 7,96 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | CHF | 46.895 | CHF | 120.911 | CHF | 51.534 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.153 | | 6.908 | | 3.064 |
| NIW je Anteil | CHF | 14,87 | CHF | 17,50 | CHF | 16,82 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 1.104.287 | € | 1.868.333 | € | 1.661.782 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 82.848 | | 118.946 | | 110.286 |
| NIW je Anteil | € | 13,33 | € | 15,71 | € | 15,07 |
| Erträge | € | 385.864 | € | 481.884 | € | 487.278 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 36.925 | | 38.373 | | 39.195 |
| NIW je Anteil | € | 10,45 | € | 12,56 | € | 12,43 |
| ausschüttend II | € | 31.965 | € | 41.671 | € | 26.473 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 4.012 | | 4.334 | | 2.760 |
| NIW je Anteil | € | 7,97 | € | 9,61 | € | 9,59 |

| | Zum 30. Juni 2022 | | Zum 31. Dez. 2021 | | Zum 31. Dez. 2020 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | PIMCO Capital Securities Fund (Forts.) | | | | | |
| Institutional GBP (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | £ | 30.383 | £ | 43.301 | £ | 37.603 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.216 | | 2.696 | | 2.455 |
| NIW je Anteil | £ | 13,71 | £ | 16,06 | £ | 15,32 |
| Erträge | £ | 71.716 | £ | 106.976 | £ | 127.724 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 6.519 | | 8.135 | | 9.873 |
| NIW je Anteil | £ | 11,00 | £ | 13,15 | £ | 12,94 |
| Institutional RMB (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | CNH | 57 | CNH | 66 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 | | k. A. |
| NIW je Anteil | CNH | 85,03 | CNH | 100,31 | | k. A. |
| Institutional SGD (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | SGD | 145 | SGD | 39 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 17 | | 4 | | k. A. |
| NIW je Anteil | SGD | 8,32 | SGD | 9,91 | | k. A. |
| Investor: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 248.578 | $ | 345.234 | $ | 237.400 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 19.278 | | 22.879 | | 16.481 |
| NIW je Anteil | $ | 12,89 | $ | 15,09 | $ | 14,40 |
| Erträge | $ | 102.702 | $ | 245.968 | $ | 202.032 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 10.532 | | 21.180 | | 17.730 |
| NIW je Anteil | $ | 9,75 | $ | 11,61 | $ | 11,39 |
| Investor AUD (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | AUD | 12.812 | AUD | 26.915 | AUD | 26.186 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.422 | | 2.496 | | 2.467 |
| NIW je Anteil | AUD | 9,01 | AUD | 10,79 | AUD | 10,62 |
| Investor CAD (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | CAD | 4.008 | CAD | 4.771 | CAD | 546 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 431 | | 431 | | 50 |
| NIW je Anteil | CAD | 9,29 | CAD | 11,08 | CAD | 10,89 |
| Investor EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 24.544 | € | 49.337 | € | 37.573 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.114 | | 3.601 | | 2.848 |
| NIW je Anteil | € | 11,61 | € | 13,70 | € | 13,19 |
| Investor GBP (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | £ | 2.933 | £ | 3.470 | £ | 2.096 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 348 | | 344 | | 211 |
| NIW je Anteil | £ | 8,43 | £ | 10,08 | £ | 9,92 |
| Investor RMB (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | CNH | 31.702 | CNH | 39.482 | CNH | 37.405 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 313 | | 330 | | 327 |
| NIW je Anteil | CNH | 101,31 | CNH | 119,51 | CNH | 114,26 |
| Investor SGD (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | SGD | 5.280 | SGD | 5.321 | SGD | 4.726 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 572 | | 484 | | 438 |
| NIW je Anteil | SGD | 9,22 | SGD | 10,99 | SGD | 10,78 |
| Administrative: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 104.363 | $ | 149.168 | $ | 193.489 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 5.782 | | 7.057 | | 9.574 |
| NIW je Anteil | $ | 18,05 | $ | 21,14 | $ | 20,21 |
| Erträge | $ | 102.376 | $ | 140.861 | $ | 137.606 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 7.770 | | 8.978 | | 8.938 |
| NIW je Anteil | $ | 13,18 | $ | 15,69 | $ | 15,39 |
| Administrative EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 13.975 | € | 18.966 | € | 20.552 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 891 | | 1.024 | | 1.150 |
| NIW je Anteil | € | 15,68 | € | 18,53 | € | 17,87 |
| Class E: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 370.504 | $ | 452.418 | $ | 406.039 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 27.885 | | 29.018 | | 27.132 |
| NIW je Anteil | $ | 13,29 | $ | 15,59 | $ | 14,97 |

| | Zum 30. Juni 2022 | | Zum 31. Dez. 2021 | | Zum 31. Dez. 2020 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | PIMCO Capital Securities Fund (Forts.) | | | | | |
| Erträge | $ | 71.452 | $ | 99.264 | $ | 84.704 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 7.319 | | 8.539 | | 7.426 |
| NIW je Anteil | $ | 9,76 | $ | 11,62 | $ | 11,41 |
| Class E CHF (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | CHF | 7.937 | CHF | 11.446 | CHF | 9.397 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 771 | | 940 | | 796 |
| NIW je Anteil | CHF | 10,30 | CHF | 12,18 | CHF | 11,81 |
| Class E EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 402.670 | € | 497.935 | € | 465.125 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 34.686 | | 36.232 | | 34.965 |
| NIW je Anteil | € | 11,61 | € | 13,74 | € | 13,30 |
| Erträge | € | 58.739 | € | 73.090 | € | 62.905 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 6.825 | | 7.069 | | 6.146 |
| NIW je Anteil | € | 8,61 | € | 10,34 | € | 10,23 |
| M Retail: | | | | | | |
| ausschüttend II | $ | 244.386 | $ | 306.306 | $ | 218.504 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 27.846 | | 29.067 | | 20.788 |
| NIW je Anteil | $ | 8,78 | $ | 10,54 | $ | 10,51 |
| M Retail HKD (Unhedged): | | | | | | |
| Erträge | HKD | 2.790 | HKD | 24.499 | HKD | 23.223 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 298 | | 2.211 | | 2.148 |
| NIW je Anteil | HKD | 9,37 | HKD | 11,08 | HKD | 10,81 |
| M Retail SGD (Hedged): | | | | | | |
| ausschüttend II | SGD | 116.025 | SGD | 145.278 | SGD | 67.688 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 13.411 | | 13.981 | | 6.533 |
| NIW je Anteil | SGD | 8,65 | SGD | 10,39 | SGD | 10,36 |
| Class R: | | | | | | |
| Erträge | $ | 4.476 | $ | 6.177 | $ | 5.913 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 454 | | 526 | | 514 |
| NIW je Anteil | $ | 9,85 | $ | 11,73 | $ | 11,51 |
| Class R EUR (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | € | 4.420 | € | 12.422 | € | 9.666 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 527 | | 1.233 | | 970 |
| NIW je Anteil | € | 8,38 | € | 10,07 | € | 9,97 |
| Class R GBP (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | £ | 3.019 | £ | 5.957 | £ | 6.265 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 342 | | 564 | | 603 |
| NIW je Anteil | £ | 8,84 | £ | 10,56 | £ | 10,39 |
| Class T: | | | | | | |
| Erträge | $ | 9.083 | $ | 11.570 | $ | 10.970 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 903 | | 966 | | 933 |
| NIW je Anteil | $ | 10,06 | $ | 11,98 | $ | 11,75 |
| Class T EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 65.233 | € | 84.896 | € | 68.823 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 6.198 | | 6.800 | | 5.673 |
| NIW je Anteil | € | 10,52 | € | 12,48 | € | 12,13 |
| Class Z: | | | | | | |
| Erträge | $ | 103.322 | $ | 124.585 | $ | 71.902 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 9.588 | | 9.705 | | 5.708 |
| NIW je Anteil | $ | 10,78 | $ | 12,84 | $ | 12,60 |
| Class Z AUD (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | AUD | 103.350 | AUD | 127.724 | AUD | 125.272 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 10.871 | | 11.223 | | 11.181 |
| NIW je Anteil | AUD | 9,51 | AUD | 11,38 | AUD | 11,20 |
| | PIMCO Climate Bond Fund | | | | | |
| Nettovermögen | $ | 274.175 | $ | 328.081 | $ | 101.869 |
| Institutional: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 19.019 | $ | 21.317 | $ | 4.565 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.143 | | 2.108 | | 449 |
| NIW je Anteil | $ | 8,88 | $ | 10,11 | $ | 10,17 |

| | Zum 30. Juni 2022 | | Zum 31. Dez. 2021 | | Zum 31. Dez. 2020 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | **PIMCO Climate Bond Fund (Forts.)** | | | | | |
| Institutional CHF (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | CHF | 973 | CHF | 1.103 | CHF | 231 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 113 | | 111 | | 23 |
| NIW je Anteil | CHF | 8,63 | CHF | 9,91 | CHF | 10,06 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 45.632 | € | 80.658 | € | 16.688 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 5.251 | | 8.066 | | 1.646 |
| NIW je Anteil | € | 8,69 | € | 10,00 | € | 10,14 |
| Erträge | € | 88.270 | € | 101.819 | € | 60.190 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 10.412 | | 10.361 | | 5.992 |
| NIW je Anteil | € | 8,48 | € | 9,83 | € | 10,05 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | £ | 26.354 | £ | 28.217 | £ | 1.717 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.985 | | 2.799 | | 169 |
| NIW je Anteil | £ | 8,83 | £ | 10,08 | £ | 10,15 |
| Erträge | £ | 27.325 | £ | 715 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.155 | | 72 | | k. A. |
| NIW je Anteil | £ | 8,66 | £ | 9,97 | | k. A. |
| Institutional SEK (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | SEK | 291.580 | SEK | 292.047 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.362 | | 2.939 | | k. A. |
| NIW je Anteil | SEK | 86,72 | SEK | 99,36 | | k. A. |
| Institutional SGD (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | SGD | 5.230 | SGD | 5.453 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 591 | | 541 | | k. A. |
| NIW je Anteil | SGD | 8,85 | SGD | 10,08 | | k. A. |
| Investor: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 2.641 | $ | 3.214 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 301 | | 321 | | k. A. |
| NIW je Anteil | $ | 8,77 | $ | 10,00 | | k. A. |
| Investor EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 7 | € | 8 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 | | k. A. |
| NIW je Anteil | € | 8,62 | € | 9,92 | | k. A. |
| Administrative SEK (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | SEK | 75 | SEK | 86 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 | | k. A. |
| NIW je Anteil | SEK | 86,54 | SEK | 99,39 | | k. A. |
| Class E EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 13.471 | € | 16.979 | € | 507 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.575 | | 1.718 | | 50 |
| NIW je Anteil | € | 8,56 | € | 9,88 | € | 10,11 |
| Class Z: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 9 | $ | 10 | $ | 10 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 | | 1 |
| NIW je Anteil | $ | 8,96 | $ | 10,18 | $ | 10,18 |
| | **Commodity Real Return Fund** | | | | | |
| Nettovermögen | $ | 1.805.880 | $ | 1.444.182 | $ | 325.109 |
| Institutional: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 591.223 | $ | 587.333 | $ | 162.906 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 58.694 | | 67.481 | | 24.677 |
| NIW je Anteil | $ | 10,07 | $ | 8,70 | $ | 6,60 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 199.204 | € | 144.220 | € | 31.294 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 19.940 | | 16.678 | | 4.723 |
| NIW je Anteil | € | 9,99 | € | 8,65 | € | 6,63 |

| | Zum 30. Juni 2022 | | Zum 31. Dez. 2021 | | Zum 31. Dez. 2020 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | **Commodity Real Return Fund (Forts.)** | | | | | |
| Institutional EUR (Unhedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 97.935 | € | 48.990 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 6.888 | | 4.337 | | k. A. |
| NIW je Anteil | € | 14,22 | € | 11,29 | | k. A. |
| Institutional GBP (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | £ | 38.105 | £ | 36.172 | £ | 14.663 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.731 | | 3.012 | | 1.597 |
| NIW je Anteil | £ | 13,95 | £ | 12,01 | £ | 9,18 |
| Investor: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 70.287 | $ | 64.377 | $ | 10.609 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 8.077 | | 8.546 | | 1.851 |
| NIW je Anteil | $ | 8,70 | $ | 7,53 | $ | 5,73 |
| Class E: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 350.931 | $ | 256.747 | $ | 66.707 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 43.365 | | 36.552 | | 12.411 |
| NIW je Anteil | $ | 8,09 | $ | 7,02 | $ | 5,37 |
| Class E EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 409.089 | € | 234.570 | € | 21.703 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 53.270 | | 35.127 | | 4.204 |
| NIW je Anteil | € | 7,68 | € | 6,68 | € | 5,16 |
| Class E SGD (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | SGD | 12.284 | SGD | 352 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.032 | | 34 | | k. A. |
| NIW je Anteil | SGD | 11,91 | SGD | 10,32 | | k. A. |
| H Institutional: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 9 | | k. A. | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | k. A. | | k. A. |
| NIW je Anteil | $ | 8,84 | | k. A. | | k. A. |
| | **PIMCO Credit Opportunities Bond Fund** | | | | | |
| Nettovermögen | $ | 120.946 | $ | 139.704 | $ | 144.512 |
| Institutional: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 45.282 | $ | 47.099 | $ | 46.003 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.462 | | 3.345 | | 3.308 |
| NIW je Anteil | $ | 13,08 | $ | 14,07 | $ | 13,91 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | CHF | 20.686 | CHF | 22.488 | CHF | 22.715 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.055 | | 2.060 | | 2.084 |
| NIW je Anteil | CHF | 10,07 | CHF | 10,92 | CHF | 10,90 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 34.944 | € | 39.139 | € | 41.292 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.034 | | 3.136 | | 3.320 |
| NIW je Anteil | € | 11,52 | € | 12,48 | € | 12,44 |
| Class E: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 7.620 | $ | 9.740 | $ | 8.496 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 702 | | 831 | | 726 |
| NIW je Anteil | $ | 10,85 | $ | 11,73 | $ | 11,70 |
| Class E EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 9.473 | € | 12.026 | € | 11.273 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 989 | | 1.154 | | 1.075 |
| NIW je Anteil | € | 9,58 | € | 10,42 | € | 10,48 |
| | **Diversified Income Fund** | | | | | |
| Nettovermögen | $ | 10.070.002 | $ | 16.447.733 | $ | 18.641.861 |
| Institutional: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 858.970 | $ | 1.243.637 | $ | 1.066.263 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 37.130 | | 44.236 | | 37.907 |
| NIW je Anteil | $ | 23,13 | $ | 28,11 | $ | 28,13 |
| Erträge | $ | 414.639 | $ | 692.397 | $ | 830.361 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 32.747 | | 44.132 | | 51.315 |
| NIW je Anteil | $ | 12,66 | $ | 15,69 | $ | 16,18 |

| | Zum 30. Juni 2022 | | Zum 31. Dez. 2021 | | Zum 31. Dez. 2020 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Diversified Income Fund (Forts.) | | | | | |
| Institutional CAD (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | CAD | 464.506 | CAD | 571.190 | CAD | 423.593 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 48.327 | | 48.824 | | 36.151 |
| NIW je Anteil | CAD | 9,61 | CAD | 11,70 | CAD | 11,72 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | CHF | 15.066 | CHF | 20.277 | CHF | 19.775 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.249 | | 1.371 | | 1.322 |
| NIW je Anteil | CHF | 12,07 | CHF | 14,79 | CHF | 14,96 |
| Erträge | CHF | 7.543 | CHF | 13.028 | CHF | 19.392 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.022 | | 1.412 | | 2.014 |
| NIW je Anteil | CHF | 7,38 | CHF | 9,23 | CHF | 9,63 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 1.023.685 | € | 1.703.682 | € | 1.697.782 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 67.038 | | 90.940 | | 89.784 |
| NIW je Anteil | € | 15,27 | € | 18,73 | € | 18,91 |
| Erträge | € | 499.860 | € | 852.032 | € | 933.208 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 63.332 | | 86.306 | | 90.802 |
| NIW je Anteil | € | 7,89 | € | 9,87 | € | 10,28 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | £ | 955.702 | £ | 1.248.141 | £ | 1.623.041 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 75.943 | | 81.268 | | 105.382 |
| NIW je Anteil | £ | 12,58 | £ | 15,36 | £ | 15,40 |
| Erträge | £ | 444.554 | £ | 601.893 | £ | 1.020.119 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 75.829 | | 81.620 | | 133.743 |
| NIW je Anteil | £ | 5,86 | £ | 7,37 | £ | 7,63 |
| Institutional MXN (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | MXN | 319.284 | MXN | 299.232 | MXN | 5.392 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.555 | | 2.831 | | 53 |
| NIW je Anteil | MXN | 89,81 | MXN | 105,70 | MXN | 101,13 |
| Institutional SEK (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | SEK | 167.310 | SEK | 205.009 | SEK | 258.455 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.057 | | 1.057 | | 1.325 |
| NIW je Anteil | SEK | 158,23 | SEK | 193,88 | SEK | 195,03 |
| Institutional SGD (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | SGD | 66.663 | SGD | 79.938 | SGD | 30.850 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 8.141 | | 7.873 | | 2.946 |
| NIW je Anteil | SGD | 8,19 | SGD | 10,15 | SGD | 10,47 |
| Investor: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 55.862 | $ | 83.045 | $ | 63.761 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 4.755 | | 5.806 | | 4.440 |
| NIW je Anteil | $ | 11,75 | $ | 14,30 | $ | 14,36 |
| Erträge | $ | 51.443 | $ | 69.026 | $ | 43.507 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 6.022 | | 6.522 | | 3.986 |
| NIW je Anteil | $ | 8,54 | $ | 10,58 | $ | 10,92 |
| Investor EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 21.695 | € | 34.903 | € | 29.190 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.497 | | 1.960 | | 1.618 |
| NIW je Anteil | € | 14,49 | € | 17,81 | € | 18,04 |
| Erträge | € | 9.155 | € | 11.743 | € | 8.787 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.229 | | 1.260 | | 905 |
| NIW je Anteil | € | 7,45 | € | 9,32 | € | 9,70 |

| | Zum 30. Juni 2022 | | Zum 31. Dez. 2021 | | Zum 31. Dez. 2020 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Diversified Income Fund (Forts.) | | | | | |
| Administrative: | | | | | | |
| Erträge | $ | 107.069 | $ | 143.334 | $ | 144.682 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 11.455 | | 12.385 | | 12.123 |
| NIW je Anteil | $ | 9,35 | $ | 11,57 | $ | 11,94 |
| Administrative AUD (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | AUD | 2.791 | AUD | 3.812 | AUD | 4.404 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 338 | | 370 | | 413 |
| NIW je Anteil | AUD | 8,26 | AUD | 10,30 | AUD | 10,65 |
| Administrative EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 5.047 | € | 10.014 | € | 12.496 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 356 | | 575 | | 707 |
| NIW je Anteil | € | 14,16 | € | 17,42 | € | 17,67 |
| Administrative GBP (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | £ | 8.584 | £ | 12.610 | £ | 11.699 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 989 | | 1.168 | | 1.048 |
| NIW je Anteil | £ | 8,68 | £ | 10,80 | £ | 11,17 |
| Administrative JPY (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | ¥ | 337.747 | ¥ | 47.222 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 414 | | 47 | | k. A. |
| NIW je Anteil | ¥ | 816,00 | ¥ | 1.002,00 | | k. A. |
| Administrative SEK (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | SEK | 68 | SEK | 84 | SEK | 85 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 | | 1 |
| NIW je Anteil | SEK | 80,54 | SEK | 98,94 | SEK | 100,08 |
| Administrative SGD (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | SGD | 72.533 | SGD | 101.850 | SGD | 136.614 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 8.610 | | 9.757 | | 12.691 |
| NIW je Anteil | SGD | 8,42 | SGD | 10,44 | SGD | 10,76 |
| BM Retail: | | | | | | |
| ausschüttend II | $ | 9 | | k. A. | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | k. A. | | k. A. |
| NIW je Anteil | $ | 9,26 | | k. A. | | k. A. |
| BN Retail: | | | | | | |
| ausschüttend II | $ | 9 | | k. A. | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | k. A. | | k. A. |
| NIW je Anteil | $ | 9,26 | | k. A. | | k. A. |
| Class E: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 728.901 | $ | 1.113.069 | $ | 1.457.105 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 36.414 | | 45.554 | | 59.069 |
| NIW je Anteil | $ | 20,02 | $ | 24,43 | $ | 24,67 |
| Erträge | $ | 419.711 | $ | 630.798 | $ | 808.596 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 37.124 | | 45.041 | | 55.978 |
| NIW je Anteil | $ | 11,31 | $ | 14,01 | $ | 14,44 |
| Class E CHF (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | CHF | 7.925 | CHF | 9.701 | CHF | 7.607 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 944 | | 939 | | 721 |
| NIW je Anteil | CHF | 8,39 | CHF | 10,33 | CHF | 10,55 |
| Class E EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 1.366.772 | € | 1.880.735 | € | 1.798.793 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 101.717 | | 113.579 | | 106.656 |
| NIW je Anteil | € | 13,44 | € | 16,56 | € | 16,87 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | Diversified Income Fund (Forts.) | | |
| Erträge | € 938.253 | € 1.366.978 | € 1.638.721 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 104.303 | 121.500 | 139.927 |
| NIW je Anteil | € 9,00 | € 11,25 | € 11,71 |
| Class E SGD (Hedged): | | | |
| Erträge | SGD 23.849 | SGD 47.272 | SGD 83.189 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.923 | 4.674 | 7.977 |
| NIW je Anteil | SGD 8,16 | SGD 10,11 | SGD 10,43 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 476.485 | $ 1.501.526 | $ 1.307.826 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 27.275 | 70.674 | 61.420 |
| NIW je Anteil | $ 17,47 | $ 21,25 | $ 21,29 |
| Erträge | $ 9 | $ 26 | $ 27 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 2 | 2 |
| NIW je Anteil | $ 8,64 | $ 10,70 | $ 11,04 |
| M Retail: | | | |
| Erträge | $ 154.011 | $ 246.412 | $ 348.905 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 15.924 | 20.577 | 28.250 |
| NIW je Anteil | $ 9,67 | $ 11,98 | $ 12,35 |
| ausschüttend II | $ 210.832 | $ 311.977 | $ 452.614 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 26.928 | 31.930 | 44.209 |
| NIW je Anteil | $ 7,83 | $ 9,77 | $ 10,24 |
| M Retail AUD (Hedged): | | | |
| Erträge | AUD 52.454 | AUD 83.307 | AUD 148.786 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.840 | 7.442 | 12.851 |
| NIW je Anteil | AUD 8,98 | AUD 11,19 | AUD 11,58 |
| M Retail SGD (Hedged): | | | |
| ausschüttend II | SGD 11 | SGD 13 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | SGD 7,86 | SGD 9,82 | k. A. |
| N Retail: | | | |
| ausschüttend II | $ 9 | $ 10 | $ 10 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 8,50 | $ 10,38 | $ 10,48 |
| Class T: | | | |
| thesaurierend | $ 27.992 | $ 40.854 | $ 31.960 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.586 | 3.086 | 2.382 |
| NIW je Anteil | $ 10,82 | $ 13,24 | $ 13,42 |
| Erträge | $ 7.054 | $ 9.630 | $ 9.265 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 794 | 876 | 817 |
| NIW je Anteil | $ 8,88 | $ 11,00 | $ 11,34 |
| Class T EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 37.776 | € 53.705 | € 56.537 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.009 | 4.616 | 4.752 |
| NIW je Anteil | € 9,42 | € 11,63 | € 11,90 |
| Erträge | € 20.007 | € 28.295 | € 35.099 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.597 | 2.937 | 3.500 |
| NIW je Anteil | € 7,70 | € 9,63 | € 10,03 |
| W Class: | | | |
| thesaurierend | $ 74.648 | $ 120.525 | $ 46.301 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.709 | 11.579 | 4.453 |
| NIW je Anteil | $ 8,57 | $ 10,41 | $ 10,40 |
| Erträge | $ 53.656 | $ 137.527 | $ 36.531 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.676 | 13.806 | 3.555 |
| NIW je Anteil | $ 8,04 | $ 9,96 | $ 10,28 |
| W Class CAD (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CAD 12 | CAD 14 | CAD 14 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | CAD 8,54 | CAD 10,38 | CAD 10,39 |
| W Class CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 11.651 | CHF 13.719 | CHF 12.711 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.393 | 1.339 | 1.229 |
| NIW je Anteil | CHF 8,36 | CHF 10,24 | CHF 10,35 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | Diversified Income Fund (Forts.) | | |
| Erträge | CHF 1.130 | CHF 1.588 | CHF 10 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 144 | 162 | 1 |
| NIW je Anteil | CHF 7,84 | CHF 9,80 | CHF 10,23 |
| W Class EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 10.922 | € 15.286 | € 10.643 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.304 | 1.488 | 1.028 |
| NIW je Anteil | € 8,38 | € 10,27 | € 10,35 |
| Erträge | € 2.979 | € 6.737 | € 7.733 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 379 | 685 | 756 |
| NIW je Anteil | € 7,86 | € 9,83 | € 10,23 |
| W Class GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 2.237 | £ 2.371 | £ 420 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 263 | 229 | 40 |
| NIW je Anteil | £ 8,50 | £ 10,36 | £ 10,38 |
| Erträge | £ 2.454 | £ 3.547 | £ 767 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 308 | 358 | 75 |
| NIW je Anteil | £ 7,97 | £ 9,92 | £ 10,26 |
| W Class SGD (Hedged): | | | |
| Erträge | SGD 2.550 | SGD 4.762 | SGD 3.397 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 317 | 477 | 330 |
| NIW je Anteil | SGD 8,04 | SGD 9,97 | SGD 10,28 |
| | Diversified Income Duration Hedged Fund | | |
| Nettovermögen | $ 805.859 | $ 1.305.365 | $ 1.486.931 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 46.414 | $ 64.311 | $ 30.325 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.486 | 4.288 | 2.073 |
| NIW je Anteil | $ 13,32 | $ 15,00 | $ 14,63 |
| Erträge | $ 2.603 | $ 3.462 | $ 2.258 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 281 | 326 | 212 |
| NIW je Anteil | $ 9,27 | $ 10,63 | $ 10,65 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 100.898 | € 165.664 | € 96.172 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.458 | 12.228 | 7.219 |
| NIW je Anteil | € 11,93 | € 13,55 | € 13,32 |
| ausschüttend II | € 10.369 | € 40.816 | € 41.836 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.476 | 5.012 | 5.045 |
| NIW je Anteil | € 7,02 | € 8,14 | € 8,29 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 250.008 | £ 312.905 | £ 443.936 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 19.297 | 21.396 | 31.048 |
| NIW je Anteil | £ 12,96 | £ 14,62 | £ 14,30 |
| Erträge | £ 152.732 | £ 176.678 | £ 238.667 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 19.846 | 19.855 | 26.610 |
| NIW je Anteil | £ 7,70 | £ 8,90 | £ 8,97 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 7.640 | $ 11.010 | $ 10.807 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 687 | 878 | 880 |
| NIW je Anteil | $ 11,12 | $ 12,54 | $ 12,28 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 34.645 | $ 46.891 | $ 38.133 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.181 | 3.805 | 3.145 |
| NIW je Anteil | $ 10,89 | $ 12,32 | $ 12,13 |
| Erträge | $ 29.668 | $ 38.488 | $ 28.229 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.364 | 3.808 | 2.785 |
| NIW je Anteil | $ 8,82 | $ 10,11 | $ 10,13 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 55.458 | € 184.920 | € 185.348 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.059 | 14.788 | 14.936 |
| NIW je Anteil | € 10,96 | € 12,50 | € 12,41 |
| Erträge | € 20.546 | € 29.006 | € 39.600 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.837 | 3.466 | 4.678 |
| NIW je Anteil | € 7,24 | € 8,37 | € 8,46 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | Dynamic Bond Fund | | |
| Nettovermögen | $ 2.446.545 | $ 3.277.997 | $ 3.204.860 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 509.713 | $ 626.628 | $ 533.694 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 37.188 | 42.473 | 36.253 |
| NIW je Anteil | $ 13,71 | $ 14,75 | $ 14,72 |
| Erträge | $ 85.920 | $ 100.397 | $ 50.835 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.269 | 8.882 | 4.429 |
| NIW je Anteil | $ 10,39 | $ 11,30 | $ 11,48 |
| Institutional CAD (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CAD 13.548 | CAD 15.351 | CAD 17.931 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.329 | 1.398 | 1.635 |
| NIW je Anteil | CAD 10,20 | CAD 10,98 | CAD 10,96 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 72.252 | CHF 87.168 | CHF 71.980 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.082 | 7.873 | 6.448 |
| NIW je Anteil | CHF 10,20 | CHF 11,07 | CHF 11,16 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 277.890 | € 348.406 | € 467.029 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 22.897 | 26.481 | 35.268 |
| NIW je Anteil | € 12,14 | € 13,16 | € 13,24 |
| Erträge | € 8.997 | € 12.768 | € 10.018 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 982 | 1.272 | 974 |
| NIW je Anteil | € 9,16 | € 10,04 | € 10,29 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 826.689 | £ 887.562 | £ 827.076 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 67.467 | 67.216 | 62.634 |
| NIW je Anteil | £ 12,25 | £ 13,20 | £ 13,20 |
| Erträge | £ 105.508 | £ 253.262 | £ 242.182 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.862 | 26.086 | 24.507 |
| NIW je Anteil | £ 8,89 | £ 9,71 | £ 9,88 |
| Institutional NOK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | NOK 4.248 | NOK 131.604 | NOK 137.483 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 346 | 9.965 | 10.428 |
| NIW je Anteil | NOK 12,26 | NOK 13,21 | NOK 13,18 |
| Institutional SEK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | SEK 24.943 | SEK 502.097 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 237 | 4.761 |
| NIW je Anteil | k. A. | SEK 105,17 | SEK 105,47 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 49.149 | $ 56.790 | $ 52.628 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.234 | 4.537 | 4.199 |
| NIW je Anteil | $ 11,61 | $ 12,52 | $ 12,53 |
| Erträge | $ 2.987 | $ 3.932 | $ 2.996 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 321 | 389 | 292 |
| NIW je Anteil | $ 9,30 | $ 10,11 | $ 10,27 |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 2.169 | € 5.744 | € 3.373 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 210 | 512 | 298 |
| NIW je Anteil | € 10,34 | € 11,23 | € 11,34 |
| Administrative: | | | |
| thesaurierend | $ 25.763 | $ 29.563 | $ 31.246 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.001 | 2.128 | 2.242 |
| NIW je Anteil | $ 12,88 | $ 13,90 | $ 13,93 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | Dynamic Bond Fund (Forts.) | | |
| Administrative EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 1.268 | € 3.659 | € 4.758 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 111 | 295 | 379 |
| NIW je Anteil | € 11,41 | € 12,40 | € 12,54 |
| Administrative SEK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SEK 69.810 | SEK 81.744 | SEK 96.229 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 664 | 718 | 838 |
| NIW je Anteil | SEK 105,07 | SEK 113,88 | SEK 114,77 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 76.499 | $ 92.812 | $ 74.125 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.845 | 7.680 | 6.092 |
| NIW je Anteil | $ 11,18 | $ 12,08 | $ 12,17 |
| Erträge | $ 16.520 | $ 19.242 | $ 19.575 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.739 | 1.862 | 1.866 |
| NIW je Anteil | $ 9,50 | $ 10,33 | $ 10,49 |
| Class E CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 9.587 | CHF 10.761 | CHF 11.815 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.047 | 1.078 | 1.164 |
| NIW je Anteil | CHF 9,16 | CHF 9,98 | CHF 10,15 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 79.394 | € 138.697 | € 104.878 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.323 | 11.750 | 8.748 |
| NIW je Anteil | € 10,84 | € 11,80 | € 11,99 |
| Class E GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 3.501 | £ 3.820 | £ 3.947 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 325 | 328 | 336 |
| NIW je Anteil | £ 10,77 | £ 11,65 | £ 11,76 |
| G Retail EUR (Hedged): | | | |
| Erträge | € 7.596 | € 8.905 | € 10.799 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 921 | 992 | 1.174 |
| NIW je Anteil | € 8,25 | € 8,98 | € 9,20 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 11.333 | $ 18.571 | $ 4.868 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.102 | 1.677 | 440 |
| NIW je Anteil | $ 10,28 | $ 11,08 | $ 11,07 |
| Erträge | $ 10 | $ 11 | $ 11 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 9,34 | $ 10,16 | $ 10,32 |
| Class R: | | | |
| thesaurierend | $ 6.790 | $ 7.736 | $ 8.296 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 607 | 642 | 689 |
| NIW je Anteil | $ 11,19 | $ 12,05 | $ 12,03 |
| Class Z: | | | |
| thesaurierend | $ 8.028 | $ 9.940 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 866 | 1.001 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,27 | $ 9,93 | k. A. |
| Class Z AUD (Hedged): | | | |
| Erträge | AUD 28.769 | AUD 36.313 | AUD 34.486 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.039 | 3.513 | 3.276 |
| NIW je Anteil | AUD 9,47 | AUD 10,34 | AUD 10,53 |
| | Dynamic Multi-Asset Fund | | |
| Nettovermögen | € 6.081.728 | € 7.635.950 | € 5.128.926 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | € 2.066.296 | € 2.765.020 | € 2.129.409 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 166.029 | 198.997 | 153.874 |
| NIW je Anteil | € 12,45 | € 13,89 | € 13,84 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.) | | |
| ausschüttend II | € 172.433 | € 238.007 | € 251.480 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 14.879 | 18.212 | 18.963 |
| NIW je Anteil | € 11,59 | € 13,07 | € 13,26 |
| Institutional CHF (Hedged): thesaurierend | CHF 4.754 | CHF 5.282 | CHF 4.488 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 440 | 438 | 373 |
| NIW je Anteil | CHF 10,79 | CHF 12,06 | CHF 12,04 |
| Institutional GBP (Hedged): thesaurierend | £ 574.838 | £ 576.557 | £ 216.239 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 44.010 | 39.733 | 15.034 |
| NIW je Anteil | £ 13,06 | £ 14,51 | £ 14,38 |
| Erträge | £ 37.983 | £ 17.109 | £ 610 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.298 | 1.337 | 48 |
| NIW je Anteil | £ 11,52 | £ 12,79 | £ 12,68 |
| Institutional SGD (Hedged): thesaurierend | SGD 29.214 | SGD 27.017 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.237 | 2.702 | k. A. |
| NIW je Anteil | SGD 9,03 | SGD 10,00 | k. A. |
| Institutional USD (Hedged): thesaurierend | $ 215.857 | $ 281.670 | $ 175.228 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 15.350 | 18.087 | 11.398 |
| NIW je Anteil | $ 14,06 | $ 15,57 | $ 15,37 |
| ausschüttend II | $ 4.668 | $ 5.074 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 532 | 512 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 8,78 | $ 9,92 | k. A. |
| Investor: thesaurierend | € 11.040 | € 11.030 | € 6.410 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.134 | 1.013 | 589 |
| NIW je Anteil | € 9,73 | € 10,89 | € 10,88 |
| Investor USD (Hedged): thesaurierend | $ 9 | $ 10 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,21 | $ 10,22 | k. A. |
| BM Retail AUD (Hedged): ausschüttend II | AUD 13 | k. A. | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | AUD 9,71 | k. A. | k. A. |
| BM Retail USD (Hedged): ausschüttend II | $ 10 | k. A. | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,73 | k. A. | k. A. |
| Class E: thesaurierend | € 2.302.408 | € 2.955.626 | € 1.985.483 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 197.514 | 225.981 | 150.907 |
| NIW je Anteil | € 11,66 | € 13,08 | € 13,16 |
| Erträge | € 5.223 | € 5.627 | 1.063 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 539 | 517 | 97 |
| NIW je Anteil | € 9,69 | € 10,87 | 10,94 |
| Class E USD (Hedged): thesaurierend | $ 220.756 | $ 275.658 | $ 129.718 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 18.500 | 20.756 | 9.795 |
| NIW je Anteil | $ 11,93 | $ 13,28 | $ 13,24 |
| Erträge | $ 9 | $ 10 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,14 | $ 10,18 | k. A. |
| ausschüttend II | $ 9 | $ 10 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 8,70 | $ 9,80 | k. A. |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.) | | |
| H Institutional USD (Hedged): thesaurierend | $ 9.535 | $ 8.850 | $ 70.265 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 967 | 810 | 6.498 |
| NIW je Anteil | $ 9,86 | $ 10,93 | $ 10,81 |
| M Retail AUD (Hedged): ausschüttend II | AUD 372 | AUD 563 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 43 | 57 | k. A. |
| NIW je Anteil | AUD 8,63 | AUD 9,87 | k. A. |
| M Retail SGD (Hedged): ausschüttend II | SGD 14.306 | SGD 16.539 | SGD 346 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.633 | 1.673 | 34 |
| NIW je Anteil | SGD 8,76 | SGD 9,89 | SGD 10,16 |
| M Retail USD (Hedged): ausschüttend II | $ 93.919 | $ 120.842 | $ 84.157 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.775 | 11.077 | 7.457 |
| NIW je Anteil | $ 9,61 | $ 10,91 | $ 11,29 |
| Class T: thesaurierend | € 92.022 | € 118.172 | € 56.375 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.536 | 9.750 | 4.605 |
| NIW je Anteil | € 10,78 | € 12,12 | € 12,24 |
| Class T USD (Hedged): thesaurierend | $ 1.817 | $ 618 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 206 | 63 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 8,82 | $ 9,83 | k. A. |
| Class Z: thesaurierend | € 162.679 | € 192.397 | € 76.639 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 14.574 | 15.504 | 6.254 |
| NIW je Anteil | € 11,16 | € 12,41 | € 12,25 |
| | Emerging Local Bond Fund | | |
| Nettovermögen | $ 1.852.883 | $ 2.151.129 | $ 2.849.284 |
| Institutional: thesaurierend | $ 1.280.827 | $ 1.416.960 | $ 1.942.594 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 108.384 | 104.910 | 132.226 |
| NIW je Anteil | $ 11,82 | $ 13,51 | $ 14,69 |
| Erträge | $ 65.805 | $ 77.715 | $ 94.610 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.248 | 11.365 | 12.100 |
| NIW je Anteil | $ 5,85 | $ 6,84 | $ 7,82 |
| Institutional CHF (Unhedged): thesaurierend | k. A. | CHF 397 | CHF 491 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 44 | 51 |
| NIW je Anteil | k. A. | CHF 9,06 | CHF 9,56 |
| Institutional EUR (Unhedged): thesaurierend | € 198.579 | € 250.076 | € 165.027 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 15.928 | 19.088 | 12.458 |
| NIW je Anteil | € 12,47 | € 13,10 | € 13,25 |
| Erträge | € 118.033 | € 123.817 | € 288.525 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 18.302 | 17.869 | 39.179 |
| NIW je Anteil | € 6,45 | € 6,93 | € 7,36 |
| Institutional GBP (Unhedged): thesaurierend | £ 1.337 | £ 2.364 | £ 2.910 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 70 | 120 | 137 |
| NIW je Anteil | £ 19,22 | £ 19,70 | £ 21,23 |
| Investor: thesaurierend | $ 18.401 | $ 38.617 | $ 24.099 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.061 | 3.779 | 2.159 |
| NIW je Anteil | $ 8,93 | $ 10,22 | $ 11,16 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | **Emerging Local Bond Fund (Forts.)** | | |
| Investor EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 3.100 | € 3.081 | € 3.074 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 350 | 330 | 325 |
| NIW je Anteil | € 8,87 | € 9,33 | € 9,47 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 30.740 | $ 39.398 | $ 53.089 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.975 | 3.319 | 4.070 |
| NIW je Anteil | $ 10,33 | $ 11,87 | $ 13,04 |
| Erträge | $ 12.517 | $ 15.964 | $ 22.053 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.284 | 2.492 | 3.012 |
| NIW je Anteil | $ 5,48 | $ 6,41 | $ 7,32 |
| Class E EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 68.307 | € 77.057 | € 102.405 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.017 | 5.359 | 6.974 |
| NIW je Anteil | € 13,62 | € 14,38 | € 14,68 |
| Erträge | € 1.653 | € 1.782 | € 2.018 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 189 | 189 | 202 |
| NIW je Anteil | € 8,76 | € 9,41 | € 10,00 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 8 | $ 10 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 8,33 | $ 9,52 | k. A. |
| Class Z: | | | |
| Erträge | $ 35.576 | $ 40.482 | $ 21.833 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.076 | 4.941 | 2.331 |
| NIW je Anteil | $ 7,01 | $ 8,19 | $ 9,37 |
| | **Emerging Markets Bond Fund** | | |
| Nettovermögen | $ 3.214.137 | $ 4.714.744 | $ 5.263.015 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 1.101.586 | $ 1.578.727 | $ 1.855.635 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 24.903 | 28.997 | 33.297 |
| NIW je Anteil | $ 44,24 | $ 54,45 | $ 55,73 |
| Erträge | $ 70.954 | $ 92.620 | $ 79.496 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.794 | 4.961 | 3.984 |
| NIW je Anteil | $ 14,80 | $ 18,67 | $ 19,95 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| Erträge | CHF 78.175 | CHF 97.681 | CHF 101.703 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.307 | 5.215 | 5.020 |
| NIW je Anteil | CHF 14,73 | CHF 18,73 | CHF 20,26 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 501.810 | € 695.028 | € 727.017 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 14.265 | 15.897 | 16.095 |
| NIW je Anteil | € 35,18 | € 43,72 | € 45,17 |
| Erträge | € 609.076 | € 847.991 | € 768.610 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 87.602 | 95.747 | 80.394 |
| NIW je Anteil | € 6,95 | € 8,86 | € 9,56 |
| Institutional EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 157.355 | € 164.246 | € 156.149 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 13.990 | 12.905 | 12.896 |
| NIW je Anteil | € 11,25 | € 12,73 | € 12,11 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 23.854 | £ 26.418 | £ 13.006 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.029 | 922 | 442 |
| NIW je Anteil | £ 23,18 | £ 28,67 | £ 29,43 |
| Erträge | £ 30.213 | £ 41.458 | £ 67.185 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.553 | 9.258 | 13.988 |
| NIW je Anteil | £ 3,53 | £ 4,48 | £ 4,80 |
| Institutional PLN (Hedged): | | | |
| Erträge | k. A. | PLN 95.531 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 9.927 | k. A. |
| NIW je Anteil | k. A. | PLN 9,62 | k. A. |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | **Emerging Markets Bond Fund (Forts.)** | | |
| Institutional SGD (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SGD 29.855 | SGD 32.296 | SGD 16.392 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.078 | 2.703 | 1.340 |
| NIW je Anteil | SGD 9,70 | SGD 11,95 | SGD 12,23 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 4.293 | $ 7.210 | $ 7.681 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 104 | 142 | 147 |
| NIW je Anteil | $ 41,23 | $ 50,84 | $ 52,22 |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 3.235 | € 4.103 | € 4.086 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 398 | 406 | 390 |
| NIW je Anteil | € 8,12 | € 10,11 | € 10,48 |
| Administrative: | | | |
| thesaurierend | $ 28.567 | $ 34.503 | $ 34.306 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 708 | 693 | 670 |
| NIW je Anteil | $ 40,33 | $ 49,77 | $ 51,20 |
| BM Retail: | | | |
| ausschüttend II | $ 9 | k. A. | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,23 | k. A. | k. A. |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 116.507 | $ 165.453 | $ 185.616 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.040 | 3.492 | 3.793 |
| NIW je Anteil | $ 38,32 | $ 47,38 | $ 48,93 |
| Erträge | $ 66.836 | $ 109.051 | $ 151.156 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.490 | 9.691 | 12.574 |
| NIW je Anteil | $ 8,92 | $ 11,25 | $ 12,02 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 135.888 | € 187.716 | € 195.834 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.467 | 4.943 | 4.947 |
| NIW je Anteil | € 30,42 | € 37,98 | € 39,59 |
| Class E SGD (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SGD 8.061 | SGD 11.604 | SGD 12.729 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 148 | 172 | 183 |
| NIW je Anteil | SGD 54,47 | SGD 67,40 | SGD 69,62 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 161.563 | $ 284.247 | $ 401.692 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.745 | 5.348 | 7.371 |
| NIW je Anteil | $ 43,15 | $ 53,15 | $ 54,50 |
| Erträge | $ 218 | $ 275 | $ 10 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 29 | 29 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 7,59 | $ 9,57 | $ 10,22 |
| M Retail: | | | |
| Erträge | $ 9.012 | $ 12.295 | $ 14.913 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.121 | 1.214 | 1.379 |
| NIW je Anteil | $ 8,04 | $ 10,13 | $ 10,82 |
| ausschüttend II | $ 2.431 | $ 3.720 | $ 6.538 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 356 | 428 | 693 |
| NIW je Anteil | $ 6,83 | $ 8,68 | $ 9,44 |
| M Retail AUD (Hedged): | | | |
| Erträge | AUD 1.625 | AUD 7.264 | AUD 9.306 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 223 | 784 | 936 |
| NIW je Anteil | AUD 7,30 | AUD 9,27 | AUD 9,94 |
| Class Z: | | | |
| Erträge | $ 5.152 | $ 6.317 | $ 6.442 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 524 | 509 | 486 |
| NIW je Anteil | $ 9,84 | $ 12,41 | $ 13,26 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | Emerging Markets Bond ESG Fund | | |
| Nettovermögen | $ 2.208.847 | $ 2.635.769 | $ 1.441.457 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 470.944 | $ 650.604 | $ 482.367 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 33.659 | 37.005 | 26.644 |
| NIW je Anteil | $ 13,99 | $ 17,58 | $ 18,10 |
| Erträge | $ 309.605 | $ 305.572 | $ 18.961 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 40.573 | 31.166 | 1.806 |
| NIW je Anteil | $ 7,63 | $ 9,80 | $ 10,50 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 41.170 | CHF 50.716 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.214 | 5.067 | k. A. |
| NIW je Anteil | CHF 7,90 | CHF 10,01 | k. A. |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 942.590 | € 999.329 | € 566.203 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 96.491 | 80.567 | 43.901 |
| NIW je Anteil | € 9,77 | € 12,40 | € 12,90 |
| Erträge | € 156.343 | € 192.797 | € 111.597 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 22.894 | 21.737 | 11.631 |
| NIW je Anteil | € 6,83 | € 8,87 | € 9,59 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 128.285 | £ 80.974 | £ 3.499 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 17.356 | 8.479 | 341 |
| NIW je Anteil | £ 7,39 | £ 9,55 | £ 10,26 |
| Institutional GBP (Unhedged): | | | |
| Erträge | £ 4.004 | £ 3.657 | £ 7 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 502 | 398 | 1 |
| NIW je Anteil | £ 7,98 | £ 9,19 | £ 9,76 |
| Investor NOK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | NOK 5.224 | NOK 6.610 | NOK 7.902 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 50 | 50 | 58 |
| NIW je Anteil | NOK 104,00 | NOK 131,59 | NOK 136,26 |
| Investor SEK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SEK 21.421 | SEK 10.725 | SEK 12.623 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 225 | 89 | 100 |
| NIW je Anteil | SEK 95,25 | SEK 121,06 | SEK 125,92 |
| Administrative: | | | |
| thesaurierend | $ 502 | $ 632 | $ 1.121 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 59 | 59 | 102 |
| NIW je Anteil | $ 8,47 | $ 10,67 | $ 11,04 |
| Erträge | $ 729 | $ 992 | $ 293 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 95 | 101 | 28 |
| NIW je Anteil | $ 7,64 | $ 9,81 | $ 10,50 |
| Administrative SEK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SEK 67 | SEK 85 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | SEK 77,86 | SEK 99,05 | k. A. |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 1.208 | $ 1.531 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 158 | 158 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 7,67 | $ 9,68 | k. A. |
| Erträge | $ 749 | $ 868 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 102 | 92 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 7,33 | $ 9,41 | k. A. |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 66.904 | € 129.837 | € 83.479 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.816 | 11.895 | 7.294 |
| NIW je Anteil | € 8,56 | € 10,92 | € 11,45 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | Emerging Markets Corporate Bond Fund | | |
| Nettovermögen | $ 154.972 | $ 212.894 | $ 261.236 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 10.064 | $ 9.507 | $ 20.306 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 679 | 532 | 1.128 |
| NIW je Anteil | $ 14,82 | $ 17,88 | $ 18,01 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 89.093 | € 113.058 | € 126.871 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.087 | 7.392 | 8.166 |
| NIW je Anteil | € 12,57 | € 15,29 | € 15,54 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 16.093 | $ 22.756 | $ 22.272 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.430 | 1.668 | 1.607 |
| NIW je Anteil | $ 11,25 | $ 13,64 | $ 13,86 |
| Class E CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 10.265 | CHF 14.255 | CHF 16.710 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.086 | 1.235 | 1.410 |
| NIW je Anteil | CHF 9,46 | CHF 11,54 | CHF 11,85 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 23.866 | € 32.022 | € 36.387 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.154 | 2.365 | 2.622 |
| NIW je Anteil | € 11,08 | € 13,54 | € 13,88 |
| | PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | | |
| Nettovermögen | $ 269.042 | $ 290.475 | $ 220.309 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 16.838 | $ 48.615 | $ 13.910 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.702 | 4.383 | 1.214 |
| NIW je Anteil | $ 9,89 | $ 11,09 | $ 11,47 |
| Institutional EUR (Partially Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 189.420 | € 212.680 | € 168.688 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 19.506 | 19.839 | 15.309 |
| NIW je Anteil | € 9,71 | € 10,72 | € 11,02 |
| Institutional GBP (Partially Hedged): | | | |
| Erträge | £ 715 | k. A. | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 77 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | £ 9,27 | k. A. | k. A. |
| Class E EUR (Partially Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 9 | k. A. | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,37 | k. A. | k. A. |
| Class Z: | | | |
| thesaurierend | $ 53.298 | k. A. | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.524 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,65 | k. A. | k. A. |
| | Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | | |
| Nettovermögen | $ 25.629 | $ 29.760 | $ 32.571 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | k. A. | $ 114 | $ 139 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 8 | 10 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 14,02 | $ 14,44 |
| Institutional EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 9.358 | € 10.250 | € 7.119 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 672 | 743 | 538 |
| NIW je Anteil | € 13,93 | € 13,80 | € 13,21 |

| | Zum 30. Juni 2022 | | Zum 31. Dez. 2021 | | Zum 31. Dez. 2020 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.) | | | | | |
| Class E: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 4.419 | $ | 5.195 | $ | 6.144 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 383 | | 417 | | 474 |
| NIW je Anteil | $ | 11,53 | $ | 12,47 | $ | 12,97 |
| Class E EUR (Unhedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 10.930 | € | 11.252 | € | 14.366 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 823 | | 852 | | 1.126 |
| NIW je Anteil | € | 13,28 | € | 13,20 | € | 12,76 |
| | PIMCO ESG Income Fund | | | | | |
| Nettovermögen | $ | 151.140 | $ | 125.087 | | k. A. |
| Institutional: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 14.513 | $ | 5.465 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.555 | | 541 | | k. A. |
| NIW je Anteil | $ | 9,33 | $ | 10,10 | | k. A. |
| Erträge | $ | 3.471 | $ | 3.756 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 379 | | 375 | | k. A. |
| NIW je Anteil | $ | 9,15 | $ | 10,02 | | k. A. |
| Institutional AUD (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | AUD | 26.112 | AUD | 14 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.870 | | 1 | | k. A. |
| NIW je Anteil | AUD | 9,10 | AUD | 10,00 | | k. A. |
| Institutional CHF (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | CHF | 626 | CHF | 692 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 68 | | 69 | | k. A. |
| NIW je Anteil | CHF | 9,20 | CHF | 10,02 | | k. A. |
| Institutional EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 73.523 | € | 72.025 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 7.983 | | 7.175 | | k. A. |
| NIW je Anteil | € | 9,21 | € | 10,04 | | k. A. |
| Erträge | € | 390 | € | 223 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 43 | | 22 | | k. A. |
| NIW je Anteil | € | 9,02 | € | 9,95 | | k. A. |
| Institutional GBP (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | £ | 413 | £ | 482 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 45 | | 48 | | k. A. |
| NIW je Anteil | £ | 9,10 | £ | 9,98 | | k. A. |
| Institutional SEK (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | SEK | 120.160 | SEK | 77.208 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.308 | | 772 | | k. A. |
| NIW je Anteil | SEK | 91,86 | SEK | 99,96 | | k. A. |
| Institutional SGD (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | SGD | 349 | SGD | 366 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 38 | | 36 | | k. A. |
| NIW je Anteil | SGD | 9,15 | SGD | 10,02 | | k. A. |
| Administrative SEK (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | SEK | 92 | | k. A. | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | k. A. | | k. A. |
| NIW je Anteil | SEK | 97,59 | | k. A. | | k. A. |
| Class E: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 1.017 | $ | 285 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 110 | | 28 | | k. A. |
| NIW je Anteil | $ | 9,23 | $ | 10,04 | | k. A. |
| Erträge | $ | 80 | $ | 20 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 9 | | 2 | | k. A. |
| NIW je Anteil | $ | 9,15 | $ | 10,01 | | k. A. |
| Class E CHF (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | CHF | 9 | CHF | 9 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 | | k. A. |
| NIW je Anteil | CHF | 9,02 | CHF | 9,94 | | k. A. |
| Class E EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 2.636 | € | 1.113 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 290 | | 112 | | k. A. |
| NIW je Anteil | € | 9,08 | € | 9,94 | | k. A. |

| | Zum 30. Juni 2022 | | Zum 31. Dez. 2021 | | Zum 31. Dez. 2020 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | PIMCO ESG Income Fund (Forts.) | | | | | |
| Erträge | € | 560 | € | 256 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 62 | | 26 | | k. A. |
| NIW je Anteil | € | 9,03 | € | 9,96 | | k. A. |
| Class R AUD (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | AUD | 29.578 | AUD | 29.726 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.252 | | 2.973 | | k. A. |
| NIW je Anteil | AUD | 9,10 | AUD | 10,00 | | k. A. |
| | Euro Bond Fund | | | | | |
| Nettovermögen | € | 2.055.403 | € | 2.574.129 | € | 3.243.455 |
| Institutional: | | | | | | |
| thesaurierend | € | 1.489.195 | € | 1.926.406 | € | 2.235.581 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 65.056 | | 73.731 | | 82.583 |
| NIW je Anteil | € | 22,89 | € | 26,13 | € | 27,07 |
| Erträge | € | 76.230 | € | 92.872 | € | 378.659 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 5.157 | | 5.474 | | 21.418 |
| NIW je Anteil | € | 14,78 | € | 16,97 | € | 17,68 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | CHF | 331.311 | CHF | 351.467 | CHF | 307.434 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 10.539 | | 9.789 | | 8.243 |
| NIW je Anteil | CHF | 31,44 | CHF | 35,91 | CHF | 37,30 |
| Investor: | | | | | | |
| thesaurierend | € | 18.107 | € | 23.320 | € | 38.680 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 848 | | 956 | | 1.524 |
| NIW je Anteil | € | 21,34 | € | 24,41 | € | 25,38 |
| Erträge | | k. A. | € | 236 | € | 679 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | k. A. | | 15 | | 40 |
| NIW je Anteil | | k. A. | € | 16,28 | € | 16,97 |
| Administrative: | | | | | | |
| thesaurierend | € | 1.900 | € | 2.579 | € | 5.248 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 93 | | 110 | | 215 |
| NIW je Anteil | € | 20,52 | € | 23,48 | € | 24,45 |
| Class E: | | | | | | |
| thesaurierend | € | 111.412 | € | 151.006 | € | 241.554 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 5.639 | | 6.666 | | 10.200 |
| NIW je Anteil | € | 19,76 | € | 22,65 | € | 23,68 |
| Erträge | € | 27.534 | € | 38.508 | € | 58.802 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.582 | | 3.146 | | 4.596 |
| NIW je Anteil | € | 10,66 | € | 12,24 | € | 12,79 |
| | Euro Credit Fund | | | | | |
| Nettovermögen | € | 804.148 | € | 1.017.163 | € | 1.150.058 |
| Institutional: | | | | | | |
| thesaurierend | € | 577.023 | € | 743.335 | € | 854.429 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 39.230 | | 43.513 | | 49.448 |
| NIW je Anteil | € | 14,71 | € | 17,08 | € | 17,28 |
| ausschüttend II | € | 78.350 | € | 80.562 | € | 110.981 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 8.323 | | 7.303 | | 9.831 |
| NIW je Anteil | € | 9,41 | € | 11,03 | € | 11,29 |
| Class E: | | | | | | |
| thesaurierend | € | 12.231 | € | 18.325 | € | 24.907 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.054 | | 1.353 | | 1.802 |
| NIW je Anteil | € | 11,61 | € | 13,54 | € | 13,82 |
| H Institutional: | | | | | | |
| thesaurierend | € | 135.169 | € | 173.091 | € | 156.377 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 15.250 | | 16.823 | | 15.036 |
| NIW je Anteil | € | 8,86 | € | 10,29 | € | 10,40 |
| ausschüttend II | € | 1.375 | € | 1.850 | € | 3.364 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 162 | | 186 | | 331 |
| NIW je Anteil | € | 8,49 | € | 9,93 | € | 10,16 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | **Euro Income Bond Fund** | | |
| Nettovermögen | € 1.610.407 | € 2.482.304 | € 3.182.867 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | € 396.212 | € 895.043 | € 882.179 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 28.825 | 56.691 | 55.950 |
| NIW je Anteil | € 13,74 | € 15,79 | € 15,77 |
| Erträge | € 161.126 | € 128.548 | € 215.485 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 17.222 | 11.833 | 19.471 |
| NIW je Anteil | € 9,36 | € 10,86 | € 11,07 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | € 10.558 | € 14.129 | € 6.268 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.194 | 1.388 | 615 |
| NIW je Anteil | € 8,85 | € 10,18 | € 10,20 |
| Erträge | € 9.143 | € 10.907 | € 19.825 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.002 | 1.027 | 1.826 |
| NIW je Anteil | € 9,13 | € 10,62 | € 10,86 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | € 620.254 | € 856.874 | € 1.263.972 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 49.971 | 59.839 | 87.596 |
| NIW je Anteil | € 12,41 | € 14,32 | € 14,43 |
| Erträge | € 376.252 | € 527.452 | € 731.652 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 44.835 | 53.871 | 72.655 |
| NIW je Anteil | € 8,39 | € 9,79 | € 10,07 |
| Ausschüttend Q | € 2.898 | € 3.868 | € 4.485 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 356 | 406 | 455 |
| NIW je Anteil | € 8,14 | € 9,53 | € 9,86 |
| Class T: | | | |
| thesaurierend | € 24.622 | € 32.571 | € 41.015 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.572 | 2.943 | 3.663 |
| NIW je Anteil | € 9,57 | € 11,07 | € 11,20 |
| Erträge | € 9.342 | € 12.914 | € 17.986 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.253 | 1.482 | 1.998 |
| NIW je Anteil | € 7,45 | € 8,72 | € 9,00 |
| | **Euro Long Average Duration Fund** | | |
| Nettovermögen | € 115.211 | € 160.601 | € 182.461 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | € 115.211 | € 160.601 | € 182.461 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.299 | 5.426 | 5.656 |
| NIW je Anteil | € 21,74 | € 29,60 | € 32,26 |
| | **Euro Short-Term Fund** | | |
| Nettovermögen | € 507.259 | € 629.859 | € 807.538 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | € 493.274 | € 616.693 | € 789.499 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 42.001 | 51.558 | 65.792 |
| NIW je Anteil | € 11,74 | € 11,96 | € 12,00 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | € 13.985 | € 13.166 | € 18.039 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.345 | 1.239 | 1.679 |
| NIW je Anteil | € 10,40 | € 10,63 | € 10,74 |
| | **PIMCO European High Yield Bond Fund** | | |
| Nettovermögen | € 143.985 | € 170.489 | € 162.061 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | € 8.449 | € 12.500 | € 9.610 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 916 | 1.159 | 918 |
| NIW je Anteil | € 9,23 | € 10,79 | € 10,46 |
| Class Z: | | | |
| thesaurierend | € 135.536 | € 157.989 | € 152.451 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 14.500 | 14.501 | 14.501 |
| NIW je Anteil | € 9,35 | € 10,90 | € 10,51 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | **PIMCO European Short-Term Opportunities Fund** | | |
| Nettovermögen | € 273.678 | € 395.491 | € 350.749 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | € 172.905 | € 254.925 | € 259.542 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 15.768 | 22.466 | 22.487 |
| NIW je Anteil | € 10,97 | € 11,35 | € 11,54 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | € 7.400 | € 4.368 | € 6.217 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 786 | 447 | 623 |
| NIW je Anteil | € 9,42 | € 9,77 | € 9,99 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | € 93.373 | € 136.198 | € 84.990 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.803 | 13.806 | 8.456 |
| NIW je Anteil | € 9,53 | € 9,87 | € 10,05 |
| | **Global Advantage Fund** | | |
| Nettovermögen | $ 435.611 | $ 521.067 | $ 524.284 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 21.995 | $ 24.968 | $ 32.718 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.648 | 1.630 | 2.070 |
| NIW je Anteil | $ 13,35 | $ 15,32 | $ 15,81 |
| Institutional CHF (Partially Hedged): Erträge | CHF 119.231 | CHF 132.681 | CHF 136.133 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 12.823 | 12.823 | 12.809 |
| NIW je Anteil | CHF 9,30 | CHF 10,35 | CHF 10,63 |
| Institutional EUR (Partially Hedged): thesaurierend | € 212.947 | € 237.602 | € 215.680 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 16.211 | 16.656 | 15.249 |
| NIW je Anteil | € 13,14 | € 14,26 | € 14,14 |
| Institutional GBP (Partially Hedged): thesaurierend | £ 170 | £ 182 | £ 162 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 14 | 14 | 12 |
| NIW je Anteil | £ 12,49 | £ 13,42 | £ 13,45 |
| Institutional NOK (Partially Hedged): thesaurierend | NOK 583.693 | NOK 625.501 | NOK 526.754 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.096 | 4.093 | 3.462 |
| NIW je Anteil | NOK 142,49 | NOK 152,81 | NOK 152,16 |
| Class E EUR (Partially Hedged): thesaurierend | € 6.850 | € 8.002 | € 9.744 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 587 | 629 | 764 |
| NIW je Anteil | € 11,66 | € 12,73 | € 12,75 |
| | **Global Bond Fund** | | |
| Nettovermögen | $ 11.325.747 | $ 14.038.846 | $ 16.302.309 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 3.348.554 | $ 3.999.850 | $ 4.781.849 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 103.689 | 111.904 | 131.859 |
| NIW je Anteil | $ 32,29 | $ 35,74 | $ 36,26 |
| Erträge | $ 171.859 | $ 203.191 | $ 241.431 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.574 | 10.136 | 11.685 |
| NIW je Anteil | $ 17,95 | $ 20,05 | $ 20,66 |

| | Zum 30. Juni 2022 | | Zum 31. Dez. 2021 | | Zum 31. Dez. 2020 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Global Bond Fund (Forts.) | | | | | |
| Institutional (Currency Exposure): | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 347.943 | $ | 328.710 | $ | 413.925 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 11.763 | | 9.512 | | 11.412 |
| NIW je Anteil | $ | 29,58 | $ | 34,56 | $ | 36,27 |
| Erträge | $ | 21.067 | $ | 26.341 | $ | 44.078 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.110 | | 1.178 | | 1.848 |
| NIW je Anteil | $ | 18,97 | $ | 22,37 | $ | 23,86 |
| Institutional CAD (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | CAD | 61.893 | CAD | 72.089 | CAD | 83.688 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 5.999 | | 6.309 | | 7.213 |
| NIW je Anteil | CAD | 10,32 | CAD | 11,43 | CAD | 11,60 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | CHF | 484.420 | CHF | 552.547 | CHF | 464.413 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 15.569 | | 15.928 | | 13.054 |
| NIW je Anteil | CHF | 31,12 | CHF | 34,69 | CHF | 35,58 |
| Erträge | CHF | 185.865 | CHF | 218.701 | CHF | 213.078 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 10.177 | | 10.645 | | 9.953 |
| NIW je Anteil | CHF | 18,26 | CHF | 20,54 | CHF | 21,41 |
| Institutional EUR (Currency Exposure): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 108.798 | € | 139.337 | € | 163.042 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 8.127 | | 9.692 | | 11.624 |
| NIW je Anteil | € | 13,39 | € | 14,38 | € | 14,03 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 1.976.451 | € | 2.453.258 | € | 2.491.097 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 75.861 | | 84.453 | | 83.802 |
| NIW je Anteil | € | 26,05 | € | 29,05 | € | 29,73 |
| Erträge | € | 539.041 | € | 628.774 | € | 766.678 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 32.582 | | 33.781 | | 39.612 |
| NIW je Anteil | € | 16,54 | € | 18,61 | € | 19,35 |
| Institutional GBP (Currency Exposure): | | | | | | |
| thesaurierend | £ | 3.311 | £ | 3.600 | £ | 4.429 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 307 | | 319 | | 377 |
| NIW je Anteil | £ | 10,79 | £ | 11,30 | £ | 11,75 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | £ | 166.903 | £ | 198.000 | £ | 160.075 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 7.878 | | 8.429 | | 6.703 |
| NIW je Anteil | £ | 21,19 | £ | 23,49 | £ | 23,88 |
| Erträge | £ | 156.137 | £ | 191.729 | £ | 254.507 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 12.426 | | 13.574 | | 17.444 |
| NIW je Anteil | £ | 12,57 | £ | 14,13 | £ | 14,59 |
| Institutional ILS (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | | k. A. | ILS | 304 | ILS | 331 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | k. A. | | 18 | | 19 |
| NIW je Anteil | | k. A. | ILS | 16,75 | ILS | 17,09 |
| Institutional NOK (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | NOK | 3.412.512 | NOK | 4.130.842 | NOK | 3.542.383 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 16.196 | | 17.688 | | 14.946 |
| NIW je Anteil | NOK | 210,70 | NOK | 233,55 | NOK | 237,01 |
| Institutional NZD (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | NZD | 181.609 | NZD | 309.397 | NZD | 250.817 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 4.356 | | 6.643 | | 5.230 |
| NIW je Anteil | NZD | 41,69 | NZD | 46,57 | NZD | 47,96 |
| Institutional SEK (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | SEK | 984.271 | SEK | 1.219.998 | SEK | 1.176.107 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 4.872 | | 5.426 | | 5.129 |
| NIW je Anteil | SEK | 202,04 | SEK | 224,86 | SEK | 229,29 |

| | Zum 30. Juni 2022 | | Zum 31. Dez. 2021 | | Zum 31. Dez. 2020 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Global Bond Fund (Forts.) | | | | | |
| Institutional SGD (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | SGD | 164.297 | SGD | 174.944 | SGD | 176.007 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 9.385 | | 9.030 | | 8.960 |
| NIW je Anteil | SGD | 17,51 | SGD | 19,37 | SGD | 19,64 |
| Investor: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 107.887 | $ | 135.136 | $ | 195.058 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.622 | | 4.092 | | 5.801 |
| NIW je Anteil | $ | 29,78 | $ | 33,02 | $ | 33,62 |
| Erträge | $ | 5.985 | $ | 7.773 | $ | 9.885 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 397 | | 462 | | 570 |
| NIW je Anteil | $ | 15,08 | $ | 16,84 | $ | 17,35 |
| Investor (Currency Exposure): | | | | | | |
| thesaurierend | | k. A. | $ | 2.315 | $ | 5.415 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | k. A. | | 71 | | 158 |
| NIW je Anteil | | k. A. | $ | 32,58 | $ | 34,32 |
| Investor CHF (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | CHF | 158.950 | CHF | 188.770 | CHF | 283.165 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 13.255 | | 14.095 | | 20.545 |
| NIW je Anteil | CHF | 11,99 | CHF | 13,39 | CHF | 13,78 |
| Investor EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 76.865 | € | 92.541 | € | 83.112 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.138 | | 3.382 | | 2.958 |
| NIW je Anteil | € | 24,50 | € | 27,36 | € | 28,10 |
| Investor GBP (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | £ | 5.198 | £ | 5.846 | £ | 6.089 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 260 | | 264 | | 269 |
| NIW je Anteil | £ | 19,96 | £ | 22,17 | £ | 22,62 |
| Investor NOK (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | NOK | 22.447 | NOK | 28.765 | NOK | 32.011 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 113 | | 130 | | 142 |
| NIW je Anteil | NOK | 199,18 | NOK | 221,16 | NOK | 225,22 |
| Administrative: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 16.839 | $ | 15.922 | $ | 23.302 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 581 | | 495 | | 710 |
| NIW je Anteil | $ | 28,99 | $ | 32,16 | $ | 32,80 |
| Administrative SEK (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | SEK | 81.175 | SEK | 1.941 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 913 | | 20 | | k. A. |
| NIW je Anteil | SEK | 88,88 | SEK | 99,17 | | k. A. |
| Class E: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 370.708 | $ | 463.700 | $ | 550.753 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 13.309 | | 14.974 | | 17.372 |
| NIW je Anteil | $ | 27,85 | $ | 30,97 | $ | 31,70 |
| Erträge | $ | 101.406 | $ | 117.421 | $ | 201.589 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 7.821 | | 8.111 | | 13.511 |
| NIW je Anteil | $ | 12,97 | $ | 14,48 | $ | 14,92 |
| Class E (Currency Exposure): | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 41.006 | $ | 61.145 | $ | 84.089 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.454 | | 4.389 | | 5.699 |
| NIW je Anteil | $ | 11,87 | $ | 13,93 | $ | 14,76 |
| Erträge | $ | 12.322 | $ | 16.440 | $ | 19.720 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.213 | | 1.374 | | 1.545 |
| NIW je Anteil | $ | 10,15 | $ | 11,97 | $ | 12,76 |

| | Zum 30. Juni 2022 | | Zum 31. Dez. 2021 | | Zum 31. Dez. 2020 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Global Bond Fund (Forts.) | | | | | |
| Class E CHF (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | CHF | 2.117 | CHF | 2.358 | CHF | 2.635 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 228 | | 226 | | 244 |
| NIW je Anteil | CHF | 9,30 | CHF | 10,41 | CHF | 10,78 |
| Class E EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 722.743 | € | 959.543 | € | 1.168.524 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 32.154 | | 38.117 | | 44.954 |
| NIW je Anteil | € | 22,48 | € | 25,17 | € | 25,99 |
| Erträge | € | 30.272 | € | 41.846 | € | 61.268 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.334 | | 4.097 | | 5.769 |
| NIW je Anteil | € | 9,08 | € | 10,22 | € | 10,62 |
| Class E NOK (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | NOK | 76 | NOK | 85 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 | | k. A. |
| NIW je Anteil | NOK | 89,54 | NOK | 99,69 | | k. A. |
| G Retail EUR (Hedged): | | | | | | |
| Erträge | € | 82.486 | € | 123.034 | € | 140.905 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 8.977 | | 11.955 | | 13.167 |
| NIW je Anteil | € | 9,19 | € | 10,29 | € | 10,70 |
| H Institutional: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 823.161 | $ | 835.136 | $ | 954.525 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 26.341 | | 24.124 | | 27.130 |
| NIW je Anteil | $ | 31,25 | $ | 34,62 | $ | 35,18 |
| Erträge | $ | 2.096 | $ | 2.643 | $ | 3.905 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 231 | | 261 | | 375 |
| NIW je Anteil | $ | 9,05 | $ | 10,11 | $ | 10,42 |
| H Institutional (Currency Exposure): | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 145.243 | $ | 756 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 17.427 | | 78 | | k. A. |
| NIW je Anteil | $ | 8,33 | $ | 9,75 | | k. A. |
| M Retail: | | | | | | |
| ausschüttend II | $ | 1.536 | $ | 1.742 | $ | 2.809 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 167 | | 168 | | 260 |
| NIW je Anteil | $ | 9,20 | $ | 10,34 | $ | 10,80 |
| M Retail HKD (Unhedged): | | | | | | |
| ausschüttend II | HKD | 5.511 | HKD | 8.307 | HKD | 11.626 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 595 | | 802 | | 1.081 |
| NIW je Anteil | HKD | 9,27 | HKD | 10,35 | HKD | 10,76 |
| M Retail SEK (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | SEK | 80 | SEK | 90 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 | | k. A. |
| NIW je Anteil | SEK | 89,07 | SEK | 99,56 | | k. A. |
| Class R EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 5.765 | € | 6.442 | € | 5.196 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 528 | | 528 | | 415 |
| NIW je Anteil | € | 10,92 | € | 12,19 | € | 12,51 |
| Class R SEK (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | | k. A. | | k. A. | SEK | 100 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | k. A. | | k. A. | | 1 |
| NIW je Anteil | | k. A. | | k. A. | SEK | 111,31 |
| Class T: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 18.778 | $ | 26.245 | $ | 42.315 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.723 | | 2.163 | | 3.396 |
| NIW je Anteil | $ | 10,90 | $ | 12,14 | $ | 12,46 |
| Erträge | $ | 3.111 | $ | 4.183 | $ | 5.274 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 301 | | 362 | | 443 |
| NIW je Anteil | $ | 10,33 | $ | 11,54 | $ | 11,89 |
| Class T EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 14.140 | € | 19.104 | € | 25.635 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.464 | | 1.764 | | 2.285 |
| NIW je Anteil | € | 9,66 | € | 10,83 | € | 11,22 |

| | Zum 30. Juni 2022 | | Zum 31. Dez. 2021 | | Zum 31. Dez. 2020 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Global Bond Fund (Forts.) | | | | | |
| W Class: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 16.367 | $ | 29.951 | $ | 21.207 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.791 | | 2.962 | | 2.070 |
| NIW je Anteil | $ | 9,14 | $ | 10,11 | $ | 10,25 |
| Erträge | $ | 4.105 | $ | 9.066 | $ | 13.683 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 464 | | 919 | | 1.345 |
| NIW je Anteil | $ | 8,84 | $ | 9,87 | $ | 10,17 |
| Class W (Currency Exposure): | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 9 | $ | 10 | $ | 10 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 | | 1 |
| NIW je Anteil | $ | 8,56 | $ | 10,00 | $ | 10,48 |
| Erträge | $ | 9 | $ | 10 | $ | 10 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 | | 1 |
| NIW je Anteil | $ | 8,28 | $ | 9,77 | $ | 10,41 |
| W Class CHF (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | CHF | 24.318 | CHF | 33.361 | CHF | 35.760 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.723 | | 3.352 | | 3.508 |
| NIW je Anteil | CHF | 8,93 | CHF | 9,95 | CHF | 10,20 |
| Erträge | CHF | 705 | CHF | 740 | CHF | 9 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 82 | | 76 | | 1 |
| NIW je Anteil | CHF | 8,64 | CHF | 9,72 | CHF | 10,12 |
| W Class EUR (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 5.465 | € | 14.976 | € | 14.731 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 610 | | 1.500 | | 1.444 |
| NIW je Anteil | € | 8,96 | € | 9,98 | € | 10,20 |
| Erträge | € | 1.893 | € | 2.251 | € | 1.740 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 218 | | 231 | | 172 |
| NIW je Anteil | € | 8,67 | € | 9,75 | € | 10,14 |
| W Class GBP (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | £ | 1.109 | £ | 1.265 | £ | 139 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 122 | | 126 | | 14 |
| NIW je Anteil | £ | 9,10 | £ | 10,08 | £ | 10,23 |
| Erträge | £ | 7.890 | £ | 9.060 | £ | 8.773 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 897 | | 921 | | 863 |
| NIW je Anteil | £ | 8,79 | £ | 9,84 | £ | 10,16 |
| W Class NOK (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | NOK | 4.189 | NOK | 3.799 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 46 | | 38 | | k. A. |
| NIW je Anteil | NOK | 90,64 | NOK | 100,41 | | k. A. |
| W Class SEK (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | SEK | 80 | SEK | 89 | SEK | 91 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 | | 1 |
| NIW je Anteil | SEK | 90,20 | SEK | 100,33 | SEK | 102,20 |
| | Global Bond ESG Fund | | | | | |
| Nettovermögen | $ | 2.177.873 | $ | 2.302.966 | $ | 1.509.594 |
| Institutional: | | | | | | |
| thesaurierend | $ | 300.986 | $ | 300.944 | $ | 153.820 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 27.832 | | 25.077 | | 12.640 |
| NIW je Anteil | $ | 10,81 | $ | 12,00 | $ | 12,17 |
| Erträge | $ | 21.051 | $ | 25.309 | $ | 19.510 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.254 | | 2.428 | | 1.826 |
| NIW je Anteil | $ | 9,34 | $ | 10,43 | $ | 10,68 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | | | | |
| thesaurierend | CHF | 37.872 | CHF | 22.579 | CHF | 16.793 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.966 | | 2.115 | | 1.534 |
| NIW je Anteil | CHF | 9,55 | CHF | 10,67 | CHF | 10,94 |
| Institutional EUR (Currency Exposure): | | | | | | |
| thesaurierend | € | 9.074 | € | 856 | | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | | 982 | | 86 | | k. A. |
| NIW je Anteil | € | 9,24 | € | 9,96 | | k. A. |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | Global Bond ESG Fund (Forts.) | | |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 698.358 | € 623.870 | € 276.328 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 71.810 | 57.390 | 24.851 |
| NIW je Anteil | € 9,73 | € 10,87 | € 11,12 |
| Erträge | € 104.443 | € 111.407 | € 165.370 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.607 | 11.012 | 15.815 |
| NIW je Anteil | € 9,00 | € 10,12 | € 10,46 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 15.308 | £ 16.849 | £ 13.241 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.650 | 1.634 | 1.264 |
| NIW je Anteil | £ 9,28 | £ 10,31 | £ 10,48 |
| Erträge | £ 73.714 | £ 75.165 | £ 43.778 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.804 | 7.117 | 4.037 |
| NIW je Anteil | £ 9,45 | £ 10,56 | £ 10,84 |
| Institutional GBP (Unhedged): | | | |
| Erträge | £ 23.991 | £ 23.387 | £ 7 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.513 | 2.448 | 1 |
| NIW je Anteil | £ 9,55 | £ 9,55 | £ 9,70 |
| Institutional NOK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | NOK 4.956.596 | NOK 5.205.593 | NOK 4.228.645 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 476.917 | 450.696 | 360.891 |
| NIW je Anteil | NOK 10,39 | NOK 11,55 | NOK 11,72 |
| Institutional NZD (Hedged): | | | |
| Erträge | NZD 68.402 | NZD 74.299 | NZD 68.677 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.920 | 6.732 | 6.078 |
| NIW je Anteil | NZD 9,89 | NZD 11,04 | NZD 11,30 |
| Institutional SEK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SEK 494.665 | SEK 568.764 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.511 | 5.678 | k. A. |
| NIW je Anteil | SEK 89,77 | SEK 100,17 | k. A. |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 10.605 | $ 12.127 | $ 18.700 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.026 | 1.055 | 1.600 |
| NIW je Anteil | $ 10,34 | $ 11,49 | $ 11,69 |
| Administrative: | | | |
| thesaurierend | $ 324 | $ 2.318 | $ 11 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 32 | 208 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 10,00 | $ 11,12 | $ 11,34 |
| Erträge | $ 10 | $ 11 | $ 11 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 9,70 | $ 10,82 | $ 11,09 |
| Class E: | | | |
| Erträge | $ 1.793 | $ 2.115 | $ 6.261 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 185 | 196 | 565 |
| NIW je Anteil | $ 9,69 | $ 10,81 | $ 11,08 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 38.973 | € 48.847 | € 44.524 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.200 | 4.688 | 4.140 |
| NIW je Anteil | € 9,28 | € 10,42 | € 10,76 |
| Class Z AUD (Hedged): | | | |
| Erträge | AUD 267.991 | AUD 250.833 | AUD 98.588 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 27.274 | 22.777 | 8.716 |
| NIW je Anteil | AUD 9,83 | AUD 11,01 | AUD 11,31 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | Global Bond Ex-US Fund | | |
| Nettovermögen | $ 733.638 | $ 911.707 | $ 929.980 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 452.030 | $ 527.915 | $ 493.644 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 19.873 | 21.249 | 19.620 |
| NIW je Anteil | $ 22,75 | $ 24,84 | $ 25,16 |
| Erträge | $ 39.801 | $ 52.506 | $ 46.004 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.605 | 3.117 | 2.652 |
| NIW je Anteil | $ 15,28 | $ 16,85 | $ 17,35 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 23.697 | € 23.841 | € 35.120 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.437 | 1.315 | 1.898 |
| NIW je Anteil | € 16,49 | € 18,13 | € 18,50 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | k. A. | k. A. | £ 210 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 20 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | £ 10,54 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 7.883 | $ 17.194 | $ 21.037 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 367 | 732 | 881 |
| NIW je Anteil | $ 21,47 | $ 23,49 | $ 23,88 |
| Administrative: | | | |
| thesaurierend | $ 11.148 | $ 12.451 | $ 10.624 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 536 | 546 | 458 |
| NIW je Anteil | $ 20,81 | $ 22,79 | $ 23,19 |
| Class E: | | | |
| Erträge | $ 21.765 | $ 54.115 | $ 46.592 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.467 | 3.309 | 2.766 |
| NIW je Anteil | $ 14,84 | $ 16,36 | $ 16,84 |
| Class E (Currency Exposure): | | | |
| Erträge | $ 62.970 | $ 81.361 | $ 56.847 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.653 | 8.142 | 5.213 |
| NIW je Anteil | $ 8,23 | $ 9,99 | $ 10,91 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 7.000 | $ 1.160 | $ 73.013 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 684 | 104 | 6.428 |
| NIW je Anteil | $ 10,24 | $ 11,20 | $ 11,36 |
| Class Z: | | | |
| thesaurierend | $ 106.266 | $ 137.893 | $ 138.962 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 10.957 | 13.049 | 13.049 |
| NIW je Anteil | $ 9,70 | $ 10,57 | $ 10,65 |
| | PIMCO Global Core Asset Allocation Fund | | |
| Nettovermögen | $ 779.292 | $ 1.035.021 | $ 702.430 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 30.004 | $ 37.389 | $ 45.298 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.535 | 1.571 | 2.116 |
| NIW je Anteil | $ 19,55 | $ 23,80 | $ 21,41 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 218.983 | € 352.099 | € 123.732 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 12.386 | 16.474 | 6.469 |
| NIW je Anteil | € 17,68 | € 21,37 | € 19,13 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 3.561 | £ 4.301 | £ 4.026 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 350 | 345 | 349 |
| NIW je Anteil | £ 10,16 | £ 12,45 | £ 11,55 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 8.263 | $ 10.116 | $ 9.158 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 569 | 571 | 573 |
| NIW je Anteil | $ 14,51 | $ 17,70 | $ 15,98 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 33.093 | $ 40.303 | $ 33.696 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.978 | 1.966 | 1.806 |
| NIW je Anteil | $ 16,73 | $ 20,50 | $ 18,66 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (Forts.) | | |
| Erträge | $ 13.034 | $ 13.372 | $ 8.100 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.427 | 1.172 | 749 |
| NIW je Anteil | $ 9,13 | $ 11,41 | $ 10,81 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 233.814 | € 230.733 | € 205.357 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 15.455 | 12.541 | 12.325 |
| NIW je Anteil | € 15,13 | € 18,40 | € 16,66 |
| Erträge | € 50.218 | € 57.708 | € 42.548 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.992 | 5.551 | 4.342 |
| NIW je Anteil | € 8,38 | € 10,40 | € 9,80 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 9 | k. A. | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,35 | k. A. | k. A. |
| Erträge | $ 9 | k. A. | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,28 | k. A. | k. A. |
| Class Z: | | | |
| thesaurierend | $ 164.678 | $ 199.594 | $ 145.959 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.355 | 11.355 | 9.320 |
| NIW je Anteil | $ 14,50 | $ 17,58 | $ 15,66 |
| | Global High Yield Bond Fund | | |
| Nettovermögen | $ 3.524.410 | $ 5.169.160 | $ 5.403.543 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 539.329 | $ 844.967 | $ 1.065.384 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 21.857 | 29.240 | 38.174 |
| NIW je Anteil | $ 24,67 | $ 28,90 | $ 27,91 |
| Erträge | $ 380.903 | $ 489.734 | $ 349.849 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 40.000 | 42.937 | 30.507 |
| NIW je Anteil | $ 9,52 | $ 11,41 | $ 11,47 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 22.442 | CHF 38.082 | CHF 40.299 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.453 | 2.089 | 2.265 |
| NIW je Anteil | CHF 15,45 | CHF 18,23 | CHF 17,79 |
| Erträge | CHF 13.478 | CHF 16.630 | CHF 18.324 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.822 | 1.863 | 2.019 |
| NIW je Anteil | CHF 7,40 | CHF 8,93 | CHF 9,08 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 850.885 | € 1.232.938 | € 1.149.182 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 39.681 | 48.671 | 46.572 |
| NIW je Anteil | € 21,44 | € 25,33 | € 24,68 |
| Erträge | € 120.192 | € 119.724 | € 109.781 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 12.424 | 10.243 | 9.253 |
| NIW je Anteil | € 9,67 | € 11,69 | € 11,86 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 162.780 | £ 239.206 | £ 96.397 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.543 | 14.437 | 6.007 |
| NIW je Anteil | £ 14,10 | £ 16,57 | £ 16,05 |
| Erträge | £ 420.603 | £ 557.487 | £ 642.574 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 86.902 | 95.775 | 109.465 |
| NIW je Anteil | £ 4,84 | £ 5,82 | £ 5,87 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 7.269 | $ 12.295 | $ 12.417 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 625 | 902 | 940 |
| NIW je Anteil | $ 11,62 | $ 13,64 | $ 13,21 |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 11.994 | € 5.703 | € 3.311 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 582 | 234 | 139 |
| NIW je Anteil | € 20,59 | € 24,37 | € 23,83 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | Global High Yield Bond Fund (Forts.) | | |
| Administrative: | | | |
| thesaurierend | $ 36.641 | $ 50.855 | $ 47.282 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.591 | 1.881 | 1.802 |
| NIW je Anteil | $ 23,03 | $ 27,04 | $ 26,24 |
| Erträge | $ 23.153 | $ 32.985 | $ 29.675 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.484 | 2.956 | 2.644 |
| NIW je Anteil | $ 9,32 | $ 11,16 | $ 11,22 |
| Administrative EUR (Hedged): | | | |
| Erträge | € 1.332 | € 1.908 | € 2.201 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 166 | 196 | 223 |
| NIW je Anteil | € 8,04 | € 9,71 | € 9,85 |
| Administrative GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 936 | £ 1.111 | £ 1.475 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 108 | 106 | 140 |
| NIW je Anteil | £ 8,69 | £ 10,44 | £ 10,53 |
| BM Retail: | | | |
| ausschüttend II | $ 9 | k. A. | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,17 | k. A. | k. A. |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 140.780 | $ 186.558 | $ 210.078 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.575 | 7.407 | 8.558 |
| NIW je Anteil | $ 21,41 | $ 25,19 | $ 24,55 |
| Erträge | $ 109.027 | $ 151.015 | $ 224.794 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.631 | 13.453 | 19.913 |
| NIW je Anteil | $ 9,37 | $ 11,23 | $ 11,29 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 227.237 | € 299.451 | € 288.006 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 10.872 | 12.074 | 11.814 |
| NIW je Anteil | € 20,90 | € 24,80 | € 24,38 |
| Erträge | € 28.343 | € 38.159 | € 43.265 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.582 | 3.992 | 4.460 |
| NIW je Anteil | € 7,91 | € 9,56 | € 9,70 |
| Class E GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 5.872 | £ 7.285 | £ 7.198 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 576 | 595 | 583 |
| NIW je Anteil | £ 10,19 | £ 12,25 | £ 12,36 |
| Class E SGD (Hedged): | | | |
| Erträge | SGD 5.669 | SGD 11.731 | SGD 9.093 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 646 | 1.116 | 860 |
| NIW je Anteil | SGD 8,78 | SGD 10,52 | SGD 10,57 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 135.968 | $ 82.082 | $ 240.370 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.730 | 2.952 | 8.934 |
| NIW je Anteil | $ 23,73 | $ 27,81 | $ 26,91 |
| Erträge | $ 6.442 | $ 10.759 | $ 9.847 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 763 | 1.064 | 968 |
| NIW je Anteil | $ 8,44 | $ 10,11 | $ 10,17 |
| M Retail: | | | |
| Erträge | $ 20.227 | $ 25.552 | $ 30.491 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.185 | 2.306 | 2.736 |
| NIW je Anteil | $ 9,26 | $ 11,08 | $ 11,14 |
| ausschüttend II | $ 59.424 | $ 107.627 | $ 49.638 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.896 | 11.857 | 5.358 |
| NIW je Anteil | $ 7,53 | $ 9,08 | $ 9,26 |
| Class R: | | | |
| thesaurierend | $ 3.003 | $ 73.221 | $ 73.682 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 221 | 4.598 | 4.779 |
| NIW je Anteil | $ 13,57 | $ 15,92 | $ 15,42 |
| Class T: | | | |
| thesaurierend | $ 5.720 | $ 7.458 | $ 7.892 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 501 | 554 | 599 |
| NIW je Anteil | $ 11,42 | $ 13,47 | $ 13,18 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | **Global High Yield Bond Fund (Forts.)** | | |
| Erträge | $ 1.824 | $ 2.373 | $ 2.703 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 209 | 227 | 257 |
| NIW je Anteil | $ 8,74 | $ 10,46 | $ 10,52 |
| Class T EUR (Hedged): thesaurierend | k. A. | € 1.450 | € 1.448 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 130 | 132 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 11,14 | € 11,00 |
| | **Global Investment Grade Credit Fund** | | |
| Nettovermögen | $ 11.017.307 | $ 17.154.925 | $ 28.178.170 |
| Institutional: thesaurierend | $ 2.647.975 | $ 3.806.107 | $ 5.463.978 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 141.188 | 172.781 | 244.589 |
| NIW je Anteil | $ 18,75 | $ 22,03 | $ 22,34 |
| Erträge | $ 509.574 | $ 705.907 | $ 1.176.158 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 46.396 | 53.902 | 86.159 |
| NIW je Anteil | $ 10,98 | $ 13,10 | $ 13,65 |
| Institutional (Currency Exposure): thesaurierend | $ 105.848 | $ 86.823 | $ 135.818 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.748 | 5.244 | 7.905 |
| NIW je Anteil | $ 13,66 | $ 16,56 | $ 17,18 |
| Erträge | $ 26.082 | $ 33.395 | $ 46.397 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.216 | 3.347 | 4.359 |
| NIW je Anteil | $ 8,11 | $ 9,98 | $ 10,64 |
| Institutional AUD (Hedged): Erträge | AUD 7.744 | AUD 90.155 | AUD 193.406 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 878 | 8.528 | 17.513 |
| NIW je Anteil | AUD 8,82 | AUD 10,57 | AUD 11,04 |
| Institutional CAD (Hedged): Erträge | CAD 297 | CAD 12 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 37 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | CAD 8,05 | CAD 9,70 | k. A. |
| Institutional CHF (Hedged): thesaurierend | CHF 693.694 | CHF 814.188 | CHF 1.033.114 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 45.643 | 45.260 | 56.019 |
| NIW je Anteil | CHF 15,20 | CHF 17,99 | CHF 18,44 |
| Erträge | CHF 34.835 | CHF 49.517 | CHF 64.939 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.662 | 5.516 | 6.862 |
| NIW je Anteil | CHF 7,47 | CHF 8,98 | CHF 9,46 |
| Institutional CZK (Hedged): Erträge | CZK 343.758 | CZK 2.085.033 | CZK 2.321.368 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 41.838 | 216.797 | 232.003 |
| NIW je Anteil | CZK 8,22 | CZK 9,62 | CZK 10,01 |
| Institutional EUR (Currency Exposure): thesaurierend | € 42.875 | € 39.844 | € 19.426 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.281 | 2.737 | 1.383 |
| NIW je Anteil | € 13,07 | € 14,56 | € 14,04 |
| Institutional EUR (Hedged): thesaurierend | € 1.590.905 | € 2.237.224 | € 3.901.877 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 92.604 | 109.970 | 187.485 |
| NIW je Anteil | € 17,18 | € 20,34 | € 20,81 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | **Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)** | | |
| Erträge | € 511.955 | € 803.485 | € 740.139 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 52.291 | 68.258 | 59.770 |
| NIW je Anteil | € 9,79 | € 11,77 | € 12,38 |
| Institutional GBP (Hedged): thesaurierend | £ 141.384 | £ 258.867 | £ 443.999 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.447 | 11.576 | 19.545 |
| NIW je Anteil | £ 18,98 | £ 22,36 | £ 22,72 |
| Erträge | £ 1.100.674 | £ 1.684.722 | £ 3.908.795 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 96.528 | 123.537 | 274.389 |
| NIW je Anteil | £ 11,40 | £ 13,64 | £ 14,25 |
| Institutional HUF (Hedged): Erträge | k. A. | HUF 9.873.261 | HUF 9.940.031 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 1.025.701 | 995.298 |
| NIW je Anteil | k. A. | HUF 9,63 | HUF 9,99 |
| Institutional ILS (Hedged): thesaurierend | k. A. | ILS 9.004 | ILS 231.711 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 531 | 13.394 |
| NIW je Anteil | k. A. | ILS 16,96 | ILS 17,30 |
| Institutional NOK (Hedged): thesaurierend | NOK 364.845 | NOK 429.061 | NOK 452.970 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.685 | 2.683 | 2.793 |
| NIW je Anteil | NOK 135,89 | NOK 159,90 | NOK 162,17 |
| Institutional PLN (Hedged): Erträge | k. A. | PLN 120.869 | PLN 24.867 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 11.435 | 2.257 |
| NIW je Anteil | k. A. | PLN 10,57 | PLN 11,02 |
| Institutional SEK (Hedged): thesaurierend | SEK 2.606.930 | SEK 3.657.935 | SEK 4.033.636 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 178.230 | 211.649 | 228.950 |
| NIW je Anteil | SEK 14,63 | SEK 17,28 | SEK 17,62 |
| Institutional SGD (Hedged): Erträge | SGD 3.700 | SGD 8.028 | SGD 53.885 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 412 | 749 | 4.827 |
| NIW je Anteil | SGD 8,99 | SGD 10,72 | SGD 11,16 |
| Investor: thesaurierend | $ 416.774 | $ 988.957 | $ 1.715.463 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 20.357 | 41.056 | 69.981 |
| NIW je Anteil | $ 20,47 | $ 24,09 | $ 24,51 |
| Erträge | $ 100.690 | $ 92.275 | $ 272.490 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.618 | 6.624 | 18.766 |
| NIW je Anteil | $ 11,68 | $ 13,93 | $ 14,52 |
| Investor AUD (Hedged): Erträge | AUD 10.051 | AUD 5.854 | AUD 8.681 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.161 | 565 | 802 |
| NIW je Anteil | AUD 8,65 | AUD 10,37 | AUD 10,83 |
| Investor CAD (Hedged): Erträge | k. A. | CAD 1.822 | CAD 3.272 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 175 | 300 |
| NIW je Anteil | k. A. | CAD 10,44 | CAD 10,89 |
| Investor CHF (Hedged): thesaurierend | CHF 5.642 | CHF 7.624 | CHF 8.313 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 506 | 577 | 611 |
| NIW je Anteil | CHF 11,15 | CHF 13,22 | CHF 13,60 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | Global Investment Grade Credit Fund (Forts.) | | |
| Erträge | CHF 5.936 | CHF 8.176 | CHF 10.171 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 617 | 707 | 834 |
| NIW je Anteil | CHF 9,62 | CHF 11,56 | CHF 12,19 |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 29.224 | € 49.619 | € 71.993 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.801 | 2.577 | 3.643 |
| NIW je Anteil | € 16,23 | € 19,25 | € 19,76 |
| Erträge | € 11.921 | € 16.646 | € 16.947 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.161 | 1.349 | 1.306 |
| NIW je Anteil | € 10,26 | € 12,34 | € 12,98 |
| Investor GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 4.312 | £ 5.735 | £ 8.458 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 390 | 433 | 612 |
| NIW je Anteil | £ 11,07 | £ 13,23 | £ 13,82 |
| Investor RMB (Hedged): | | | |
| Erträge | k. A. | CNH 3.345 | CNH 7.674 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 30 | 67 |
| NIW je Anteil | k. A. | CNH 111,93 | CNH 113,76 |
| Investor SGD (Hedged): | | | |
| Erträge | SGD 8.556 | SGD 7.473 | SGD 20.558 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 976 | 715 | 1.889 |
| NIW je Anteil | SGD 8,76 | SGD 10,45 | SGD 10,89 |
| Administrative: | | | |
| thesaurierend | $ 80.817 | $ 215.743 | $ 241.443 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.608 | 10.444 | 11.468 |
| NIW je Anteil | $ 17,54 | $ 20,66 | $ 21,05 |
| Erträge | $ 59.865 | $ 99.369 | $ 290.320 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.299 | 7.378 | 20.679 |
| NIW je Anteil | $ 11,30 | $ 13,47 | $ 14,04 |
| Administrative CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 403 | CHF 629 | CHF 1.583 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 41 | 54 | 132 |
| NIW je Anteil | CHF 9,82 | CHF 11,65 | CHF 12,01 |
| Administrative EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 6.279 | € 9.518 | € 21.800 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 409 | 523 | 1.165 |
| NIW je Anteil | € 15,34 | € 18,21 | € 18,72 |
| Erträge | € 8.173 | € 9.315 | € 13.726 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 825 | 782 | 1.095 |
| NIW je Anteil | € 9,91 | € 11,91 | € 12,53 |
| Administrative GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 5.086 | £ 6.985 | £ 9.572 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 462 | 531 | 696 |
| NIW je Anteil | £ 11,01 | £ 13,17 | £ 13,75 |
| Administrative HKD (Unhedged): | | | |
| Erträge | HKD 10.814 | HKD 12.810 | HKD 40.974 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.244 | 1.244 | 3.837 |
| NIW je Anteil | HKD 8,69 | HKD 10,30 | HKD 10,68 |
| Administrative SEK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SEK817.717 | SEK 936.226 | SEK 1.214.895 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 78.858 | 76.221 | 96.543 |
| NIW je Anteil | SEK 10,37 | SEK 12,28 | SEK 12,58 |
| Administrative SGD (Hedged): | | | |
| Erträge | SGD 2.918 | SGD 5.459 | SGD 48.256 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 345 | 542 | 4.597 |
| NIW je Anteil | SGD 8,45 | SGD 10,08 | SGD 10,50 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 566.019 | $ 799.659 | $ 1.314.292 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 34.069 | 40.796 | 65.526 |
| NIW je Anteil | $ 16,61 | $ 19,60 | $ 20,06 |
| Erträge | $ 232.030 | $ 341.550 | $ 615.957 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 19.467 | 24.037 | 41.586 |
| NIW je Anteil | $ 11,92 | $ 14,21 | $ 14,81 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | Global Investment Grade Credit Fund (Forts.) | | |
| Class E CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 56.656 | CHF 78.253 | CHF 87.585 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.575 | 6.476 | 7.007 |
| NIW je Anteil | CHF 10,16 | CHF 12,08 | CHF 12,50 |
| Class E EUR (Currency Exposure) | | | |
| Erträge | € 1.400 | € 3.077 | € 4.671 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 148 | 288 | 441 |
| NIW je Anteil | € 9,44 | € 10,67 | € 10,58 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 443.628 | € 630.730 | € 767.585 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 29.897 | 35.735 | 42.129 |
| NIW je Anteil | € 14,84 | € 17,65 | € 18,22 |
| Erträge | € 207.108 | € 271.438 | € 354.267 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 24.525 | 26.741 | 33.181 |
| NIW je Anteil | € 8,44 | € 10,15 | € 10,68 |
| Class E GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 22.011 | £ 31.335 | £ 44.366 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.914 | 2.279 | 3.090 |
| NIW je Anteil | £ 11,50 | £ 13,75 | £ 14,36 |
| Class E SGD (Hedged): | | | |
| Erträge | SGD 24.923 | SGD 37.343 | SGD 84.734 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.770 | 3.481 | 7.583 |
| NIW je Anteil | SGD 9,00 | SGD 10,73 | SGD 11,17 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 126.820 | $ 168.210 | $ 358.146 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.494 | 7.327 | 15.358 |
| NIW je Anteil | $ 19,53 | $ 22,96 | $ 23,32 |
| Erträge | $ 15.805 | $ 14.287 | $ 12.263 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.782 | 1.351 | 1.113 |
| NIW je Anteil | $ 8,87 | $ 10,57 | $ 11,02 |
| H Institutional (Currency Exposure): | | | |
| thesaurierend | $ 8 | $ 10 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 8,12 | $ 9,85 | k. A. |
| M Retail: | | | |
| Erträge | $ 25.970 | $ 49.229 | $ 120.020 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.878 | 4.577 | 10.705 |
| NIW je Anteil | $ 9,02 | $ 10,76 | $ 11,21 |
| ausschüttend II | $ 93.443 | $ 120.251 | $ 189.177 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.358 | 12.179 | 18.129 |
| NIW je Anteil | $ 8,23 | $ 9,87 | $ 10,43 |
| M Retail HKD (Unhedged): | | | |
| Erträge | HKD 7.723 | HKD 9.145 | HKD 56.230 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 887 | 887 | 5.264 |
| NIW je Anteil | HKD 8,70 | HKD 10,31 | HKD 10,68 |
| Class R: | | | |
| thesaurierend | $ 17.931 | $ 28.433 | $ 38.196 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.504 | 2.028 | 2.679 |
| NIW je Anteil | $ 11,92 | $ 14,02 | $ 14,26 |
| Erträge | $ 4.933 | $ 6.925 | $ 8.289 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 552 | 650 | 746 |
| NIW je Anteil | $ 8,94 | $ 10,66 | $ 11,11 |
| Class R EUR (Hedged): | | | |
| Erträge | € 2.938 | € 6.026 | € 9.645 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 373 | 636 | 968 |
| NIW je Anteil | € 7,88 | € 9,47 | € 9,97 |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 9.313 | £ 11.449 | £ 26.041 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.110 | 1.141 | 2.485 |
| NIW je Anteil | £ 8,39 | £ 10,04 | £ 10,48 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | **Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)** | | |
| Class T: | | | |
| thesaurierend | $ 28.216 | $ 42.303 | $ 61.567 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.711 | 3.438 | 4.870 |
| NIW je Anteil | $ 10,41 | $ 12,30 | $ 12,64 |
| Class T EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 3.549 | € 4.875 | € 7.585 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 387 | 446 | 669 |
| NIW je Anteil | € 9,18 | € 10,94 | € 11,34 |
| W Class: | | | |
| thesaurierend | $ 33.005 | $ 66.615 | $ 70.586 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.806 | 6.543 | 6.843 |
| NIW je Anteil | $ 8,67 | $ 10,18 | $ 10,32 |
| Erträge | $ 11.526 | $ 20.732 | $ 30.591 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.403 | 2.116 | 2.996 |
| NIW je Anteil | $ 8,22 | $ 9,80 | $ 10,21 |
| W Class CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 22.279 | CHF 32.864 | CHF 36.879 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.629 | 3.278 | 3.592 |
| NIW je Anteil | CHF 8,47 | CHF 10,03 | CHF 10,27 |
| W Class EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 65.754 | € 150.079 | € 14.050 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.741 | 14.925 | 1.367 |
| NIW je Anteil | € 8,49 | € 10,06 | € 10,28 |
| Erträge | € 2.363 | € 3.545 | € 4.089 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 294 | 367 | 402 |
| NIW je Anteil | € 8,04 | € 9,67 | € 10,17 |
| W Class GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 932 | £ 515 | £ 8 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 108 | 51 | 1 |
| NIW je Anteil | £ 8,62 | £ 10,15 | £ 10,30 |
| Erträge | £ 6.788 | £ 16.284 | £ 15.521 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 832 | 1.668 | 1.521 |
| NIW je Anteil | £ 8,16 | £ 9,76 | £ 10,20 |
| W Class SGD (Hedged): | | | |
| Erträge | SGD 477 | SGD 810 | SGD 14 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 58 | 83 | 1 |
| NIW je Anteil | SGD 8,21 | SGD 9,79 | SGD 10,20 |
| | **Global Investment Grade Credit ESG Fund** | | |
| Nettovermögen | $ 1.426.496 | $ 1.189.563 | $ 332.010 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 48.901 | $ 39.212 | $ 42.254 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.640 | 3.211 | 3.426 |
| NIW je Anteil | $ 10,54 | $ 12,21 | $ 12,33 |
| Erträge | $ 7.154 | $ 19.429 | $ 29.531 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 786 | 1.825 | 2.706 |
| NIW je Anteil | $ 9,10 | $ 10,65 | $ 10,91 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 183.129 | CHF 185.627 | CHF 54.442 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 18.880 | 16.381 | 4.707 |
| NIW je Anteil | CHF 9,70 | CHF 11,33 | CHF 11,57 |
| Erträge | CHF 2.396 | CHF 3.002 | CHF 200 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 286 | 304 | 19 |
| NIW je Anteil | CHF 8,37 | CHF 9,88 | CHF 10,24 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 230.955 | € 229.148 | € 49.683 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 23.547 | 19.996 | 4.257 |
| NIW je Anteil | € 9,81 | € 11,46 | € 11,67 |
| Erträge | € 397.136 | € 42.749 | € 23.021 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 47.207 | 4.306 | 2.243 |
| NIW je Anteil | € 8,41 | € 9,93 | € 10,26 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | **Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)** | | |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 73.288 | £ 83.370 | £ 15.049 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.240 | 7.085 | 1.264 |
| NIW je Anteil | £ 10,12 | £ 11,77 | £ 11,90 |
| Erträge | £ 124.258 | £ 155.708 | £ 10.023 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 13.675 | 14.592 | 915 |
| NIW je Anteil | £ 9,09 | £ 10,67 | £ 10,96 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 122 | $ 141 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 14 | 14 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 8,69 | $ 10,09 | k. A. |
| Administrative SEK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SEK 2.590.661 | SEK 2.293.688 | SEK 349.070 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 28.983 | 21.953 | 3.274 |
| NIW je Anteil | SEK 89,39 | SEK 104,48 | SEK 106,61 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 1.678 | $ 3.820 | $ 10.591 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 190 | 372 | 1.011 |
| NIW je Anteil | $ 8,83 | $ 10,28 | $ 10,47 |
| Erträge | $ 457 | $ 834 | $ 3.531 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 53 | 82 | 339 |
| NIW je Anteil | $ 8,67 | $ 10,15 | $ 10,40 |
| Class E CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 298 | CHF 194 | CHF 1.953 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 35 | 19 | 189 |
| NIW je Anteil | CHF 8,53 | CHF 10,01 | CHF 10,31 |
| Erträge | CHF 25 | CHF 30 | CHF 31 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3 | 3 | 3 |
| NIW je Anteil | CHF 8,37 | CHF 9,87 | CHF 10,23 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 3.781 | € 7.130 | € 6.631 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 441 | 709 | 642 |
| NIW je Anteil | € 8,56 | € 10,05 | € 10,33 |
| Erträge | € 648 | € 869 | € 561 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 77 | 88 | 55 |
| NIW je Anteil | € 8,40 | € 9,92 | € 10,25 |
| Class E GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 431 | £ 503 | £ 532 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 50 | 50 | 51 |
| NIW je Anteil | £ 8,70 | £ 10,16 | £ 10,37 |
| Erträge | k. A. | £ 104 | £ 114 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 10 | 11 |
| NIW je Anteil | k. A. | £ 10,02 | £ 10,29 |
| Class Z: | | | |
| thesaurierend | $ 19.541 | $ 22.582 | $ 6.627 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.986 | 1.986 | 580 |
| NIW je Anteil | $ 9,84 | $ 11,37 | $ 11,43 |
| | **Global Low Duration Real Return Fund** | | |
| Nettovermögen | $ 982.228 | $ 1.199.076 | $ 787.871 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 169.265 | $ 150.363 | $ 121.782 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 14.261 | 12.580 | 10.630 |
| NIW je Anteil | $ 11,87 | $ 11,95 | $ 11,46 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 31.149 | CHF 32.711 | CHF 10.894 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.080 | 3.190 | 1.097 |
| NIW je Anteil | CHF 10,11 | CHF 10,25 | CHF 9,93 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 322.684 | € 518.804 | € 360.889 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 30.854 | 48.941 | 35.221 |
| NIW je Anteil | € 10,46 | € 10,60 | € 10,25 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | **Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)** | | |
| Erträge | € 37.817 | € 45.289 | € 39.196 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.075 | 4.630 | 4.002 |
| NIW je Anteil | € 9,28 | € 9,78 | € 9,79 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 67.807 | £ 63.979 | £ 32.234 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.156 | 5.771 | 3.025 |
| NIW je Anteil | £ 11,01 | £ 11,09 | £ 10,66 |
| Erträge | £ 55.503 | £ 57.902 | £ 31.115 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.753 | 5.720 | 3.085 |
| NIW je Anteil | £ 9,65 | £ 10,12 | £ 10,09 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 7.659 | $ 5.146 | $ 3.787 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 665 | 443 | 339 |
| NIW je Anteil | $ 11,51 | $ 11,61 | $ 11,17 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 42.351 | $ 26.574 | $ 15.858 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.847 | 2.386 | 1.472 |
| NIW je Anteil | $ 11,01 | $ 11,14 | $ 10,77 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 194.919 | € 153.469 | € 47.404 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 20.098 | 15.545 | 4.923 |
| NIW je Anteil | € 9,70 | € 9,87 | € 9,63 |
| | **Global Real Return Fund** | | |
| Nettovermögen | $ 2.797.063 | $ 3.703.379 | $ 2.578.062 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 301.330 | $ 380.827 | $ 220.950 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 13.353 | 14.784 | 9.004 |
| NIW je Anteil | $ 22,57 | $ 25,76 | $ 24,54 |
| Erträge | $ 13.798 | $ 22.531 | $ 26.256 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 826 | 1.136 | 1.349 |
| NIW je Anteil | $ 16,70 | $ 19,84 | $ 19,47 |
| Institutional (Currency Exposure): | | | |
| thesaurierend | $ 50.438 | $ 68.405 | $ 84.232 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.922 | 5.543 | 7.004 |
| NIW je Anteil | $ 10,25 | $ 12,34 | $ 12,03 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 54.033 | CHF 63.005 | CHF 52.289 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.850 | 3.907 | 3.366 |
| NIW je Anteil | CHF 14,03 | CHF 16,12 | CHF 15,53 |
| Erträge | CHF 31.373 | CHF 38.988 | CHF 36.335 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.308 | 3.438 | 3.228 |
| NIW je Anteil | CHF 9,48 | CHF 11,34 | CHF 11,26 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 840.519 | € 1.075.404 | € 796.538 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 43.697 | 48.681 | 37.555 |
| NIW je Anteil | € 19,23 | € 22,09 | € 21,21 |
| Erträge | € 113.470 | € 140.728 | € 152.140 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.114 | 8.415 | 9.195 |
| NIW je Anteil | € 13,99 | € 16,72 | € 16,55 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 41.722 | £ 45.209 | £ 33.719 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.350 | 3.177 | 2.484 |
| NIW je Anteil | £ 12,45 | £ 14,23 | £ 13,57 |
| Erträge | £ 223.165 | £ 276.097 | £ 83.894 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 25.364 | 26.297 | 8.128 |
| NIW je Anteil | £ 8,80 | £ 10,50 | £ 10,32 |
| Institutional SGD (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SGD 269.536 | SGD 307.106 | SGD 157.065 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 16.271 | 16.250 | 8.732 |
| NIW je Anteil | SGD 16,57 | SGD 18,90 | SGD 17,99 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | **Global Real Return Fund (Forts.)** | | |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 75.650 | $ 92.993 | $ 70.699 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.581 | 3.850 | 3.062 |
| NIW je Anteil | $ 21,13 | $ 24,16 | $ 23,09 |
| Erträge | $ 10.352 | $ 31.044 | $ 21.532 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 711 | 1.795 | 1.269 |
| NIW je Anteil | $ 14,56 | $ 17,30 | $ 16,97 |
| Investor CHF (Hedged): | | | |
| Erträge | CHF 3.911 | CHF 5.139 | CHF 4.219 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 328 | 360 | 298 |
| NIW je Anteil | CHF 11,94 | CHF 14,28 | CHF 14,17 |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 25.257 | € 36.406 | € 15.265 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.399 | 1.752 | 763 |
| NIW je Anteil | € 18,06 | € 20,77 | € 20,02 |
| Administrative: | | | |
| thesaurierend | $ 57.038 | $ 71.230 | $ 61.037 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.758 | 3.010 | 2.694 |
| NIW je Anteil | $ 20,68 | $ 23,66 | $ 22,65 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 194.783 | $ 231.761 | $ 157.612 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 10.014 | 10.391 | 7.352 |
| NIW je Anteil | $ 19,45 | $ 22,30 | $ 21,44 |
| Erträge | $ 44.778 | $ 53.098 | $ 31.022 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.193 | 3.187 | 1.898 |
| NIW je Anteil | $ 14,02 | $ 16,66 | $ 16,35 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 264.836 | € 321.175 | € 217.762 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 15.956 | 16.773 | 11.740 |
| NIW je Anteil | € 16,60 | € 19,15 | € 18,55 |
| Class E GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 2.659 | £ 4.354 | £ 2.597 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 205 | 282 | 171 |
| NIW je Anteil | £ 12,99 | £ 15,45 | £ 15,19 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 121.898 | $ 150.924 | $ 49.942 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.566 | 6.032 | 2.092 |
| NIW je Anteil | $ 21,90 | $ 25,02 | $ 23,87 |
| Class R: | | | |
| thesaurierend | $ 1.817 | $ 7.292 | $ 1.921 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 146 | 514 | 142 |
| NIW je Anteil | $ 12,41 | $ 14,18 | $ 13,54 |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 10.426 | £ 12.683 | £ 13.745 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 888 | 944 | 1.069 |
| NIW je Anteil | £ 11,75 | £ 13,44 | £ 12,86 |
| | **Income Fund** | | |
| Nettovermögen | $ 56.857.167 | $ 73.579.726 | $ 71.275.311 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 9.002.355 | $ 10.989.198 | $ 10.051.322 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 586.196 | 643.353 | 603.562 |
| NIW je Anteil | $ 15,36 | $ 17,08 | $ 16,65 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | Income Fund (Forts.) | | |
| Erträge | $ 4.758.215 | $ 5.308.194 | $ 4.407.646 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 449.933 | 442.049 | 362.996 |
| NIW je Anteil | $ 10,58 | $ 12,01 | $ 12,14 |
| Institutional AUD (Hedged): thesaurierend | AUD 79.460 | AUD 96.588 | AUD 88.881 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.664 | 8.329 | 7.836 |
| NIW je Anteil | AUD 10,37 | AUD 11,60 | AUD 11,34 |
| Erträge | AUD 1.071 | AUD 14 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 125 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | AUD 8,60 | AUD 9,84 | k. A. |
| Institutional BRL (Hedged): thesaurierend | $ 352.133 | $ 561.362 | $ 601.491 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 27.292 | 43.619 | 46.272 |
| NIW je Anteil | $ 12,90 | $ 12,87 | $ 13,00 |
| Institutional CAD (Hedged): thesaurierend | CAD 87.935 | CAD 98.436 | CAD 111.995 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.370 | 7.406 | 8.629 |
| NIW je Anteil | CAD 11,93 | CAD 13,29 | CAD 12,98 |
| Erträge | CAD 118.689 | CAD 138.770 | CAD 127.606 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 12.990 | 13.346 | 12.097 |
| NIW je Anteil | CAD 9,14 | CAD 10,40 | CAD 10,55 |
| Institutional CHF (Hedged): thesaurierend | CHF 282.474 | CHF 326.885 | CHF 273.775 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 25.700 | 26.540 | 22.558 |
| NIW je Anteil | CHF 10,99 | CHF 12,32 | CHF 12,14 |
| Erträge | CHF 147.307 | CHF 178.124 | CHF 183.521 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 18.297 | 19.281 | 19.319 |
| NIW je Anteil | CHF 8,05 | CHF 9,24 | CHF 9,50 |
| Institutional EUR (Hedged): thesaurierend | € 4.421.483 | € 6.397.698 | € 6.723.610 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 329.370 | 424.812 | 453.932 |
| NIW je Anteil | € 13,42 | € 15,06 | € 14,81 |
| Erträge | € 957.827 | € 1.216.992 | € 963.725 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 106.000 | 117.285 | 90.563 |
| NIW je Anteil | € 9,04 | € 10,38 | € 10,64 |
| ausschüttend II | € 17.695 | € 21.567 | € 58.118 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.990 | 2.138 | 5.750 |
| NIW je Anteil | € 8,89 | € 10,09 | € 10,11 |
| Institutional GBP (Hedged): thesaurierend | £ 204.492 | £ 223.422 | £ 13.809 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 20.209 | 19.797 | 1.252 |
| NIW je Anteil | £ 10,12 | £ 11,29 | £ 11,03 |
| Erträge | £ 435.641 | £ 465.680 | £ 426.938 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 47.754 | 44.776 | 40.380 |
| NIW je Anteil | £ 9,12 | £ 10,40 | £ 10,57 |
| Institutional HKD (Unhedged): Erträge | HKD 449.676 | HKD 798.164 | HKD 796.572 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 46.293 | 72.832 | 72.285 |
| NIW je Anteil | HKD 9,71 | HKD 10,96 | HKD 11,02 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | Income Fund (Forts.) | | |
| Institutional JPY (Hedged): thesaurierend | ¥ 350.102 | ¥ 255.548 | ¥ 198.303 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 351 | 229 | 181 |
| NIW je Anteil | ¥ 999,00 | ¥ 1.118,00 | ¥ 1.093,00 |
| Institutional NOK (Hedged): thesaurierend | NOK 2.033.858 | NOK 2.187.743 | NOK 2.157.697 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 19.166 | 18.488 | 18.680 |
| NIW je Anteil | NOK 106,12 | NOK 118,34 | NOK 115,51 |
| Institutional RMB (Hedged): thesaurierend | CNH 60 | CNH 66 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | CNH 92,04 | CNH 101,42 | k. A. |
| Institutional SGD (Hedged): thesaurierend | SGD 56.625 | SGD 46.472 | SGD 2.335 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.723 | 4.222 | 218 |
| NIW je Anteil | SGD 9,89 | SGD 11,01 | SGD 10,73 |
| Erträge | SGD 222.933 | SGD 277.493 | SGD 271.784 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 23.369 | 25.607 | 24.806 |
| NIW je Anteil | SGD 9,54 | SGD 10,84 | SGD 10,96 |
| Investor: thesaurierend | $ 2.161.847 | $ 2.841.494 | $ 2.037.337 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 172.899 | 203.964 | 149.476 |
| NIW je Anteil | $ 12,50 | $ 13,93 | $ 13,63 |
| Erträge | $ 1.378.811 | $ 1.709.869 | $ 1.314.008 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 147.572 | 160.791 | 121.625 |
| NIW je Anteil | $ 9,34 | $ 10,63 | $ 10,80 |
| Investor AUD (Hedged): Erträge | AUD 56.602 | AUD 73.714 | AUD 52.351 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.463 | 7.348 | 5.112 |
| NIW je Anteil | AUD 8,76 | AUD 10,03 | AUD 10,24 |
| Investor EUR (Hedged): thesaurierend | € 194.991 | € 508.040 | € 1.450.102 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 18.266 | 42.352 | 122.489 |
| NIW je Anteil | € 10,67 | € 12,00 | € 11,84 |
| Erträge | € 75.059 | € 105.743 | € 60.870 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.508 | 11.634 | 6.496 |
| NIW je Anteil | € 7,89 | € 9,09 | € 9,37 |
| ausschüttend A | € 31.656 | € 37.920 | € 40.130 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.801 | 4.052 | 4.156 |
| NIW je Anteil | € 8,33 | € 9,36 | € 9,66 |
| Investor GBP (Hedged): Erträge | £ 16.696 | £ 9.219 | £ 3.920 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.933 | 935 | 390 |
| NIW je Anteil | £ 8,64 | £ 9,86 | £ 10,04 |
| Investor RMB (Hedged): thesaurierend | CNH 94.180 | CNH 124.077 | CNH 252.069 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 832 | 994 | 2.117 |
| NIW je Anteil | CNH 113,15 | CNH 124,87 | CNH 119,09 |
| Investor SGD (Hedged): thesaurierend | SGD 2.103 | SGD 1.979 | SGD 127 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 219 | 185 | 12 |
| NIW je Anteil | SGD 9,60 | SGD 10,70 | SGD 10,47 |

| | Zum 30. Juni 2022 | | Zum 31. Dez. 2021 | | Zum 31. Dez. 2020 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Income Fund (Forts.) | | | | | |
| Erträge | SGD | 48.059 | SGD | 67.208 | SGD | 37.559 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 5.380 | | 6.605 | | 3.630 |
| NIW je Anteil | SGD | 8,93 | SGD | 10,18 | SGD | 10,35 |
| Administrative: thesaurierend | $ | 771.294 | $ | 912.059 | $ | 631.493 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 69.575 | | 73.786 | | 52.139 |
| NIW je Anteil | $ | 11,09 | $ | 12,36 | $ | 12,11 |
| Erträge | $ | 3.024.315 | $ | 3.699.459 | $ | 3.418.694 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 302.798 | | 325.103 | | 295.096 |
| NIW je Anteil | $ | 9,99 | $ | 11,38 | $ | 11,59 |
| Administrative AUD (Hedged): Erträge | AUD | 273.620 | AUD | 316.049 | AUD | 355.413 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 30.432 | | 30.677 | | 33.782 |
| NIW je Anteil | AUD | 8,99 | AUD | 10,30 | AUD | 10,52 |
| Administrative EUR (Hedged): thesaurierend | € | 40.645 | € | 193.792 | € | 242.607 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.829 | | 16.228 | | 20.554 |
| NIW je Anteil | € | 10,62 | € | 11,94 | € | 11,80 |
| Erträge | € | 263.702 | € | 308.049 | € | 331.791 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 32.888 | | 33.362 | | 34.844 |
| NIW je Anteil | € | 8,02 | € | 9,23 | € | 9,52 |
| Administrative GBP (Hedged): Erträge | £ | 105.993 | £ | 140.149 | £ | 139.212 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 12.685 | | 14.660 | | 14.220 |
| NIW je Anteil | £ | 8,36 | £ | 9,56 | £ | 9,79 |
| Administrative HKD (Unhedged): Erträge | HKD | 3.215.703 | HKD | 4.681.912 | HKD | 3.245.289 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 360.486 | | 463.488 | | 316.993 |
| NIW je Anteil | HKD | 8,92 | HKD | 10,10 | HKD | 10,24 |
| Administrative JPY (Hedged): thesaurierend | ¥ | 2.348 | ¥ | 1.099 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3 | | 1 | | k. A. |
| NIW je Anteil | ¥ | 891,00 | ¥ | 999,00 | | k. A. |
| Administrative SGD (Hedged): Erträge | SGD | 874.114 | SGD | 1.080.475 | SGD | 1.038.592 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 88.655 | | 96.129 | | 90.748 |
| NIW je Anteil | SGD | 9,86 | SGD | 11,24 | SGD | 11,44 |
| Class E: thesaurierend | $ | 4.874.465 | $ | 6.088.898 | $ | 5.774.107 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 345.723 | | 386.539 | | 372.607 |
| NIW je Anteil | $ | 14,10 | $ | 15,75 | $ | 15,50 |
| Erträge | $ | 6.795.938 | $ | 8.765.914 | $ | 7.968.268 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 712.275 | | 804.221 | | 714.149 |
| NIW je Anteil | $ | 9,54 | $ | 10,90 | $ | 11,16 |
| Ausschüttend Q | $ | 1.861 | $ | 2.029 | $ | 1.841 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 213 | | 203 | | 180 |
| NIW je Anteil | $ | 8,74 | $ | 10,01 | $ | 10,24 |
| Class E AUD (Hedged): Erträge | AUD | 577.739 | AUD | 699.187 | AUD | 688.828 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 68.314 | | 71.928 | | 68.955 |
| NIW je Anteil | AUD | 8,46 | AUD | 9,72 | AUD | 9,99 |

| | Zum 30. Juni 2022 | | Zum 31. Dez. 2021 | | Zum 31. Dez. 2020 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Income Fund (Forts.) | | | | | |
| Class E CHF (Hedged): thesaurierend | CHF | 82.004 | CHF | 101.113 | CHF | 98.769 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 7.734 | | 8.472 | | 8.323 |
| NIW je Anteil | CHF | 10,60 | CHF | 11,93 | CHF | 11,87 |
| Erträge | CHF | 83.168 | CHF | 117.164 | CHF | 141.703 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 11.254 | | 13.731 | | 15.949 |
| NIW je Anteil | CHF | 7,39 | CHF | 8,53 | CHF | 8,88 |
| Class E EUR (Hedged): thesaurierend | € | 4.225.581 | € | 5.062.678 | € | 4.783.315 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 343.184 | | 364.865 | | 347.362 |
| NIW je Anteil | € | 12,31 | € | 13,88 | € | 13,77 |
| Erträge | € | 3.437.416 | € | 4.359.865 | € | 4.900.988 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 421.677 | | 462.802 | | 500.834 |
| NIW je Anteil | € | 8,15 | € | 9,42 | € | 9,79 |
| ausschüttend II | € | 108.774 | € | 125.779 | € | 128.995 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 12.132 | | 12.308 | | 12.476 |
| NIW je Anteil | € | 8,97 | € | 10,22 | € | 10,34 |
| Ausschüttend II Q | € | 42.747 | € | 52.706 | € | 35.195 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 4.825 | | 5.208 | | 3.436 |
| NIW je Anteil | € | 8,86 | € | 10,12 | € | 10,24 |
| Class E GBP (Hedged): Erträge | £ | 191.501 | £ | 236.936 | £ | 254.166 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 23.697 | | 25.560 | | 26.639 |
| NIW je Anteil | £ | 8,08 | £ | 9,27 | £ | 9,54 |
| Class E HKD (Unhedged): Erträge | HKD | 3.526.107 | HKD | 4.704.540 | HKD | 5.569.457 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 390.611 | | 459.225 | | 534.050 |
| NIW je Anteil | HKD | 9,03 | HKD | 10,24 | HKD | 10,43 |
| Class E JPY (Hedged): thesaurierend | ¥ | 806.018 | ¥ | 743.601 | ¥ | 2.647.085 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 843 | | 692 | | 2.495 |
| NIW je Anteil | ¥ | 957,00 | ¥ | 1.075,00 | ¥ | 1.061,00 |
| Class E RMB (Hedged): Erträge | CNH | 484.488 | CNH | 671.398 | CNH | 593.183 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 4.391 | | 5.397 | | 4.815 |
| NIW je Anteil | CNH | 110,33 | CNH | 124,39 | CNH | 123,20 |
| Class E SGD (Hedged): Erträge | SGD | 2.212.571 | SGD | 2.784.269 | SGD | 2.701.956 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 252.939 | | 278.445 | | 263.912 |
| NIW je Anteil | SGD | 8,75 | SGD | 10,00 | SGD | 10,24 |
| G Retail EUR (Hedged): Erträge | € | 20.866 | € | 29.724 | € | 35.845 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.581 | | 3.263 | | 3.801 |
| NIW je Anteil | € | 8,08 | € | 9,11 | € | 9,43 |
| G Retail EUR (Unhedged): Erträge | € | 97 | € | 518 | € | 275 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 10 | | 51 | | 29 |
| NIW je Anteil | € | 9,85 | € | 10,11 | € | 9,55 |
| H Institutional: thesaurierend | $ | 644.945 | $ | 770.236 | $ | 562.857 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 59.946 | | 64.313 | | 48.123 |
| NIW je Anteil | $ | 10,76 | $ | 11,98 | $ | 11,70 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | **Income Fund (Forts.)** | | |
| Erträge | $ 295.837 | $ 333.808 | $ 299.508 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 32.339 | 32.084 | 28.375 |
| NIW je Anteil | $ 9,15 | $ 10,40 | $ 10,56 |
| H Institutional EUR (Hedged): thesaurierend | € 2.508 | € 8.530 | € 2.672 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 255 | 772 | 245 |
| NIW je Anteil | € 9,84 | € 11,05 | € 10,89 |
| Class R: thesaurierend | $ 72.496 | $ 70.929 | $ 31.223 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.308 | 6.420 | 2.892 |
| NIW je Anteil | $ 9,92 | $ 11,05 | $ 10,80 |
| Erträge | $ 63.784 | $ 84.900 | $ 70.869 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.908 | 8.082 | 6.645 |
| NIW je Anteil | $ 9,23 | $ 10,50 | $ 10,66 |
| Class R EUR (Hedged): Erträge | € 12.047 | € 16.112 | € 14.929 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.441 | 1.678 | 1.514 |
| NIW je Anteil | € 8,36 | € 9,60 | € 9,86 |
| Class R GBP (Hedged): Erträge | £ 31.751 | £ 33.995 | £ 31.954 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.331 | 3.123 | 2.878 |
| NIW je Anteil | £ 9,53 | £ 10,88 | £ 11,10 |
| Class T: thesaurierend | $ 304.887 | $ 371.744 | $ 359.667 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 26.290 | 28.634 | 28.049 |
| NIW je Anteil | $ 11,60 | $ 12,98 | $ 12,82 |
| Erträge | $ 106.181 | $ 130.671 | $ 131.492 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 12.604 | 13.542 | 13.244 |
| NIW je Anteil | $ 8,42 | $ 9,65 | $ 9,93 |
| Class T EUR (Hedged): thesaurierend | € 223.580 | € 268.086 | € 280.339 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 21.945 | 23.304 | 24.457 |
| NIW je Anteil | € 10,19 | € 11,50 | € 11,46 |
| Erträge | € 170.517 | € 217.088 | € 252.475 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 23.563 | 25.890 | 28.837 |
| NIW je Anteil | € 7,24 | € 8,38 | € 8,76 |
| Class Z: thesaurierend | $ 146.764 | $ 162.794 | $ 110.891 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.076 | 9.076 | 6.376 |
| NIW je Anteil | $ 16,17 | $ 17,94 | $ 17,39 |
| Class Z AUD (Hedged): ausschüttend II | AUD 1.272.995 | AUD 1.451.394 | AUD 1.115.008 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 128.885 | 129.096 | 98.412 |
| NIW je Anteil | AUD 9,88 | AUD 11,24 | AUD 11,33 |
| | **Income Fund II** | | |
| Nettovermögen | $ 32.077 | $ 27.770 | k. A. |
| Institutional: thesaurierend | $ 21.991 | $ 24.374 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.397 | 2.396 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,17 | $ 10,17 | k. A. |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | **Income Fund II (Forts.)** | | |
| Erträge | $ 9 | $ 10 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 8,80 | $ 9,94 | k. A. |
| Class E: Erträge | $ 4.006 | $ 1.730 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 458 | 174 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 8,74 | $ 9,92 | k. A. |
| Class E AUD (Hedged): Erträge | AUD 399 | AUD 365 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 46 | 37 | k. A. |
| NIW je Anteil | AUD 8,67 | AUD 9,90 | k. A. |
| Class E EUR (Hedged): Erträge | € 782 | € 494 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 91 | 50 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 8,60 | € 9,85 | k. A. |
| Class E GBP (Hedged): Erträge | £ 522 | £ 196 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 60 | 20 | k. A. |
| NIW je Anteil | £ 8,70 | £ 9,90 | k. A. |
| Class E HKD (Unhedged): Erträge | HKD 32.410 | HKD 2.462 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.665 | 247 | k. A. |
| NIW je Anteil | HKD 8,84 | HKD 9,98 | k. A. |
| Class E SGD (Hedged): Erträge | SGD 299 | SGD 333 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 34 | 34 | k. A. |
| NIW je Anteil | SGD 8,74 | SGD 9,93 | k. A. |
| | **Inflation Multi-Asset Fund** | | |
| Nettovermögen | $ 471.181 | $ 164.345 | $ 70.032 |
| Institutional: thesaurierend | $ 65.349 | $ 68.012 | $ 55.509 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.733 | 5.798 | 5.263 |
| NIW je Anteil | $ 11,40 | $ 11,73 | $ 10,55 |
| Institutional EUR (Partially Hedged): thesaurierend | € 90.259 | € 4.749 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.178 | 477 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,83 | € 9,96 | k. A. |
| Institutional GBP (Partially Hedged): thesaurierend | £ 41.807 | £ 22.843 | £ 2.213 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.530 | 1.924 | 207 |
| NIW je Anteil | £ 11,84 | £ 11,87 | £ 10,68 |
| Administrative: ausschüttend II | $ 2.434 | k. A. | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 265 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,18 | k. A. | k. A. |
| Administrative SGD (Hedged): ausschüttend II | SGD 10.511 | k. A. | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.107 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | SGD 9,49 | k. A. | k. A. |
| Class E: thesaurierend | $ 96.693 | $ 14.809 | $ 2.620 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.492 | 1.405 | 273 |
| NIW je Anteil | $ 10,19 | $ 10,54 | $ 9,59 |
| Class E EUR (Partially Hedged): thesaurierend | € 134.896 | € 33.996 | € 6.072 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 13.887 | 3.436 | 683 |
| NIW je Anteil | € 9,71 | € 9,89 | € 8,89 |
| Erträge | € 12.426 | € 5.738 | € 1.185 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.361 | 608 | 137 |
| NIW je Anteil | € 9,13 | € 9,43 | € 8,62 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | **Low Average Duration Fund** | | |
| Nettovermögen | $ 1.579.274 | $ 1.179.138 | $ 1.183.413 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 625.170 | $ 747.732 | $ 806.772 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 39.733 | 45.606 | 48.799 |
| NIW je Anteil | $ 15,73 | $ 16,40 | $ 16,53 |
| Erträge | $ 40.018 | $ 33.312 | $ 37.437 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.977 | 3.159 | 3.500 |
| NIW je Anteil | $ 10,06 | $ 10,54 | $ 10,70 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 34.768 | € 35.456 | € 35.471 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.500 | 3.402 | 3.347 |
| NIW je Anteil | € 9,93 | € 10,42 | € 10,60 |
| Erträge | € 8.820 | € 10.023 | € 8.988 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.209 | 1.302 | 1.141 |
| NIW je Anteil | € 7,30 | € 7,70 | € 7,88 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 16.187 | £ 13.877 | £ 6.460 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.638 | 1.347 | 621 |
| NIW je Anteil | £ 9,88 | £ 10,30 | £ 10,40 |
| Erträge | £ 3.579 | £ 4.225 | £ 11.174 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 391 | 439 | 1.141 |
| NIW je Anteil | £ 9,15 | £ 9,64 | £ 9,79 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 18.372 | $ 20.960 | $ 30.355 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.243 | 1.359 | 1.945 |
| NIW je Anteil | $ 14,78 | $ 15,42 | $ 15,61 |
| Erträge | $ 7.389 | $ 7.973 | $ 9.569 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 740 | 762 | 902 |
| NIW je Anteil | $ 9,98 | $ 10,46 | $ 10,61 |
| Administrative: | | | |
| thesaurierend | $ 11.604 | $ 11.016 | $ 15.464 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 806 | 733 | 1.014 |
| NIW je Anteil | $ 14,40 | $ 15,04 | $ 15,24 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 99.575 | $ 52.498 | $ 81.937 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.148 | 4.104 | 6.297 |
| NIW je Anteil | $ 12,22 | $ 12,79 | $ 13,01 |
| Erträge | $ 5.644 | $ 6.751 | $ 13.842 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 544 | 621 | 1.251 |
| NIW je Anteil | $ 10,38 | $ 10,87 | $ 11,06 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 17.903 | € 18.812 | € 19.638 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.215 | 2.209 | 2.247 |
| NIW je Anteil | € 8,08 | € 8,52 | € 8,74 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 672.138 | $ 186.367 | $ 72.717 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 56.826 | 15.108 | 5.837 |
| NIW je Anteil | $ 11,83 | $ 12,34 | $ 12,46 |
| Erträge | $ 4.067 | $ 7.574 | $ 6.978 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 419 | 745 | 677 |
| NIW je Anteil | $ 9,70 | $ 10,16 | $ 10,31 |
| Class R: | | | |
| thesaurierend | $ 7.006 | $ 7.325 | $ 5.812 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 664 | 665 | 522 |
| NIW je Anteil | $ 10,56 | $ 11,02 | $ 11,14 |
| | **Low Duration Global Investment Grade Credit Fund** | | |
| Nettovermögen | $ 678.536 | $ 806.869 | $ 632.519 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 121.228 | $ 94.445 | $ 92.260 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 10.643 | 7.805 | 7.572 |
| NIW je Anteil | $ 11,39 | $ 12,10 | $ 12,18 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | **Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)** | | |
| Erträge | $ 16.919 | $ 10 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.842 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,19 | $ 9,82 | k. A. |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 429.108 | € 520.319 | € 358.476 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 42.670 | 48.370 | 32.815 |
| NIW je Anteil | € 10,06 | € 10,76 | € 10,92 |
| Erträge | € 655 | € 928 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 72 | 95 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,06 | € 9,75 | k. A. |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 17.985 | £ 18.462 | £ 20.287 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.669 | 1.611 | 1.754 |
| NIW je Anteil | £ 10,78 | £ 11,46 | £ 11,57 |
| Erträge | £ 10.389 | £ 18.096 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.136 | 1.849 | k. A. |
| NIW je Anteil | £ 9,15 | £ 9,79 | k. A. |
| Institutional NOK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | NOK 417.233 | NOK 441.039 | NOK 416.606 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.139 | 4.119 | 3.864 |
| NIW je Anteil | NOK 100,81 | NOK 107,06 | NOK 107,82 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 13.777 | € 17.694 | € 20.641 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.478 | 1.767 | 2.011 |
| NIW je Anteil | € 9,32 | € 10,01 | € 10,26 |
| | **Low Duration Income Fund** | | |
| Nettovermögen | $ 1.030.520 | $ 1.367.475 | $ 960.639 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 172.618 | $ 275.963 | $ 6.730 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 16.356 | 24.381 | 607 |
| NIW je Anteil | $ 10,55 | $ 11,32 | $ 11,08 |
| Erträge | $ 13.424 | $ 13.398 | $ 2.025 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.421 | 1.305 | 196 |
| NIW je Anteil | $ 9,45 | $ 10,27 | $ 10,31 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 529 | CHF 1.854 | CHF 401 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 55 | 178 | 39 |
| NIW je Anteil | CHF 9,65 | CHF 10,43 | CHF 10,32 |
| Erträge | k. A. | k. A. | CHF 10 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | CHF 9,58 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 608.224 | € 666.067 | € 605.043 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 62.332 | 63.153 | 58.084 |
| NIW je Anteil | € 9,76 | € 10,55 | € 10,42 |
| Erträge | € 8 | € 60.301 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 6.036 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,16 | € 9,99 | k. A. |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 3.198 | £ 5.158 | £ 150.468 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 316 | 475 | 14.121 |
| NIW je Anteil | £ 10,10 | £ 10,85 | £ 10,66 |
| Erträge | £ 75.452 | £ 130.935 | £ 8 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.393 | 13.372 | 1 |
| NIW je Anteil | £ 8,99 | £ 9,79 | £ 9,86 |
| Institutional SGD (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SGD 14.858 | SGD 19.822 | SGD 589 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.513 | 1.883 | 57 |
| NIW je Anteil | SGD 9,82 | SGD 10,53 | SGD 10,30 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | **Low Duration Income Fund (Forts.)** | | |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | € 639 | € 9 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 61 | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 10,41 | € 10,32 |
| Erträge | k. A. | € 452 | € 9 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 48 | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 9,46 | € 9,62 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 23.077 | $ 16.491 | $ 1.386 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.263 | 1.502 | 128 |
| NIW je Anteil | $ 10,20 | $ 10,98 | $ 10,85 |
| Erträge | $ 7.540 | $ 9.075 | $ 1.034 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 820 | 904 | 102 |
| NIW je Anteil | $ 9,19 | $ 10,04 | $ 10,17 |
| Class E CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | k. A. | CHF 10 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | CHF 10,10 |
| Erträge | k. A. | k. A. | CHF 10 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | CHF 9,46 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 25.312 | € 16.611 | € 1.334 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.688 | 1.625 | 131 |
| NIW je Anteil | € 9,42 | € 10,22 | € 10,18 |
| Erträge | € 1.587 | € 1.014 | € 265 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 187 | 109 | 28 |
| NIW je Anteil | € 8,48 | € 9,34 | € 9,55 |
| Class E SGD (Hedged): | | | |
| Erträge | SGD 665 | SGD 721 | SGD 712 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 73 | 73 | 71 |
| NIW je Anteil | SGD 9,06 | SGD 9,90 | SGD 10,02 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 41.135 | $ 3.622 | $ 10 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.193 | 344 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 9,81 | $ 10,53 | $ 10,33 |
| Erträge | $ 1.500 | k. A. | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 162 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,25 | k. A. | k. A. |
| Class Z EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 9 | € 10 | € 10 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | € 10,00 | € 10,79 | € 10,59 |
| | **Low Duration Opportunities Fund** | | |
| Nettovermögen | $ 3.021.321 | $ 3.217.260 | $ 2.644.601 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 226.129 | $ 142.348 | $ 96.148 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 20.375 | 12.027 | 8.110 |
| NIW je Anteil | $ 11,10 | $ 11,84 | $ 11,86 |
| Erträge | $ 35.075 | $ 41.508 | $ 8.606 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.672 | 4.051 | 830 |
| NIW je Anteil | $ 9,55 | $ 10,25 | $ 10,37 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 45.493 | € 41.652 | € 54.549 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.622 | 3.940 | 5.108 |
| NIW je Anteil | € 9,84 | € 10,57 | € 10,68 |
| Erträge | € 10.953 | € 12.374 | € 27.239 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.241 | 1.297 | 2.796 |
| NIW je Anteil | € 8,83 | € 9,54 | € 9,74 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | **Low Duration Opportunities Fund (Forts.)** | | |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 1.815.884 | £ 1.734.093 | £ 1.417.923 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 173.795 | 155.485 | 126.639 |
| NIW je Anteil | £ 10,45 | £ 11,15 | £ 11,20 |
| Erträge | £ 399.939 | £ 447.455 | £ 352.374 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 43.019 | 44.752 | 34.734 |
| NIW je Anteil | £ 9,30 | £ 10,00 | £ 10,14 |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 4.892 | € 8.109 | € 10.572 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 523 | 806 | 1.036 |
| NIW je Anteil | € 9,35 | € 10,06 | € 10,20 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 3.287 | € 4.360 | € 5.666 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 360 | 443 | 566 |
| NIW je Anteil | € 9,13 | € 9,84 | € 10,01 |
| Class Z: | | | |
| thesaurierend | $ 1.549 | $ 2.989 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 166 | 301 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,33 | $ 9,93 | k. A. |
| | **PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund** | | |
| Nettovermögen | $ 121.089 | $ 100.538 | $ 77.631 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 28.762 | $ 21.487 | $ 22.753 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.227 | 2.658 | 4.069 |
| NIW je Anteil | $ 8,91 | $ 8,08 | $ 5,59 |
| Erträge | $ 9.451 | $ 29.680 | $ 30.040 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.685 | 5.697 | 7.885 |
| NIW je Anteil | $ 5,61 | $ 5,21 | $ 3,81 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 41.244 | € 19.141 | € 7.987 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.349 | 2.714 | 1.623 |
| NIW je Anteil | € 7,71 | € 7,05 | € 4,92 |
| Erträge | € 3.470 | € 2.062 | € 1.546 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 716 | 455 | 461 |
| NIW je Anteil | € 4,85 | € 4,54 | € 3,36 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 1.343 | £ 1.362 | £ 961 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 173 | 193 | 195 |
| NIW je Anteil | £ 7,78 | £ 7,07 | £ 4,93 |
| Erträge | k. A. | £ 25 | £ 101 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 5 | 30 |
| NIW je Anteil | k. A. | £ 4,51 | £ 3,34 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | k. A. | $ 1.183 | $ 1.179 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 117 | 168 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 10,09 | $ 7,00 |
| Erträge | k. A. | k. A. | $ 7 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | $ 5,76 |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | k. A. | € 24 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 4 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 6,55 |
| Class E: | | | |
| Erträge | $ 21.993 | $ 10.905 | $ 4.830 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.304 | 2.287 | 1.368 |
| NIW je Anteil | $ 5,11 | $ 4,77 | $ 3,53 |
| Class Z: | | | |
| thesaurierend | $ 12.505 | $ 11.293 | $ 5.677 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.113 | 1.113 | 818 |
| NIW je Anteil | $ 11,23 | $ 10,14 | $ 6,94 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | Mortgage Opportunities Fund | | |
| Nettovermögen | $ 1.597.381 | $ 2.238.424 | $ 1.977.007 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 517.295 | $ 558.563 | $ 491.609 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 47.247 | 47.581 | 42.776 |
| NIW je Anteil | $ 10,95 | $ 11,74 | $ 11,49 |
| Erträge | $ 165.718 | $ 351.769 | $ 285.533 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 18.127 | 35.231 | 28.386 |
| NIW je Anteil | $ 9,14 | $ 9,98 | $ 10,06 |
| Institutional CAD (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CAD 23.939 | CAD 25.659 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.532 | 2.532 | k. A. |
| NIW je Anteil | CAD 9,46 | CAD 10,14 | k. A. |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 3.646 | CHF 5.577 | CHF 6.951 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 376 | 532 | 670 |
| NIW je Anteil | CHF 9,69 | CHF 10,47 | CHF 10,37 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 294.179 | € 317.357 | € 330.507 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 29.782 | 29.769 | 31.397 |
| NIW je Anteil | € 9,88 | € 10,66 | € 10,53 |
| Erträge | € 17.476 | € 26.722 | € 9.571 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.123 | 2.953 | 1.041 |
| NIW je Anteil | € 8,23 | € 9,05 | € 9,20 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 376.267 | £ 19.288 | £ 7.971 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 36.266 | 1.733 | 730 |
| NIW je Anteil | £ 10,38 | £ 11,13 | £ 10,92 |
| Erträge | £ 8.152 | £ 5.764 | £ 11.380 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 942 | 609 | 1.192 |
| NIW je Anteil | £ 8,65 | £ 9,46 | £ 9,55 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 22.028 | $ 32.611 | $ 49.987 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.093 | 2.885 | 4.499 |
| NIW je Anteil | $ 10,52 | $ 11,30 | $ 11,11 |
| Erträge | $ 4.764 | $ 19.104 | $ 12.072 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 521 | 1.914 | 1.200 |
| NIW je Anteil | $ 9,14 | $ 9,98 | $ 10,06 |
| Administrative: | | | |
| Erträge | $ 46 | $ 540 | $ 544 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 5 | 54 | 54 |
| NIW je Anteil | $ 9,14 | $ 9,98 | $ 10,06 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 50.001 | $ 58.797 | $ 65.293 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.792 | 5.232 | 5.878 |
| NIW je Anteil | $ 10,43 | $ 11,24 | $ 11,11 |
| Erträge | $ 5.535 | $ 10.154 | $ 10.765 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 605 | 1.017 | 1.070 |
| NIW je Anteil | $ 9,15 | $ 9,99 | $ 10,06 |
| Class E CHF (Hedged): | | | |
| Erträge | CHF 177 | CHF 319 | CHF 338 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 22 | 36 | 38 |
| NIW je Anteil | CHF 8,02 | CHF 8,82 | CHF 8,98 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 15.272 | € 16.220 | € 18.176 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.624 | 1.591 | 1.788 |
| NIW je Anteil | € 9,41 | € 10,20 | € 10,16 |
| Erträge | k. A. | € 151 | € 131 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 17 | 14 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 8,98 | € 9,13 |
| Class E SGD (Hedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | k. A. | SGD 15 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | SGD 10,63 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | Mortgage Opportunities Fund (Forts.) | | |
| Erträge | SGD 1.020 | SGD 1.645 | SGD 2.135 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 114 | 168 | 217 |
| NIW je Anteil | SGD 8,96 | SGD 9,78 | SGD 9,85 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 66 | $ 71 | $ 11 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 7 | 7 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 10,09 | $ 10,83 | $ 10,62 |
| Class Z: | | | |
| thesaurierend | k. A. | $ 214.716 | $ 74.635 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 19.628 | 7.012 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 10,94 | $ 10,64 |
| Class Z GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | £ 384.109 | £ 374.361 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 34.658 | 34.658 |
| NIW je Anteil | k. A. | £ 11,08 | £ 10,80 |
| | StocksPLUS™ Fund | | |
| Nettovermögen | $ 1.610.510 | $ 3.761.156 | $ 3.538.833 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 921.267 | $ 2.349.757 | $ 2.530.233 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 19.828 | 39.164 | 53.956 |
| NIW je Anteil | $ 46,47 | $ 60,00 | $ 46,89 |
| Erträge | $ 26.060 | $ 39.901 | $ 45.032 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 771 | 913 | 1.319 |
| NIW je Anteil | $ 33,79 | $ 43,69 | $ 34,14 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 374.368 | € 570.050 | € 530.048 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 13.969 | 16.237 | 19.143 |
| NIW je Anteil | € 26,80 | € 35,11 | € 27,69 |
| Erträge | k. A. | € 2.081 | € 1.636 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 68 | 68 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 30,66 | € 24,18 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 3.986 | £ 199 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 461 | 18 | k. A. |
| NIW je Anteil | £ 8,65 | £ 11,28 | k. A. |
| Institutional SGD (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SGD 299 | k. A. | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 34 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | SGD 8,72 | k. A. | k. A. |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 16.045 | $ 21.609 | $ 18.615 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 374 | 389 | 428 |
| NIW je Anteil | $ 42,91 | $ 55,51 | $ 43,53 |
| BE Retail: | | | |
| thesaurierend | $ 9 | k. A. | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 8,67 | k. A. | k. A. |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 159.491 | $ 175.651 | $ 91.242 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.951 | 3.355 | 2.210 |
| NIW je Anteil | $ 40,36 | $ 52,35 | $ 41,29 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 55.025 | € 13.927 | € 9.527 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.042 | 777 | 668 |
| NIW je Anteil | € 13,61 | € 17,91 | € 14,25 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 33.672 | $ 504.831 | $ 189.133 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.899 | 33.635 | 16.101 |
| NIW je Anteil | $ 11,62 | $ 15,01 | $ 11,75 |
| Class T: | | | |
| thesaurierend | k. A. | $ 2.673 | $ 2.380 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 124 | 140 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 21,50 | $ 17,03 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | **PIMCO StocksPLUS® AR Fund** | | |
| Nettovermögen | $ 9.772 | $ 11.610 | $ 8.417 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 9.222 | $ 10.848 | $ 8.021 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 667 | 603 | 570 |
| NIW je Anteil | $ 13,84 | $ 17,97 | $ 14,09 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 333 | € 405 | € 312 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 26 | 24 | 23 |
| NIW je Anteil | € 12,96 | € 17,09 | € 13,52 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 167 | £ 198 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 19 | 18 | k. A. |
| NIW je Anteil | £ 8,57 | £ 11,24 | k. A. |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | k. A. | $ 34 | $ 14 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 2 | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 17,53 | $ 13,87 |
| | **Strategic Income Fund** | | |
| Nettovermögen | $ 528.844 | $ 619.928 | $ 974.664 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 26.352 | $ 33.080 | $ 35.112 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.411 | 2.754 | 3.118 |
| NIW je Anteil | $ 10,93 | $ 12,01 | $ 11,26 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 179.430 | € 207.426 | € 453.622 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 14.194 | 14.906 | 34.652 |
| NIW je Anteil | € 12,64 | € 13,92 | € 13,09 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 38.605 | $ 35.991 | $ 33.128 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.972 | 2.509 | 2.441 |
| NIW je Anteil | $ 12,99 | $ 14,34 | $ 13,57 |
| ausschüttend II | $ 18.544 | $ 18.959 | $ 18.919 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.022 | 1.828 | 1.848 |
| NIW je Anteil | $ 9,17 | $ 10,37 | $ 10,24 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 144.664 | € 140.034 | € 143.937 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 12.379 | 10.837 | 11.731 |
| NIW je Anteil | € 11,69 | € 12,92 | € 12,27 |
| ausschüttend II | € 79.004 | € 94.373 | € 102.667 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.584 | 10.105 | 11.093 |
| NIW je Anteil | € 8,24 | € 9,34 | € 9,25 |
| Class T EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 15.971 | € 17.708 | € 17.321 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.528 | 1.529 | 1.569 |
| NIW je Anteil | € 10,45 | € 11,58 | € 11,04 |
| Erträge | € 6.914 | € 8.185 | € 7.803 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 774 | 817 | 800 |
| NIW je Anteil | € 8,93 | € 10,02 | € 9,76 |
| | **Total Return Bond Fund** | | |
| Nettovermögen | $ 4.064.420 | $ 4.944.898 | $ 6.424.053 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 1.362.277 | $ 1.598.195 | $ 1.930.542 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 45.733 | 46.882 | 55.944 |
| NIW je Anteil | $ 29,79 | $ 34,09 | $ 34,51 |
| Erträge | $ 121.872 | $ 174.533 | $ 187.163 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.946 | 9.829 | 10.216 |
| NIW je Anteil | $ 15,34 | $ 17,76 | $ 18,32 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | **Total Return Bond Fund (Forts.)** | | |
| Institutional CAD (Hedged): | | | |
| Erträge | CAD 21.071 | CAD 26.323 | CAD 26.735 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.356 | 2.540 | 2.497 |
| NIW je Anteil | CAD 8,94 | CAD 10,36 | CAD 10,70 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 8.418 | CHF 13.206 | CHF 16.880 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 818 | 1.111 | 1.388 |
| NIW je Anteil | CHF 10,30 | CHF 11,88 | CHF 12,16 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 305.481 | € 358.693 | € 495.828 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 15.081 | 15.344 | 20.771 |
| NIW je Anteil | € 20,26 | € 23,38 | € 23,87 |
| Erträge | € 222.453 | € 260.110 | € 216.306 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 17.904 | 17.931 | 14.322 |
| NIW je Anteil | € 12,42 | € 14,51 | € 15,10 |
| Institutional EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 20.376 | € 14.618 | € 33.888 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 715 | 488 | 1.202 |
| NIW je Anteil | € 28,49 | € 29,97 | € 28,20 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 2.818 | £ 5.534 | £ 9.730 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 222 | 379 | 658 |
| NIW je Anteil | £ 12,71 | £ 14,59 | £ 14,80 |
| Erträge | £ 36.738 | £ 43.763 | £ 39.302 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.257 | 4.355 | 3.783 |
| NIW je Anteil | £ 8,63 | £ 10,05 | £ 10,39 |
| Institutional ILS (Hedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | ILS 185 | ILS 578 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 13 | 39 |
| NIW je Anteil | k. A. | ILS 14,41 | ILS 14,67 |
| Institutional SGD (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SGD 18.735 | SGD 21.940 | SGD 19.222 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.489 | 1.524 | 1.320 |
| NIW je Anteil | SGD 12,58 | SGD 14,40 | SGD 14,57 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 368.072 | $ 369.122 | $ 573.009 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 13.432 | 11.750 | 17.957 |
| NIW je Anteil | $ 27,40 | $ 31,41 | $ 31,91 |
| Erträge | $ 53.311 | $ 35.775 | $ 129.625 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.427 | 1.987 | 6.977 |
| NIW je Anteil | $ 15,56 | $ 18,01 | $ 18,58 |
| Investor CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 3.684 | CHF 4.784 | CHF 6.265 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 372 | 417 | 532 |
| NIW je Anteil | CHF 9,91 | CHF 11,46 | CHF 11,77 |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 21.140 | € 19.262 | € 27.120 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.109 | 874 | 1.201 |
| NIW je Anteil | € 19,06 | € 22,03 | € 22,58 |
| Administrative: | | | |
| thesaurierend | $ 142.069 | $ 159.690 | $ 188.750 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.247 | 5.141 | 5.973 |
| NIW je Anteil | $ 27,08 | $ 31,06 | $ 31,60 |
| Administrative EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 2.929 | € 1.953 | € 3.742 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 257 | 148 | 277 |
| NIW je Anteil | € 11,38 | € 13,16 | € 13,51 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 390.934 | $ 478.210 | $ 676.175 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 15.193 | 16.167 | 22.380 |
| NIW je Anteil | $ 25,73 | $ 29,58 | $ 30,21 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | **Total Return Bond Fund (Forts.)** | | |
| Erträge | $ 162.098 | $ 199.962 | $ 243.049 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 13.887 | 14.801 | 17.436 |
| NIW je Anteil | $ 11,67 | $ 13,51 | $ 13,94 |
| Class E CHF (Hedged): thesaurierend | CHF 4.578 | CHF 5.648 | CHF 6.592 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 519 | 553 | 625 |
| NIW je Anteil | CHF 8,81 | CHF 10,22 | CHF 10,55 |
| Class E EUR (Hedged): thesaurierend | € 496.928 | € 623.265 | € 833.038 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 28.378 | 30.705 | 39.827 |
| NIW je Anteil | € 17,51 | € 20,30 | € 20,92 |
| Erträge | € 42.782 | € 54.687 | € 74.430 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.163 | 5.655 | 7.393 |
| NIW je Anteil | € 8,29 | € 9,67 | € 10,07 |
| Class E EUR (Unhedged): thesaurierend | € 698 | € 710 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 69 | 67 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,08 | € 10,65 | k. A. |
| Class E HKD (Unhedged): thesaurierend | HKD 1.654 | HKD 3.128 | HKD 2.773 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 157 | 259 | 226 |
| NIW je Anteil | HKD 10,57 | HKD 12,07 | HKD 12,26 |
| Class E SGD (Hedged): thesaurierend | SGD 32.130 | SGD 38.699 | SGD 42.772 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 853 | 894 | 968 |
| NIW je Anteil | SGD 37,66 | SGD 43,30 | SGD 44,20 |
| H Institutional: thesaurierend | $ 144.561 | $ 199.555 | $ 205.400 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.006 | 6.033 | 6.124 |
| NIW je Anteil | $ 28,88 | $ 33,08 | $ 33,54 |
| Erträge | $ 12.626 | $ 17.255 | $ 15.468 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.343 | 1.585 | 1.377 |
| NIW je Anteil | $ 9,40 | $ 10,89 | $ 11,23 |
| M Retail HKD (Unhedged): Erträge | HKD 79.373 | HKD 91.252 | HKD 96.768 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.552 | 8.552 | 8.838 |
| NIW je Anteil | HKD 9,28 | HKD 10,67 | HKD 10,95 |
| Class R EUR (Hedged): thesaurierend | € 3.775 | € 5.974 | € 5.521 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 391 | 535 | 483 |
| NIW je Anteil | € 9,66 | € 11,16 | € 11,43 |
| Class T: thesaurierend | $ 7.082 | $ 13.697 | $ 18.261 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 697 | 1.172 | 1.525 |
| NIW je Anteil | $ 10,15 | $ 11,69 | $ 11,97 |
| Class T EUR (Hedged): thesaurierend | € 3.385 | € 4.561 | € 6.041 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 377 | 437 | 560 |
| NIW je Anteil | € 8,99 | € 10,44 | € 10,79 |
| | **PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund** | | |
| Nettovermögen | $ 123.036 | $ 101.789 | $ 47.221 |
| Institutional: thesaurierend | $ 77.823 | $ 70.982 | $ 24.193 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.974 | 6.152 | 2.142 |
| NIW je Anteil | $ 13,02 | $ 11,54 | $ 11,30 |
| Institutional EUR (Hedged): thesaurierend | € 14.532 | € 11.436 | € 12.591 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.253 | 1.108 | 1.236 |
| NIW je Anteil | € 11,60 | € 10,32 | € 10,19 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | **PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)** | | |
| Class E: thesaurierend | $ 7.039 | $ 2.886 | $ 6.232 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 584 | 269 | 586 |
| NIW je Anteil | $ 12,06 | $ 10,74 | $ 10,63 |
| Class E EUR (Hedged): thesaurierend | € 7.879 | € 1.747 | € 1.136 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 734 | 182 | 118 |
| NIW je Anteil | € 10,74 | € 9,61 | € 9,60 |
| Class Z: thesaurierend | $ 14.744 | $ 12.929 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.304 | 1.299 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 11,31 | $ 9,95 | k. A. |
| | **UK Corporate Bond Fund** | | |
| Nettovermögen | £ 505.058 | £ 592.164 | £ 764.359 |
| Institutional: thesaurierend | £ 47.928 | £ 75.231 | £ 139.232 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.461 | 3.348 | 6.000 |
| NIW je Anteil | £ 19,48 | £ 22,47 | £ 23,20 |
| Erträge | £ 387.213 | £ 436.466 | £ 542.403 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 42.783 | 41.393 | 49.002 |
| NIW je Anteil | £ 9,05 | £ 10,54 | £ 11,07 |
| H Institutional: Erträge | k. A. | k. A. | £ 9 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | £ 10,28 |
| Class Z: thesaurierend | £ 69.917 | £ 80.467 | £ 82.715 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.715 | 7.715 | 7.715 |
| NIW je Anteil | £ 9,06 | £ 10,43 | £ 10,72 |
| | **UK Long Term Corporate Bond Fund** | | |
| Nettovermögen | £ 298.856 | £ 425.748 | £ 364.631 |
| Institutional: thesaurierend | £ 253.491 | £ 366.869 | £ 300.422 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.544 | 13.155 | 10.335 |
| NIW je Anteil | £ 21,96 | £ 27,89 | £ 29,07 |
| Erträge | £ 45.365 | £ 58.879 | £ 64.209 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.550 | 3.578 | 3.656 |
| NIW je Anteil | £ 12,78 | £ 16,45 | £ 17,56 |
| | **US High Yield Bond Fund** | | |
| Nettovermögen | $ 2.474.510 | $ 3.923.786 | $ 4.054.927 |
| Institutional: thesaurierend | $ 943.946 | $ 1.665.090 | $ 2.254.396 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 27.298 | 40.803 | 57.680 |
| NIW je Anteil | $ 34,58 | $ 40,81 | $ 39,09 |
| Erträge | $ 318.221 | $ 400.716 | $ 319.414 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 38.174 | 39.668 | 31.532 |
| NIW je Anteil | $ 8,34 | $ 10,10 | $ 10,13 |
| Institutional CHF (Hedged): thesaurierend | CHF 2.027 | CHF 2.738 | CHF 2.604 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 195 | 222 | 218 |
| NIW je Anteil | CHF 10,37 | CHF 12,33 | CHF 11,94 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | US High Yield Bond Fund (Forts.) | | |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 277.552 | € 482.095 | € 297.614 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 10.395 | 15.170 | 9.695 |
| NIW je Anteil | € 26,70 | € 31,78 | € 30,70 |
| Erträge | € 108.565 | € 138.522 | € 126.166 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.259 | 11.751 | 10.575 |
| NIW je Anteil | € 9,64 | € 11,79 | € 11,93 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 41.884 | £ 48.533 | £ 41.967 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.052 | 2.009 | 1.809 |
| NIW je Anteil | £ 20,41 | £ 24,16 | £ 23,20 |
| Erträge | £ 2.620 | £ 5.115 | £ 7.216 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 325 | 522 | 731 |
| NIW je Anteil | £ 8,06 | £ 9,80 | £ 9,86 |
| Institutional SGD (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SGD 323 | SGD 374 | k. A. |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 38 | 37 | k. A. |
| NIW je Anteil | SGD 8,56 | SGD 10,10 | k. A. |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 304.909 | $ 434.782 | $ 307.813 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.860 | 11.894 | 8.760 |
| NIW je Anteil | $ 30,92 | $ 36,56 | $ 35,14 |
| Erträge | $ 25.417 | $ 37.431 | $ 31.926 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.769 | 4.581 | 3.897 |
| NIW je Anteil | $ 6,74 | $ 8,17 | $ 8,19 |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 2.346 | € 3.173 | € 3.819 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 97 | 110 | 137 |
| NIW je Anteil | € 24,13 | € 28,78 | € 27,89 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 143.567 | $ 225.933 | $ 203.678 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.802 | 6.375 | 5.947 |
| NIW je Anteil | $ 29,90 | $ 35,44 | $ 34,25 |
| Erträge | $ 71.643 | $ 124.742 | $ 103.491 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.056 | 11.581 | 9.577 |
| NIW je Anteil | $ 8,89 | $ 10,77 | $ 10,81 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 76.511 | € 77.393 | € 84.948 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.319 | 2.808 | 3.162 |
| NIW je Anteil | € 23,05 | € 27,56 | € 26,86 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 95.893 | $ 139.658 | $ 112.228 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.864 | 3.532 | 2.958 |
| NIW je Anteil | $ 33,48 | $ 39,54 | $ 37,94 |
| Erträge | $ 2.792 | $ 3.370 | $ 2.484 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 339 | 337 | 248 |
| NIW je Anteil | $ 8,24 | $ 9,99 | $ 10,01 |
| M Retail: | | | |
| Erträge | $ 9.678 | $ 4.154 | $ 8.103 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.073 | 381 | 740 |
| NIW je Anteil | $ 9,02 | $ 10,91 | $ 10,95 |
| Class R: | | | |
| thesaurierend | $ 7.729 | $ 4.914 | $ 4.885 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 564 | 304 | 314 |
| NIW je Anteil | $ 13,70 | $ 16,18 | $ 15,54 |
| Class Z: | | | |
| thesaurierend | $ 8.214 | $ 9.666 | $ 9.208 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 661 | 661 | 661 |
| NIW je Anteil | $ 12,43 | $ 14,63 | $ 13,93 |

| | Zum 30. Juni 2022 | Zum 31. Dez. 2021 | Zum 31. Dez. 2020 |
|---|---|---|---|
| | US Investment Grade Corporate Bond Fund | | |
| Nettovermögen | $ 407.470 | $ 878.100 | $ 1.180.148 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 152.778 | $ 132.646 | $ 247.764 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 14.259 | 10.461 | 19.215 |
| NIW je Anteil | $ 10,71 | $ 12,68 | $ 12,89 |
| Erträge | $ 48.933 | $ 63.781 | $ 93.048 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.539 | 5.999 | 8.352 |
| NIW je Anteil | $ 8,83 | $ 10,63 | $ 11,14 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 153.808 | € 214.560 | € 276.920 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 16.177 | 18.908 | 23.784 |
| NIW je Anteil | € 9,51 | € 11,35 | € 11,64 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| ausschüttend II | £ 18.337 | £ 304.200 | £ 336.589 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.300 | 31.489 | 33.002 |
| NIW je Anteil | £ 7,97 | £ 9,66 | £ 10,20 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 17.503 | $ 17.627 | $ 27.163 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.967 | 1.667 | 2.503 |
| NIW je Anteil | $ 8,90 | $ 10,58 | $ 10,85 |
| Erträge | $ 5.188 | $ 8.025 | $ 13.248 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 578 | 743 | 1.170 |
| NIW je Anteil | $ 8,98 | $ 10,80 | $ 11,32 |
| | US Short-Term Fund | | |
| Nettovermögen | $ 2.479.685 | $ 2.650.198 | $ 3.654.185 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 1.000.956 | $ 835.096 | $ 1.571.393 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 89.321 | 73.558 | 138.207 |
| NIW je Anteil | $ 11,21 | $ 11,35 | $ 11,37 |
| Erträge | $ 123.927 | $ 102.552 | $ 197.384 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 12.520 | 10.172 | 19.443 |
| NIW je Anteil | $ 9,90 | $ 10,08 | $ 10,15 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 238.499 | € 233.199 | € 255.291 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 24.077 | 23.092 | 25.034 |
| NIW je Anteil | € 9,91 | € 10,10 | € 10,20 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 14.765 | $ 18.474 | $ 21.612 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.355 | 1.671 | 1.945 |
| NIW je Anteil | $ 10,90 | $ 11,06 | $ 11,11 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 385.707 | $ 467.026 | $ 558.194 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 35.493 | 42.334 | 50.327 |
| NIW je Anteil | $ 10,87 | $ 11,03 | $ 11,09 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 40.146 | € 9.227 | € 11.970 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.196 | 944 | 1.208 |
| NIW je Anteil | € 9,57 | € 9,77 | € 9,91 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 29.778 | $ 33.914 | $ 14.591 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.894 | 3.250 | 1.394 |
| NIW je Anteil | $ 10,29 | $ 10,44 | $ 10,47 |
| Class Z: | | | |
| Erträge | $ 633.243 | $ 917.450 | $ 964.005 |
| Ausgegebene und umlaufende Anteile | 63.645 | 90.541 | 94.476 |
| NIW je Anteil | $ 9,95 | $ 10,13 | $ 10,20 |

## 17. VERGÜTUNG

Die Verwaltungsgesellschaft 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 2022 bereitgestellt.

### 18. RECHTSSTREITIGKEITEN UND AUFSICHTSRECHTLICHE ANGELEGENHEITEN

Die Gesellschaft ist nicht als Beklagte an wesentlichen Rechtsstreitigkeiten oder Schiedsgerichtsverfahren beteiligt und ihr sind etwaige solche gegen sie bestehenden oder drohenden wesentlichen Rechtsstreitigkeiten oder Schadensersatzforderungen nicht bekannt.

Die vorangehenden Ausführungen gelten erst ab dem 30. Juni 2022.

### 19. KREDITFAZILITÄT

PIMCO Funds: Global Investors Series plc handelt im Auftrag des US High Yield Bond Fund und des Global High Yield Bond Fund (der bzw. die „Fonds“) und hat am 20. August 2021 eine zweite geänderte und neu gefasste Kreditfazilität (die „Kreditvereinbarung“) zwischen u. a. den Fonds, bestimmten Kreditgebern, zu denen auch MUFG Bank Ltd. („MUFG“) (als „Kreditgeber“) zählt, und MUFG in seiner Eigenschaft als Agent und Lead Arranger abgeschlossen.

Jeder Fonds darf die Fazilität für temporäre Zwecke nutzen, um Rücknahmen durch Anteilinhaber zu finanzieren, sowie für andere kurzfristige Liquiditätszwecke, die gemäß seiner Anlagepolitik zulässig sind.

Der Gesamtbetrag, der für eine Nutzung durch die Fonds zur Verfügung steht, beläuft sich vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarung auf USD 285.000.000 (der „verfügbare Betrag“). Die Fonds können zusammen mit den anderen Kreditnehmern (gemeinsam die „Kreditnehmer“) und vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarung eine Erhöhung des verfügbaren Betrags um bis zu USD 270.000.000 beantragen. Dieser erhöhte zugesagte Betrag würde den Kreditnehmern zur Inanspruchnahme gemäß den Bestimmungen der Kreditvereinbarung zur Verfügung stehen.

Die Kreditvereinbarung sieht zwei verschiedene Zinssätze vor. Bei der Inanspruchnahme eines Kredits entscheidet jeder Fonds selbst, welcher Zinssatz für das jeweilige Darlehen gilt. Hierbei wird der geltende Zinssatz durch Bezugnahme auf (i) die Alternate Base Rate (alternativer Basiszinssatz) oder (ii) die Adjusted Offered Rate (angepasster Briefkurs) bestimmt.

Die Alternate Base Rate (alternativer Basiszinssatz) liegt 1,125 % über dem höheren Wert der folgenden Zinssätze: (i) der Federal Funds Rate (gemäß Definition in der Kreditvereinbarung) oder (ii) der Overnight Bank Funding Rate (gemäß Definition in der Kreditvereinbarung), die am jeweiligen Feststellungstag gilt. 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 geltende 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. Die Adjusted Offered Rate (angepasster Briefkurs) wird automatisch zum Zeitpunkt des Inkrafttretens einer Änderung der Reserve Percentage (Reservesatz) angepasst.

Ein Kredit, der auf Basis der Alternate Base Rate in Anspruch genommen wird, ist vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarungen innerhalb von 60 Tagen nach Inanspruchnahme zurückzuzahlen. Ein Kredit, der auf Basis der Adjusted Offered Rate in Anspruch genommen wird, ist vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarungen am letzten Tag eines maßgeblichen Zinszeitraums (dieser kann nach Wahl eines Fonds einem Zeitraum von einer Woche oder einem Monat entsprechen) zurückzuzahlen.

Sämtliche Kredite werden auf unbesicherter Basis gewährt, und der Rückgriff der Kreditgeber gegenüber einem Fonds ist auf die Vermögenswerte des betreffenden Fonds beschränkt.

Zum 30. Juni 2022 und zum 31. Dezember 2021 hatte keiner der Fonds im Rahmen der Kreditvereinbarung Kredite in Anspruch genommen.

### 20. VERORDNUNG ÜBER WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE

Die Richtlinie über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Securities Financing Transactions Regulation, „SFTR“) führt Melde- und Offenlegungspflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Securities Financing Transactions, „SFTs“) und Total Return Swaps ein. SFTs sind gemäß Artikel 3(11) der SFTR folgendermaßen konkret definiert:

- Pensionsgeschäfte/umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Wertpapier- oder Rohstoffleihgeschäfte
- Buy-Sellback- oder Sale-Buyback-Geschäfte
- Lombardgeschäfte

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

Zum 30. Juni 2022 hielten die Fonds Total Return Swaps und die folgenden Arten von SFTs:

- Pensionsgeschäfte
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Sale-Buyback-Geschäfte

Der Marktwert von Vermögenswerten/(Verbindlichkeiten) über alle SFTs und Total Return Swaps hinweg, jeweils gruppiert nach SFT-Art(en), und die zehn größten Kontrahenten gestalteten sich zum 30. Juni 2022 wie nachfolgend angegeben (wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind alle Kontrahenten aufgeführt).

| | 30. Juni 2022 | |
|---|---|---|
| | Marktwert (000S) | % des Nettovermögens |
| **PIMCO Asia High Yield Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| SSB | $ 79.920 | 2,64 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (1.549) | (0,05) |
| BRC | (3.961) | (0,13) |
| **Summe** | (5.510) | (0,18) |
| **Asia Strategic Interest Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| SSB | $ 914 | 0,29 |
| TDM | 2.600 | 0,83 |
| **Summe** | 3.514 | 1,12 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (86) | (0,03) |
| **PIMCO Capital Securities Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| JPM | $ (2.841) | (0,05) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 8.494 | 0,14 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (3.460) | (0,06) |
| BRC | (1.800) | (0,03) |
| FBF | (15.884) | (0,27) |
| JML | (189.002) | (3,17) |
| MEI | (1.978) | (0,03) |
| SCX | (348.459) | (5,86) |
| **Summe** | (560.583) | (9,42) |
| **Commodity Real Return Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BPS | $ (44.491) | (2,45) |
| CBK | (13.657) | (0,76) |
| CIB | (4.103) | (0,23) |
| FBF | (2.222) | (0,12) |
| GST | (49.639) | (2,73) |
| JPM | (68.796) | (3,81) |
| MAC | (3.985) | (0,22) |
| MEI | (5.928) | (0,33) |
| SOG | (6.108) | (0,34) |
| **Summe** | (198.929) | (10,99) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 576 | 0,03 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (22.374) | (1,23) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| BOS | (81.239) | (4,48) |
| CSN | (87.098) | (4,81) |
| **Summe** | (168.337) | (9,29) |

| | 30. Juni 2022 | |
|---|---|---|
| | Marktwert (000S) | % des Nettovermögens |
| **PIMCO Credit Opportunities Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | $ 2.000 | 1,65 |
| FICC | 482 | 0,40 |
| **Summe** | 2.482 | 2,05 |
| **Diversified Income Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | $ 350.000 | 3,48 |
| BRC | 250.000 | 2,48 |
| FICC | 79.537 | 0,79 |
| JPM | 77.522 | 0,77 |
| MEI | 155.045 | 1,54 |
| NOM | 33.000 | 0,33 |
| **Summe** | 945.104 | 9,39 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BRC | (19.085) | (0,19) |
| JML | (13.424) | (0,14) |
| MEI | (474) | 0,00 |
| **Summe** | (32.983) | (0,33) |
| **Diversified Income Duration Hedged Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 7.873 | 0,97 |
| NOM | 73.000 | 9,01 |
| **Summe** | 80.873 | 9,98 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (1.460) | (0,18) |
| **Dynamic Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 4.909 | 0,20 |
| MBC | 47.900 | 1,97 |
| **Summe** | 52.809 | 2,17 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| JML | (521) | (0,02) |
| **Dynamic Multi-Asset Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| CBK | € 0 | 0,00 |
| JPM | 5.800 | 0,10 |
| **Summe** | 5.800 | 0,10 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | 26.600 | 0,43 |
| FICC | 23.557 | 0,39 |
| **Summe** | 50.157 | 0,82 |
| **Emerging Markets Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 11.538 | 0,36 |
| MBC | 53.000 | 1,65 |
| **Summe** | 64.538 | 2,01 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (63.902) | (1,99) |
| BRC | (15.169) | (0,46) |
| JML | (7.580) | (0,24) |
| MEI | (13.617) | (0,43) |
| NOM | (7.366) | (0,23) |
| **Summe** | (107.634) | (3,35) |
| **Emerging Markets Bond ESG Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 5.617 | 0,26 |
| NOM | 31.300 | 1,42 |
| **Summe** | 36.917 | 1,68 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (21.296) | (0,97) |
| BRC | (8.692) | (0,38) |
| MEI | (237) | (0,01) |
| NOM | (10.875) | (0,50) |
| SCX | (32.792) | (1,50) |
| **Summe** | (73.892) | (3,36) |

| | 30. Juni 2022 | |
|---|---|---|
| | Marktwert (000S) | % des Nettovermögens |
| **Emerging Markets Corporate Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 2.128 | 1,37 |
| **PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| MBC | $ 51.200 | 19,03 |
| SSB | 8.841 | 3,29 |
| **Summe** | 60.041 | 22,32 |
| **Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| SSB | $ 297 | 1,16 |
| **PIMCO ESG Income Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | $ 16.600 | 10,98 |
| **Euro Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | € 66.100 | 3,22 |
| BRC | 32.400 | 1,57 |
| FICC | 370 | 0,02 |
| RYL | 31.100 | 1,51 |
| **Summe** | 129.970 | 6,32 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| FBF | (558) | (0,03) |
| **Euro Credit Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| COM | € 11.100 | 1,38 |
| FICC | 936 | 0,12 |
| **Summe** | 12.036 | 1,50 |
| **Euro Income Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| IND | € 69.400 | 4,31 |
| **Euro Long Average Duration Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | € 125 | 0,11 |
| **Euro Short-Term Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| COM | € 10.100 | 1,99 |
| **PIMCO European High Yield Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | € 13.200 | 9,17 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (329) | (0,23) |
| **PIMCO European Short-Term Opportunities Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | € 21.600 | 7,89 |
| **Global Advantage Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 351 | 0,08 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (9.190) | (2,11) |
| BRC | (12.649) | (2,90) |
| MYI | (5.823) | (1,34) |
| **Summe** | (27.662) | (6,35) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| MSC | (6.799) | (1,56) |
| UBS | (557) | (0,13) |
| **Summe** | (7.356) | (1,69) |
| **Global Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BRC | $ 404.800 | 3,58 |
| CIB | 150.000 | 1,32 |
| FICC | 31.921 | 0,28 |
| MEI | 155.045 | 1,37 |
| RCY | 13.400 | 0,12 |
| **Summe** | 755.166 | 6,67 |

| | 30. Juni 2022 | |
|---|---|---|
| | Marktwert (000S) | % des Nettovermögens |
| **Global Bond Fund (Forts.)** | | |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BRC | $ (238.925) | (2,11) |
| JML | (640) | (0,01) |
| **Summe** | (239.565) | (2,12) |
| **Global Bond ESG Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | $ 185.800 | 8,53 |
| FICC | 3.185 | 0,15 |
| **Summe** | 188.985 | 8,68 |
| **Global Bond Ex-US Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BPS | $ 1.820 | 0,24 |
| GST | 36 | 0,01 |
| MYC | 140 | 0,02 |
| **Summe** | 1.996 | 0,27 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 494 | 0,07 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (7.890) | (1,08) |
| BRC | (748) | (0,10) |
| MYI | (22.161) | (3,02) |
| **Summe** | (30.799) | (4,20) |
| **PIMCO Global Core Asset Allocation Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BOA | $ 180 | 0,02 |
| BPS | 595 | 0,08 |
| JPM | 4.395 | 0,57 |
| MYI | (3.356) | (0,44) |
| SOG | 1.926 | 0,25 |
| **Summe** | 3.740 | 0,48 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 36.319 | 4,66 |
| **Global High Yield Bond Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BOA | $ (110) | 0,00 |
| JPM | (20) | 0,00 |
| MYC | (1.038) | (0,03) |
| **Summe** | (1.168) | (0,03) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 8.443 | 0,24 |
| NOM | 99.900 | 2,83 |
| **Summe** | 108.343 | 3,07 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BRC | (19.507) | (0,55) |
| JML | (32.392) | (0,92) |
| TDM | (4.445) | (0,13) |
| **Summe** | (56.344) | (1,60) |
| **Global Investment Grade Credit Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 476 | 0,00 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BRC | (2.873) | (0,02) |
| JML | (3.010) | (0,03) |
| **Summe** | (5.883) | (0,05) |
| **Global Investment Grade Credit ESG Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | $ 29.500 | 2,07 |
| SSB | 6.285 | 0,44 |
| **Summe** | 35.785 | 2,51 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (60.986) | (4,27) |
| BRC | (811) | (0,06) |
| **Summe** | (61.797) | (4,33) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| MSC | (11.071) | (0,78) |

| | 30. Juni 2022 | |
|---|---|---|
| | Marktwert (000S) | % des Nettovermögens |
| **Global Low Duration Real Return Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 577 | 0,06 |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| BRC | (81.356) | (8,28) |
| CSN | (114.711) | (11,68) |
| **Summe** | (196.067) | (19,96) |
| **Global Real Return Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 1.506 | 0,05 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (17.371) | (0,62) |
| NOM | (771.192) | (27,57) |
| **Summe** | (788.563) | (28,19) |
| **Income Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BOA | $ (15) | 0,00 |
| BPS | (1.197) | 0,00 |
| JPM | (4) | 0,00 |
| MYC | (1.132) | 0,00 |
| **Summe** | (2.348) | 0,00 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | 550.000 | 0,97 |
| BRC | 857.225 | 1,51 |
| CEW | 121.445 | 0,21 |
| FICC | 11.751 | 0,02 |
| JPM | 969.030 | 1,71 |
| MBC | 241.400 | 0,42 |
| RYL | 607.225 | 1,07 |
| SCX | 364.335 | 0,64 |
| STR | 2.181.300 | 3,83 |
| **Summe** | 5.903.711 | 10,38 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BRC | (2.074) | 0,00 |
| JML | (5.793) | (0,01) |
| **Summe** | (7.867) | (0,01) |
| **Income Fund II** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | $ 2.600 | 8,11 |
| **Inflation Multi-Asset Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BOA | $ (242) | (0,05) |
| BPS | (6.031) | (1,29) |
| CBK | (692) | (0,15) |
| GST | (1.596) | (0,34) |
| JPM | (2.228) | (0,47) |
| MAC | (483) | (0,10) |
| MYI | (1.122) | (0,24) |
| SOG | (304) | (0,06) |
| **Summe** | (12.698) | (2,70) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| GSC | 62.500 | 13,27 |
| SSB | 603 | 0,13 |
| TDM | 25.700 | 5,45 |
| **Summe** | 88.803 | 18,85 |
| **Low Average Duration Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 3.583 | 0,23 |
| MBC | 199.900 | 12,68 |
| **Summe** | 203.483 | 12,91 |
| **Low Duration Global Investment Grade Credit Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 683 | 0,10 |

| | 30. Juni 2022 | |
|---|---|---|
| | Marktwert (000S) | % des Nettovermögens |
| **Low Duration Income Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BPS | $ (13) | 0,00 |
| MYC | (6) | 0,00 |
| **Summe** | (19) | 0,00 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 4.712 | 0,46 |
| **Low Duration Opportunities Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | $ 169.600 | 5,62 |
| FICC | 5.860 | 0,19 |
| NOM | 108.800 | 3,60 |
| **Summe** | 284.260 | 9,41 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (859) | (0,03) |
| **PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BOA | $ (4.584) | (3,78) |
| CBK | (1.325) | (1,09) |
| FAR | (1) | 0,00 |
| MYI | (1.237) | (1,03) |
| **Summe** | (7.147) | (5,90) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| SSB | 1.991 | 1,64 |
| **Mortgage Opportunities Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 1.042 | 0,06 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (501.214) | (31,18) |
| BPS | (20.388) | (1,27) |
| CSN | (21.859) | (1,36) |
| **Summe** | (543.461) | (33,81) |
| **StocksPLUS™ Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| FAR | $ (12.383) | (0,76) |
| MBC | (11.420) | (0,71) |
| RBC | (39.920) | (2,47) |
| UAG | (2.120) | (0,13) |
| **Summe** | (65.843) | (4,07) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 6.862 | 0,42 |
| MFK | 70.000 | 4,33 |
| NOM | 39.200 | 2,43 |
| **Summe** | 116.062 | 7,18 |
| **PIMCO StocksPLUS™ AR Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| FAR | $ (522) | (5,35) |
| RBC | (448) | (4,58) |
| **Summe** | (970) | (9,93) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| SSB | 119 | 1,22 |
| **Strategic Income Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BPS | $ (9) | 0,00 |
| MYC | 1 | 0,00 |
| **Summe** | (8) | 0,00 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 805 | 0,15 |
| **Total Return Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| CIB | $ 100.000 | 2,46 |
| FICC | 9.439 | 0,23 |
| RBC | 90.500 | 2,23 |
| **Summe** | 199.939 | 4,92 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BRC | (9.877) | (0,24) |

| | 30. Juni 2022 | |
|---|---|---|
| | Marktwert (000S) | % des Nettovermögens |
| **PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| MEI | $ 489 | 0,39 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| NOM | 19.200 | 15,53 |
| SSB | 575 | 0,46 |
| **Summe** | 19.775 | 15,99 |
| **UK Long Term Corporate Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | £ 156 | 0,05 |
| RYL | 2.500 | 0,84 |
| **Summe** | 2.656 | 0,89 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| CEW | (1.401) | (0,47) |
| **US High Yield Bond Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BOA | $ (36) | 0,00 |
| BPS | (307) | (0,02) |
| JPM | (40) | 0,00 |
| MYC | 130 | 0,01 |
| **Summe** | (253) | (0,01) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 1.278 | 0,05 |
| NOM | 12.300 | 0,50 |
| **Summe** | 13.578 | 0,55 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BRC | (9.947) | (0,40) |
| JML | (15.299) | (0,62) |
| TDM | (5.234) | (0,21) |
| **Summe** | (30.480) | (1,23) |
| **US Investment Grade Corporate Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 1.034 | 0,25 |
| **US Short-Term Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 3.866 | 0,16 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (157.405) | (6,35) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| BPG | (65.515) | (2,64) |
| BRC | (239.078) | (9,64) |
| **Summe** | (304.593) | (12,28) |

Zum 31. Dezember 2021 hielten die Fonds Total Return Swaps und die folgenden Arten von SFTs:

- Pensionsgeschäfte
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Sale-Buyback-Geschäfte

Der Marktwert von Vermögenswerten/(Verbindlichkeiten) über alle SFTs und Total Return Swaps hinweg, jeweils gruppiert nach SFT-Art(en), und die zehn größten Kontrahenten gestalteten sich zum 31. Dezember 2021 wie nachfolgend angegeben (wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind alle Kontrahenten aufgeführt).

| | 31. Dez. 2021 | |
|---|---|---|
| **Fonds** | Marktwert (000S) | % des Nettovermögens |
| **PIMCO Asia High Yield Bond Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| DBL | $ 69 | 0,00 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| IND | 75.000 | 2,20 |
| SSB | 103.712 | 3,04 |
| **Summe** | 178.712 | 5,24 |

| Fonds | 31. Dez. 2021 Marktwert (000S) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|
| **PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Fortsetzung)** | | |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | $ (9.016) | (0,27) |
| BRC | (34.792) | (1,01) |
| JML | (5.040) | (0,15) |
| **Summe** | (48.848) | (1,43) |
| **Asia Strategic Interest Bond Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| DBL | $ 25 | 0,01 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| SSB | 837 | 0,23 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (348) | (0,10) |
| BRC | (676) | (0,18) |
| **Summe** | (1.024) | (0,28) |
| **PIMCO Capital Securities Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 14.423 | 0,16 |
| IND | 48.100 | 0,53 |
| **Summe** | 62.523 | 0,69 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (4.109) | (0,05) |
| BRC | (6.687) | (0,07) |
| JML | (10.246) | (0,11) |
| TDM | (2.297) | (0,03) |
| **Summe** | (23.339) | (0,26) |
| **Commodity Real Return Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BPS | $ 9.677 | 0,67 |
| CBK | 5.715 | 0,40 |
| CIB | 1.202 | 0,08 |
| FBF | 651 | 0,05 |
| GST | 11.216 | 0,78 |
| JPM | 20.289 | 1,40 |
| MAC | 1.646 | 0,11 |
| MEI | 2.152 | 0,15 |
| SOG | 859 | 0,06 |
| **Summe** | 53.407 | 3,70 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 2.098 | 0,15 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| GRE | (22.915) | (1,59) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| MSC | (80.800) | (5,59) |
| **PIMCO Credit Opportunities Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 1.827 | 1,31 |
| **Diversified Income Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | $ 76.100 | 0,47 |
| FICC | 81.216 | 0,49 |
| **Summe** | 157.316 | 0,96 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (5.516) | (0,03) |
| BRC | (18.608) | (0,11) |
| FBF | (29.496) | (0,18) |
| JML | (28.249) | (0,18) |
| **Summe** | (81.869) | (0,50) |
| **Diversified Income Duration Hedged Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 7.030 | 0,54 |
| IND | 51.900 | 3,97 |
| **Summe** | 58.930 | 4,51 |

| Fonds | 31. Dez. 2021 Marktwert (000S) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|
| **Diversified Income Duration Hedged Fund (Fortsetzung)** | | |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | $ (1.888) | (0,14) |
| GST | (2.957) | (0,23) |
| **Summe** | (4.845) | (0,37) |
| **Dynamic Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 9.965 | 0,30 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (4.539) | (0,14) |
| **Dynamic Multi-Asset Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BPS | € (57) | 0,00 |
| BRC | (2) | 0,00 |
| **Summe** | (59) | 0,00 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | 114.800 | 1,50 |
| FICC | 8.276 | 0,11 |
| IND | 79.200 | 1,04 |
| **Summe** | 202.276 | 2,65 |
| **Emerging Local Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 591 | 0,03 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (12.365) | (0,57) |
| BRC | (89.609) | (4,16) |
| DBL | (11.372) | (0,53) |
| JML | (112.133) | (5,22) |
| MBC | (35.127) | (1,63) |
| SCX | (99.720) | (4,64) |
| UBS | (14.417) | (0,67) |
| **Summe** | (374.743) | (17,42) |
| **Emerging Markets Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | $ 42.700 | 0,91 |
| FICC | 7.623 | 0,16 |
| **Summe** | 50.323 | 1,07 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (91.031) | (1,93) |
| BRC | (19.110) | (0,40) |
| FBF | (14.102) | (0,30) |
| JML | (28.314) | (0,61) |
| MEI | (13.673) | (0,29) |
| **Summe** | (166.230) | (3,53) |
| **Emerging Markets Bond ESG Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | $ 14.600 | 0,55 |
| FICC | 3.343 | 0,13 |
| SGY | 33.200 | 1,26 |
| **Summe** | 51.143 | 1,94 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (64.683) | (2,45) |
| BRC | (10.692) | (0,41) |
| FBF | (7.843) | (0,30) |
| JML | (29.437) | (1,11) |
| NOM | (4.740) | (0,18) |
| SCX | (47.047) | (1,79) |
| TDM | (2.761) | (0,10) |
| **Summe** | (167.203) | (6,34) |
| **Emerging Markets Corporate Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 487 | 0,23 |
| **Emerging Markets Opportunities Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| SSB | $ 688 | 0,24 |

| Fonds | 31. Dez. 2021 Marktwert (000S) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|
| **Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| SSB | $ 193 | 0,65 |
| **Euro Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| COM | € 22.300 | 0,87 |
| FICC | 2.416 | 0,09 |
| **Summe** | 24.716 | 0,96 |
| **Euro Credit Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | € 5.883 | 0,58 |
| **Euro Income Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| COM | € 6.400 | 0,25 |
| FICC | 1.151 | 0,05 |
| **Summe** | 7.551 | 0,30 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| SCX | (3.195) | (0,13) |
| **Euro Long Average Duration Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| COM | € 1.100 | 0,69 |
| FICC | 136 | 0,08 |
| **Summe** | 1.236 | 0,77 |
| **Euro Short-Term Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| COM | € 25.900 | 4,11 |
| FICC | 637 | 0,10 |
| **Summe** | 26.537 | 4,21 |
| **PIMCO European High Yield Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | € 4.900 | 2,87 |
| **PIMCO European Short-Term Opportunities Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| COM | € 10.800 | 2,73 |
| FICC | 881 | 0,22 |
| **Summe** | 11.681 | 2,95 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| FBF | (611) | (0,15) |
| **Global Advantage Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 206 | 0,04 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BRC | (13.753) | (2,64) |
| GRE | (14.899) | (2,86) |
| MYI | (6.798) | (1,30) |
| **Summe** | (35.450) | (6,80) |
| **Global Bond Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| CIB | $ 101 | 0,00 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 3.378 | 0,02 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BRC | (12.048) | (0,09) |
| CIB | (611.552) | (4,35) |
| GRE | (189.959) | (1,35) |
| IND | (16.596) | (0,12) |
| JML | (336.833) | (2,40) |
| **Summe** | (1.166.988) | (8,31) |
| **Global Bond ESG Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | $ 32.600 | 1,41 |
| FICC | 5.654 | 0,25 |
| **Summe** | 38.254 | 1,66 |

| Fonds | 31. Dez. 2021 Marktwert (000S) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|
| **Global Bond Ex-US Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BPS | $ 83 | 0,01 |
| CIB | 1 | 0,00 |
| GST | 51 | 0,00 |
| **Summe** | 135 | 0,01 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 1.246 | 0,14 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BRC | (26.064) | (2,86) |
| IND | (9.437) | (1,03) |
| JML | (20.622) | (2,26) |
| MYI | (41.132) | (4,51) |
| UBS | (2.251) | (0,25) |
| **Summe** | (99.506) | (10,91) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| MSC | (8.467) | (0,93) |
| **PIMCO Global Core Asset Allocation Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BOA | $ (333) | (0,03) |
| BPS | 26 | 0,00 |
| JPM | 80 | 0,01 |
| SOG | 18 | 0,00 |
| **Summe** | (209) | (0,02) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 511 | 0,05 |
| **Global High Yield Bond Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BRC | $ 77 | 0,00 |
| MYC | 739 | 0,02 |
| **Summe** | 816 | 0,02 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BRC | (12.814) | (0,25) |
| JML | (3.058) | (0,06) |
| **Summe** | (15.872) | (0,31) |
| **Global Investment Grade Credit Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 4.429 | 0,03 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BRC | (6.220) | (0,03) |
| FBF | (1.160) | (0,01) |
| **Summe** | (7.380) | (0,04) |
| **Global Investment Grade Credit ESG Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| SSB | $ 962 | 0,08 |
| **Global Low Duration Real Return Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 1.138 | 0,09 |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| BRC | (68.642) | (5,73) |
| CSN | (182.164) | (15,19) |
| **Summe** | (250.806) | (20,92) |
| **Global Real Return Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 5.680 | 0,15 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| GRE | (217.149) | (5,86) |
| MYI | (20.667) | (0,56) |
| NOM | (534.885) | (14,44) |
| **Summe** | (772.701) | (20,86) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| BRC | (45.534) | (1,23) |
| MSC | (290.315) | (7,84) |
| **Summe** | (335.849) | (9,07) |

| Fonds | 31. Dez. 2021 Marktwert (000S) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|
| **Income Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BPS | $ 257 | 0,00 |
| MYC | 3.317 | 0,00 |
| **Summe** | 3.574 | 0,00 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | 2.796.100 | 3,79 |
| BPS | 134.300 | 0,18 |
| BRC | 653.100 | 0,89 |
| BSN | 230.400 | 0,31 |
| CIB | 1.500.000 | 2,04 |
| FICC | 14.233 | 0,02 |
| JPS | 130.000 | 0,18 |
| MBC | 608.100 | 0,83 |
| NXN | 250.000 | 0,34 |
| TDM | 49.400 | 0,07 |
| **Summe** | 6.365.633 | 8,65 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (43.630) | (0,06) |
| BRC | (10.270) | (0,01) |
| FBF | (14.088) | (0,02) |
| JML | (4.228) | (0,01) |
| TDM | (856) | 0,00 |
| **Summe** | (73.072) | (0,10) |
| **Inflation Multi-Asset Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BOA | $ 11 | 0,01 |
| BPS | 252 | 0,15 |
| CBK | 87 | 0,04 |
| FAR | (1) | 0,00 |
| GST | 89 | 0,06 |
| JPM | 354 | 0,22 |
| MAC | 4 | 0,00 |
| MYI | 93 | 0,06 |
| SOG | 39 | 0,02 |
| UAG | (2) | 0,00 |
| **Summe** | 926 | 0,56 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| SSB | 500 | 0,30 |
| **Low Average Duration Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 2.677 | 0,23 |
| RDR | 21.500 | 1,82 |
| **Summe** | 24.177 | 2,05 |
| **Low Duration Global Investment Grade Credit Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 892 | 0,11 |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| BRC | (2.682) | (0,33) |
| **Low Duration Income Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BPS | $ 2 | 0,00 |
| BRC | 1 | 0,00 |
| MYC | 4 | 0,00 |
| **Summe** | 7 | 0,00 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 7.961 | 0,58 |
| **Low Duration Opportunities Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | $ 68.000 | 2,12 |
| FICC | 4.663 | 0,14 |
| **Summe** | 72.663 | 2,26 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (1.088) | (0,03) |

| Fonds | 31. Dez. 2021 Marktwert (000S) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|
| **PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BOA | $ (2) | 0,00 |
| CBK | 302 | 0,31 |
| FAR | (4) | (0,01) |
| MYI | 11 | 0,01 |
| **Summe** | 307 | 0,31 |
| **Mortgage Opportunities Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 2.125 | 0,09 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (347.158) | (15,51) |
| CIB | (16.761) | (0,75) |
| **Summe** | (363.919) | (16,26) |
| **StocksPLUS™ Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BOA | $ 612 | 0,02 |
| CBK | 5.147 | 0,13 |
| FAR | 19.666 | 0,53 |
| GST | (20) | 0,00 |
| HUS | 1.674 | 0,04 |
| RBC | 16.517 | 0,44 |
| UAG | 9.318 | 0,25 |
| **Summe** | 52.914 | 1,41 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | $ 300.000 | 7,97 |
| FICC | 7.712 | 0,21 |
| GSC | 163.800 | 4,36 |
| MFK | 550.000 | 14,62 |
| RVM | 450.000 | 11,96 |
| **Summe** | 1.471.512 | 39,12 |
| **PIMCO StocksPLUS™ AR Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| FAR | $ 213 | 1,83 |
| GST | (5) | (0,04) |
| **Summe** | 208 | 1,79 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | 1.300 | 11,19 |
| SSB | 132 | 1,14 |
| **Summe** | 1.432 | 12,33 |
| **Strategic Income Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BPS | $ 2 | 0,00 |
| BRC | 1 | 0,00 |
| MYC | 2 | 0,00 |
| **Summe** | 5 | 0,00 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 476 | 0,08 |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| BRC | (1.841) | (0,30) |
| **Total Return Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 7.152 | 0,14 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BRC | (11.267) | (0,24) |
| GRE | (119.489) | (2,41) |
| IND | (98.095) | (1,92) |
| **Summe** | (225.851) | (4,57) |
| **PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| MEI | $ 94 | 0,09 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| SSB | 800 | 0,79 |

| Fonds | | 31. Dez. 2021 Marktwert (000S) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|
| **UK Corporate Bond Fund** | | | |
| Pensionsgeschäfte | | | |
| FICC | £ | 526 | 0,09 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | | |
| FBF | | (513) | (0,09) |
| **UK Long Term Corporate Bond Fund** | | | |
| Pensionsgeschäfte | | | |
| FICC | £ | 442 | 0,10 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | | |
| FBF | | (513) | (0,12) |
| **US High Yield Bond Fund** | | | |
| Total Return Swaps | | | |
| BRC | $ | 898 | 0,03 |
| Pensionsgeschäfte | | | |
| FICC | | 1.473 | 0,04 |
| **US Investment Grade Corporate Bond Fund** | | | |
| Pensionsgeschäfte | | | |
| FICC | $ | 686 | 0,08 |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | | |
| BPG | | (6.735) | (0,77) |
| CSN | | (19.775) | (2,25) |
| **Summe** | | (26.510) | (3,02) |
| **US Short-Term Fund** | | | |
| Pensionsgeschäfte | | | |
| FICC | $ | 1.571 | 0,06 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | | |
| SGY | | (215.091) | (8,12) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | | |
| BRC | | (56.138) | (2,12) |
| CSN | | (181.617) | (6,85) |
| **Summe** | | (237.755) | (8,97) |

**(b) Sicherheiten**

**(i) Verwahrung erhaltener Sicherheiten:**
Die zum 30. Juni 2022 und zum 31. Dezember 2021 erhaltenen Sicherheiten wurden im Depotbanknetz der State Street Bank and Trust als Beauftragte der Verwahrstelle gehalten.

**(ii) Konzentrationsdaten:**
Die zehn größten Emittenten von Wertpapieren, die als Sicherheiten über sämtliche SFTs hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 30. Juni 2022 wie folgt. Wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind alle Emittenten nachfolgend aufgeführt:

| Fonds | Zum 30. Jun. 2022 Sicherheitenemittent | | Marktwert (000S) |
|---|---|---|---|
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | $ | 81.519 |
| Asia Strategic Interest Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 3.620 |
| PIMCO Capital Securities Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 8.664 |
| Commodity Real Return Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 588 |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 2.538 |
| Diversified Income Fund | Canada Government | | 236.382 |
| | Fannie Mae | | 56.734 |
| | Ginnie Mae | | 203.338 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 477.327 |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 82.687 |
| Dynamic Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 54.450 |
| Dynamic Multi-Asset Fund | KFW | € | 27.281 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 24.029 |
| Emerging Markets Bond Fund | United Kingdom Government | $ | 138 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 66.920 |
| Emerging Markets Bond ESG Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 37.776 |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 2.171 |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | $ | 61.964 |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 303 |
| PIMCO ESG Income Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 16.919 |
| Euro Bond Fund | Regierung von Belgien | € | 31.820 |

| Fonds | Zum 30. Jun. 2022 Sicherheitenemittent | | Marktwert (000S) |
|---|---|---|---|
| | Germany Government | | 7.663 |
| | Nordea Bank Abp | | 31.000 |
| | Societe Nationale SNCF S.A. | | 60.442 |
| | Toronto-Dominion Bank | | 3.000 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 378 |
| Euro Credit Fund | KFW | | 11.448 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 955 |
| Euro Income Bond Fund | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale | | 4.894 |
| | KFW | | 31.394 |
| | SNCF Reseau | | 29.865 |
| Euro Long Average Duration Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 128 |
| Euro Short-Term Fund | KFW | | 10.417 |
| PIMCO European High Yield Bond Fund | Germany Government | | 13.310 |
| PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | KAF Kaerntner Ausgleichszahlungs-Fonds | | 21.315 |
| | KFW | | 984 |
| Global Advantage Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | $ | 358 |
| Global Bond Fund | Canada Government | | 158.253 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 616.927 |
| Global Bond ESG Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 192.616 |
| Global Bond Ex-US Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 504 |
| PIMCO Global Core Asset Allocation Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 37.046 |
| Global High Yield Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 110.762 |
| Global Investment Grade Credit Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 486 |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 38.116 |
| Global Low Duration Real Return Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 589 |
| Global Real Return Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 1.536 |
| Income Fund | Canada Government | | 975.412 |
| | Fannie Mae | | 257.145 |
| | United Kingdom Government | | 1.763.720 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 3.055.281 |
| Income Fund II | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 2.650 |
| Inflation Multi-Asset Fund | Fannie Mae | | 64.805 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 27.029 |
| Low Average Duration Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 210.004 |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 697 |
| Low Duration Income Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 4.806 |
| Low Duration Opportunities Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 292.874 |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 2.031 |
| Mortgage Opportunities Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 1.063 |
| StocksPLUS™ Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 119.272 |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 121 |
| Strategic Income Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 821 |
| Total Return Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 205.159 |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 20.222 |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | Regierung des Vereinigten Königreichs | £ | 2.567 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 159 |
| US High Yield Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | $ | 13.898 |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 1.055 |
| US Short-Term Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | | 3.943 |

Die zehn größten Emittenten von Wertpapieren, die als Sicherheiten über sämtliche SFTs hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 31. Dezember 2021 wie folgt. Wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind alle Emittenten nachfolgend aufgeführt:

| | Zum 31. Dez. 2021 | |
|---|---|---|
| Fonds | Sicherheitenemittent | Marktwert (000S) |
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | $ 182.416 |
| Asia Strategic Interest Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 854 |
| PIMCO Capital Securities Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 63.857 |
| Commodity Real Return Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 2.140 |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 1.864 |
| Diversified Income Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 160.513 |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 60.199 |
| Dynamic Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 10.164 |
| Dynamic Multi-Asset Fund | Agence Francaise de Developpement | € 15.624 |
| | Dexia Credit Local S.A. | 7.755 |
| | Europäische Union | 22.936 |
| | Germany Government | 70.334 |
| | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | 48.246 |
| | SNCF Reseau | 28.392 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 8.441 |
| Emerging Local Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | $ 603 |
| Emerging Markets Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 51.353 |
| Emerging Markets Bond ESG Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 52.182 |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 497 |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 702 |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 197 |
| Euro Bond Fund | Germany Government | € 22.175 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 2.464 |
| Euro Credit Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 6.001 |
| Euro Income Bond Fund | Germany Government | 6.350 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 1.174 |
| Euro Long Average Duration Fund | Germany Government | 1.106 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 139 |
| Euro Short-Term Fund | NRW Bank | 25.716 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 649 |
| PIMCO European High Yield Bond Fund | UNEDIC | 5.901 |
| PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | Germany Government | € 10.750 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 899 |

| | Zum 31. Dez. 2021 | |
|---|---|---|
| Fonds | Sicherheitenemittent | Marktwert (000S) |
| Global Advantage Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | $ 210 |
| Global Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 3.446 |
| Global Bond ESG Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 39.022 |
| Global Bond Ex-US Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 1.271 |
| PIMCO Global Core Asset Allocation Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 521 |
| Global Investment Grade Credit Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 4.518 |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 981 |
| Global Low Duration Real Return Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 1.161 |
| Global Real Return Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 11.471 |
| Income Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 6.515.251 |
| Inflation Multi-Asset Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 510 |
| Low Average Duration Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 24.667 |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 910 |
| Low Duration Income Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 8.120 |
| Low Duration Opportunities Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 74.161 |
| Mortgage Opportunities Fund | Fannie Mae | 94 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 2.168 |
| StocksPLUS™ Fund | Fannie Mae | 170.372 |
| | Ginnie Mae | 310.742 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 1.029.581 |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 1.461 |
| Strategic Income Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 486 |
| Total Return Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 7.295 |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 816 |
| UK Corporate Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | £ 537 |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 451 |
| US High Yield Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | $ 1.503 |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 700 |
| US Short-Term Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 1.602 |

**(iii) Aggregierte Transaktionsdaten:**
Die aggregierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (einschließlich von Barmitteln), die über sämtliche SFTs und Total Return Swaps hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 30. Juni 2022 wie folgt:

| Fonds | Wertpapierart | Beschreibung der Sicherheiten | Art der Sicherheiten | Markt-wert (000S) | Qualität | Fälligkeitsprofil der Sicherheiten | Währung der Sicherheiten | Gründungsland des Kontrahenten | Abrechnung und Clearing |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | $ 81.519 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Asia Strategic Interest Bond Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 3.620 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| PIMCO Capital Securities Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 8.664 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensions-geschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 12.535 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Commodity Real Return Fund | Swap-kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 640 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 588 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 2.046 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 492 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |

| Fonds | Wertpapierart | Beschreibung der Sicherheiten | Art der Sicherheiten | Markt-wert (000S) | Qualität | Fälligkeitsprofil der Sicherheiten | Währung der Sicherheiten | Gründungsland des Kontrahenten | Abrechnung und Clearing |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Diversified Income Fund | Pensions-geschäfte | Fannie Mae | Mortgage Pass Thru | $ 56.734 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Ginnie Mae | Mortgage Pass Thru | 203.338 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Canada Government Bond | Treasury | 78.129 | AA+ | Mehr als 1 Jahr | CAD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | Canada Treasury Bills | Treasury | 158.253 | AA+ | 1-3 Monate | CAD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 396.198 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 81.129 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensions-geschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 1.280 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 82.687 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Dynamic Bond Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 49.443 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 5.007 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Dynamic Multi-Asset Fund | Swap-kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | € 15.720 | k. A. | k. A. | EUR | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensions-geschäfte | KFW | Unternehmensanleihen | 27.281 | AAA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 24.029 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Emerging Markets Bond Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 55.151 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 11.769 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensions-geschäfte | United Kingdom Gilt | Treasury | 138 | AA- | Mehr als 1 Jahr | GBP | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Emerging Markets Bond ESG Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | $ 32.047 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 5.729 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 2.171 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 52.946 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 9.018 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 303 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| PIMCO ESG Income Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 16.919 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| Euro Bond Fund | Pensions-geschäfte | Nordea Bank Abp | Unternehmensanleihen | € 10.000 | AA- | Below 1 Month | EUR | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Nordea Bank Abp | Unternehmensanleihen | 16.000 | AA- | 1-3 Monate | EUR | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Nordea Bank Abp | Unternehmensanleihen | 5.000 | AA- | 3 Monate - 1 Jahr | EUR | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Societe Nationale SNCF S.A. | Unternehmensanleihen | 60.442 | A+ | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Toronto-Dominion Bank | Unternehmensanleihen | 3.000 | AA- | 3 Monate - 1 Jahr | EUR | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Belgium Government International Bond | Treasury | 31.820 | AA- | Mehr als 1 Jahr | EUR | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Republic of Germany | Treasury | 7.663 | AAA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 378 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Euro Credit Fund | Pensions-geschäfte | KFW | Unternehmensanleihen | 11.448 | AAA | 3 Monate - 1 Jahr | EUR | Deutschland | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 955 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Euro Income Bond Fund | Pensions-geschäfte | KFW | Unternehmensanleihen | 31.394 | AAA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | SNCF Reseau | Treasury | 10.900 | AA | 3 Monate - 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | SNCF Reseau | Treasury | 18.965 | AA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale | Treasury | 4.894 | AA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| Euro Long Average Duration Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 128 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Euro Short-Term Fund | Pensions-geschäfte | KFW | Unternehmensanleihen | 10.417 | AAA | 3 Monate - 1 Jahr | EUR | Deutschland | FED, Bilateral |
| PIMCO European High Yield Bond Fund | Pensions-geschäfte | Republic of Germany | Treasury | 13.310 | AAA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | Pensions-geschäfte | KAF Kaerntner Ausgleichszahlungs-Fonds | Unternehmensanleihen | 21.315 | AA+ | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | KFW | Unternehmensanleihen | 984 | AAA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |

| Fonds | Wertpapierart | Beschreibung der Sicherheiten | Art der Sicherheiten | Markt-wert (000S) | Qualität | Fälligkeitsprofil der Sicherheiten | Währung der Sicherheiten | Gründungsland des Kontrahenten | Abrechnung und Clearing |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Global Advantage Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | $ 358 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensions-geschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 350 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Global Bond Fund | Pensions-geschäfte | Canada Treasury Bills | Treasury | 158.253 | AA+ | 1-3 Monate | CAD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 153.125 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 262.902 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 200.900 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Global Bond ESG Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 189.367 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 3.249 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Global Bond Ex-US Fund | Swap-kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 1.690 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 150 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 750 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 504 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| PIMCO Global Core Asset Allocation Fund | Swap-kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 1.860 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 7.570 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 37.046 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Global High Yield Bond Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 110.762 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Global Investment Grade Credit Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 486 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 30.174 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 6.411 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 1.531 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 260 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Global Low Duration Real Return Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 589 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Global Real Return Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.536 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Income Fund | Swap-kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 2.820 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 11.827 | k. A. | k. A. | USD | USA | FED, Bilateral |
| | Pensions-geschäfte | Fannie Mae | Mortgage Pass Thru | 257.145 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Canada Government Bond | Treasury | 11.650 | AA+ | 1-3 Months | CAD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | Canada Government Bond | Treasury | 963.762 | AA+ | Mehr als 1 Jahr | CAD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 78.737 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 565.981 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 173.651 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 2.236.912 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | United Kingdom Gilt | Treasury | 1.626.998 | AA- | Mehr als 1 Jahr | GBP | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | United Kingdom Gilt | Treasury | 127.444 | AA- | Mehr als 1 Jahr | GBP | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensions-geschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 5.820 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 1.133 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | United Kingdom Gilt | Treasury | 9.278 | AA- | Mehr als 1 Jahr | GBP | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Income Fund II | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 2.650 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| Inflation Multi-Asset Fund | Pensions-geschäfte | Fannie Mae | Mortgage Pass Thru | 64.805 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 27.029 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Low Average Duration Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 206.349 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 3.655 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 697 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |

| Fonds | Wertpapierart | Beschreibung der Sicherheiten | Art der Sicherheiten | Markt-wert (000S) | Qualität | Fälligkeitsprofil der Sicherheiten | Währung der Sicherheiten | Gründungsland des Kontrahenten | Abrechnung und Clearing |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Low Duration Income Fund | Swap-kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | $ 290 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 260 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 4.806 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Low Duration Opportunities Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 174.970 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 89.939 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 27.965 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 2.031 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Mortgage Opportunities Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.063 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| StocksPLUS™ Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 112.273 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 6.999 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 121 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Strategic Income Fund | Swap-kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 80 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 821 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Total Return Bond Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 205.159 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | Swap-kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 310 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 20.222 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | £ 159 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | United Kingdom Gilt | Treasury | 2.567 | AA- | Mehr als 1 Jahr | GBP | Großbritannien | FED, Bilateral |
| US High Yield Bond Fund | Swap-kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | $ 170 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 12.594 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.304 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.055 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| US Short-Term Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 3.943 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 280 | k. A. | k. A. | USD | USA | FED, Bilateral |

Die aggregierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (einschließlich von Barmitteln), die über sämtliche SFTs und Total Return Swaps hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 31. Dezember 2021 wie folgt:

| Fonds | Wertpapierart | Beschreibung der Sicherheiten | Art der Sicherheiten | Markt-wert (000S) | Qualität | Fälligkeits-profil der Sicherheiten | Währung der Sicherheiten | Gründungsland des Kontrahenten | Abrechnung und Clearing |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | $ 76.630 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 105.786 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | USA | FED, Bilateral |
| Asia Strategic Interest Bond Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 854 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| PIMCO Capital Securities Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 49.146 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 14.711 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Commodity Real Return Fund | Swap-kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 1.770 | k. A. | k. A. | USD | Australien | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 11.740 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 15.180 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 29.630 | k. A. | k. A. | USD | USA | FED, Bilateral |
| | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 2.140 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Inflationsgeschützt Wertpapiere | Treasury | 1.864 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Diversified Income Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 77.673 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 82.840 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensions-geschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 308 | k. A. | k. A. | EUR | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 53.028 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 7.171 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |

| Fonds | Wertpapierart | Beschreibung der Sicherheiten | Art der Sicherheiten | Markt-wert (000S) | Qualität | Fälligkeitsprofil der Sicherheiten | Währung der Sicherheiten | Gründungsland des Kontrahenten | Abrechnung und Clearing |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Dynamic Bond Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | $ 10.164 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensions-geschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 250 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| Dynamic Multi-Asset Fund | Pensions-geschäfte | Agence Francaise de Developpement | Unternehmensanleihen | € 15.624 | AA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Dexia Credit Local S.A. | Unternehmensanleihen | 7.755 | BBB+ | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | Unternehmensanleihen | 48.246 | AAA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Europäische Union | Treasury | 22.936 | AAA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | SNCF Reseau | Treasury | 28.392 | AA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | State of North Rhine-Westphalia | Treasury | 25.432 | AAA | 3 Monate - 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | State of North Rhine-Westphalia | Treasury | 44.902 | AAA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflationsgeschützt Wertpapiere | Treasury | 8.441 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Emerging Local Bond Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | $ 603 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensions-geschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 968 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Emerging Markets Bond Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Inflationsgeschützt Wertpapiere | Treasury | 7.776 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 43.577 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensions-geschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 408 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Emerging Markets Bond ESG Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 14.893 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflationsgeschützt Wertpapiere | Treasury | 3.410 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 33.879 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensions-geschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 1.001 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 497 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 702 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 197 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Unites States | FED, Bilateral |
| Euro Bond Fund | Pensions-geschäfte | State of Lower Saxony | Treasury | € 22.175 | AAA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Deutschland | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflationsgeschützt Wertpapiere | Treasury | 2.464 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Euro Credit Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 6.001 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Euro Income Bond Fund | Pensions-geschäfte | Land Hessen | Treasury | 6.350 | AAA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Deutschland | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflationsgeschützt Wertpapiere | Treasury | 105 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.069 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Euro Long Average Duration Fund | Pensions-geschäfte | State of Lower Saxony | Treasury | 1.106 | AAA | 3 Monate - 1 Jahr | EUR | Deutschland | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 139 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Euro Short-Term Fund | Pensions-geschäfte | NRW Bank | Unternehmensanleihen | 25.716 | AAA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Deutschland | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 649 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | USA | FED, Bilateral |
| PIMCO European High Yield Bond Fund | Pensions-geschäfte | UNEDIC | Treasury | 5.091 | AA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | Pensions-geschäfte | State of Lower Saxony | Treasury | 10.750 | AAA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Deutschland | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflationsgeschützt Wertpapiere | Treasury | 899 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |

| Fonds | Wertpapierart | Beschreibung der Sicherheiten | Art der Sicherheiten | Markt-wert (000S) | Qualität | Fälligkeitsprofil der Sicherheiten | Währung der Sicherheiten | Gründungsland des Kontrahenten | Abrechnung und Clearing |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Global Advantage Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | $ 210 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Global Bond Fund | Swap-kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 400 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Inflationsgeschützt Wertpapiere | Treasury | 3.446 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Global Bond ESG Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 33.255 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 5.767 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Global Bond Ex-US Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.271 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| PIMCO Global Core Asset Allocation Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Inflationsgeschützt Wertpapiere | Treasury | 521 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Global High Yield Bond Fund | Swap-kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 710 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Global Investment Grade Credit Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 4.518 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensions-geschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 20 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 981 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Global Low Duration Real Return Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.161 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Global Real Return Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 5.794 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensions-geschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 678 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 5.677 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Income Fund | Swap-kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 58.410 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 41.710 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 235.321 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Kanada | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 702.189 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 2.681.812 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 136.997 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 58.852 | AAA | 3 Monate - 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 225.894 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 816.286 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 309.469 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.348.431 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensions-geschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 840 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 1.035 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Inflation Multi-Asset Fund | Swap-kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 280 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 260 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 860 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 510 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Low Average Duration Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Inflationsgeschützt Wertpapiere | Treasury | 2.731 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 21.936 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 910 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Low Duration Income Fund | Swap-kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 1.330 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 1.290 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 410 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Inflationsgeschützt Wertpapiere | Treasury | 8.120 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |

| Fonds | Wertpapierart | Beschreibung der Sicherheiten | Art der Sicherheiten | Markt-wert (000S) | Qualität | Fälligkeitsprofil der Sicherheiten | Währung der Sicherheiten | Gründungsland des Kontrahenten | Abrechnung und Clearing |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Low Duration Opportunities Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | $ 69.405 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 4.756 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | Swap-kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 610 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 730 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Mortgage Opportunities Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 2.168 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensions-geschäfte | Fannie Mae | Mortgage Pass Thru | 94 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| StocksPLUS™ Fund | Swap-kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 35.390 | k. A. | k. A. | USD | Kanada | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 2.240 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 69.635 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensions-geschäfte | Fannie Mae | Mortgage Pass Thru | 170.372 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | Ginnie Mae | Mortgage Pass Thru | 310.742 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 562.569 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflationsgeschützt Wertpapiere | Treasury | 7.866 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 459.146 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Cayman-Inseln | FED, Bilateral |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | Swap-kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 530 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 270 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Inflationsgeschützt Wertpapiere | Treasury | 1.326 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 135 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Strategic Income Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 486 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Total Return Bond Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Inflationsgeschützt Wertpapiere | Treasury | 7.295 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 816 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| UK Corporate Bond Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | £ 537 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 451 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensions-geschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 58 | k. A. | k. A. | USD | Kanada | FED, Bilateral |
| US High Yield Bond Fund | Swap-kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | $ 970 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 1.503 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 700 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | USA | FED, Bilateral |
| US Short-Term Fund | Pensions-geschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.602 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |

Der Marktwert der Sicherheiten für Pensionsgeschäfte umfasst aufgelaufene Zinsen.

Rahmenverträge für Termingeschäfte decken eine Kombination aus Buy-Sellback-Geschäften, Sale-Buyback-Geschäften und sonstigen Finanzierungsgeschäften ab, die oben nicht enthalten sind. Der Gesamtbetrag der zum 30. Juni 2022 und zum 31. Dezember 2021 für alle Sicherheiten, die für gemäß diesen Vereinbarungen abgeschlossene Geschäfte erhalten wurden, ist oben enthalten. Es ist nicht möglich, die Sicherheiten für jedes einzelne Wertpapierfinanzierungsgeschäft separat zu analysieren.

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

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

**(iv) Angaben zur Wiederverwendung von Sicherheiten:**
Als Sicherheiten erhaltene Wertpapiere wurden zum 30. Juni 2022 und zum 31. Dezember 2021 nicht wiederverwendet.

**(v) Verwahrung gestellter Sicherheiten:**
Die von den Fonds zum 30. Juni 2022 und zum 31. Dezember 2021 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 2022 und zum 30. Juni 2021. Die Beträge sind in der Basiswährung der Fonds ausgewiesen.

| | 30. Juni 2022 | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Pensions-geschäfte | | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | Buy-Sellback-Finanzierungs-geschäfte | | Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte | |
| Fonds | Renditen (000S) | Kosten (000S) | Renditen (000S) | Kosten (000S) | Renditen (000S) | Kosten (000S) | Renditen (000S) | Kosten (000S) |
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund | $ 60 | $ 0 | $ 505 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 |
| Asia Strategic Interest Bond Fund | 4 | 0 | 35 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PIMCO Capital Securities Fund | 65 | 0 | 309 | 1.383 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PIMCO Climate Bond Fund | 6 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Commodity Real Return Fund | 58 | 0 | 0 | 18 | 0 | 0 | 0 | 80 |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Diversified Income Fund | 1.661 | 0 | 2.118 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | 114 | 0 | 57 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Dynamic Bond Fund | 48 | 0 | 39 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Dynamic Multi-Asset Fund | € 7 | € 619 | € 13 | € 0 | € 0 | € 0 | € 0 | € 0 |
| Emerging Local Bond Fund | $ 3 | $ 0 | $ 0 | $ 3.248 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 |
| Emerging Markets Bond Fund | 51 | 0 | 78 | 250 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Emerging Markets Bond ESG Fund | 70 | 0 | 137 | 196 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | 1 | 0 | 1 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | 64 | 9 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PIMCO ESG Income Fund | 20 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Euro Bond Fund | € 0 | € 100 | € 14 | € 0 | € 0 | € 0 | € 0 | € 0 |
| Euro Credit Fund | 2 | 63 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Euro Income Bond Fund | 0 | 99 | 38 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Euro Long Average Duration Fund | 0 | 8 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Euro Short-Term Fund | 0 | 51 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PIMCO European High Yield Bond Fund | 0 | 25 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | 0 | 29 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Global Advantage Fund | $ 0 | $ 0 | $ 120 | $ 29 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 8 |
| Global Bond Fund | 557 | 0 | 2.813 | 229 | 0 | 0 | 0 | 20 |
| Global Bond ESG Fund | 231 | 0 | 0 | 6 | 0 | 0 | 0 | 1 |
| Global Bond Ex-US Fund | 1 | 0 | 293 | 31 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PIMCO Global Core Asset Allocation Fund | 6 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Global High Yield Bond Fund | 134 | 0 | 169 | 28 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Global Investment Grade Credit Fund | 28 | 0 | 29 | 103 | 0 | 0 | 0 | 7 |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund | 29 | 0 | 0 | 77 | 0 | 0 | 0 | 31 |
| Global Low Duration Real Return Fund | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 465 |
| Global Real Return Fund | 17 | 0 | 56 | 1.862 | 0 | 0 | 0 | 96 |
| Income Fund | 10.275 | 70 | 1.605 | 0 | 0 | 0 | 0 | 6 |
| Income Fund II | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Inflation Multi-Asset Fund | 121 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Low Average Duration Fund | 117 | 0 | 0 | 3 | 0 | 0 | 204 | 0 |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 4 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 20 | 0 |
| Low Duration Income Fund | 66 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Low Duration Opportunities Fund | 458 | 0 | 7 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Mortgage Opportunities Fund | 1 | 0 | 0 | 701 | 0 | 0 | 0 | 7 |
| StocksPLUS™ Fund | 310 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | 3 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Strategic Income Fund | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Total Return Bond Fund | 122 | 0 | 19 | 380 | 0 | 0 | 0 | 31 |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 9 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| UK Corporate Bond Fund | £ 137 | £ 0 | £ 0 | £ 114 | £ 0 | £ 0 | £ 0 | £ 0 |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | 17 | 0 | 0 | 37 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| US High Yield Bond Fund | $ 83 | $ 0 | $ 17 | $ 33 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | 0 | 0 | 0 | 8 | 0 | 0 | 0 | 11 |
| US Short-Term Fund | 5 | 0 | 0 | 435 | 0 | 0 | 0 | 192 |

| | 30. Juni 2021 | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Pensions-geschäfte | | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | Buy-Sellback-Finanzierungs-geschäfte | | Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte | |
| Fonds | Renditen (000S) | Kosten (000S) | Renditen (000S) | Kosten (000S) | Renditen (000S) | Kosten (000S) | Renditen (000S) | Kosten (000S) |
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund | $ 1 | $ 0 | $ 27 | $ 35 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 |
| PIMCO Capital Securities Fund | 108 | 0 | 423 | 1.101 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PIMCO Climate Bond Fund | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Commodity Real Return Fund | 2 | 0 | 0 | 36 | 0 | 0 | 1 | 0 |
| Diversified Income Fund | 97 | 27 | 658 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | 8 | 0 | 7 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Dynamic Bond Fund | 13 | 0 | 31 | 55 | 0 | 0 | 12 | 0 |
| Dynamic Multi-Asset Fund | € 0 | € 1.491 | € 0 | € 0 | € 0 | € 0 | € 0 | € 0 |
| Emerging Local Bond Fund | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 2.920 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 |
| Emerging Markets Bond Fund | 0 | 0 | 53 | 183 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Emerging Markets Bond ESG Fund | 16 | 0 | 7 | 293 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | 0 | 0 | 3 | 1 | 0 | 0 | 0 | 1 |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | 0 | 0 | 2 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Euro Bond Fund | € 0 | € 214 | € 0 | € 0 | € 0 | € 0 | € 0 | € 0 |
| Euro Credit Fund | 0 | 27 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Euro Income Bond Fund | 0 | 43 | 2 | 57 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Euro Long Average Duration Fund | 0 | 7 | 17 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Euro Short-Term Fund | 0 | 100 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PIMCO European High Yield Bond Fund | 0 | 24 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | 0 | 31 | 9 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Global Advantage Fund | $ 0 | $ 0 | $ 16 | $ 15 | $ 0 | $ 0 | $ 2 | $ 0 |
| Global Bond Fund | 0 | 0 | 251 | 416 | 0 | 0 | 0 | 6 |
| Global Bond ESG Fund | 3 | 0 | 0 | 4 | 0 | 0 | 0 | 2 |
| Global Bond Ex-US Fund | 0 | 0 | 160 | 29 | 0 | 0 | 0 | 1 |
| Global High Yield Bond Fund | 5 | 0 | 48 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Global Investment Grade Credit Fund | 24 | 0 | 206 | 85 | 2 | 0 | 85 | 0 |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund | 0 | 0 | 0 | 3 | 1 | 0 | 0 | 4 |
| Global Low Duration Real Return Fund | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 109 |
| Global Real Return Fund | 0 | 0 | 2 | 302 | 0 | 0 | 2 | 0 |
| Income Fund | 191 | 99 | 333 | 1.219 | 0 | 0 | 132 | 0 |
| Inflation Multi-Asset Fund | 0 | 0 | 0 | 5 | 0 | 0 | 0 | 1 |
| Low Average Duration Fund | 5 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Low Duration Income Fund | 3 | 0 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Low Duration Opportunities Fund | 7 | 0 | 2 | 0 | 0 | 0 | 1 | 0 |
| Mortgage Opportunities Fund | 3 | 0 | 0 | 7 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| StocksPLUS™ Fund | 212 | 33 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Strategic Income Fund | 0 | 0 | 0 | 10 | 0 | 0 | 0 | 2 |
| Total Return Bond Fund | 19 | 0 | 0 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| UK Corporate Bond Fund | £ 11 | £ 0 | £ 0 | £ 28 | £ 0 | £ 0 | £ 0 | £ 0 |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | 1 | 0 | 1 | 19 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| US High Yield Bond Fund | $ 6 | $ 0 | $ 28 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | 0 | 0 | 1 | 5 | 0 | 0 | 0 | 6 |
| US Short-Term Fund | 58 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |

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.

**21. WESENTLICHE EREIGNISSE**

Am 01. Januar 2022 änderte der Diversified Income Fund die Basis für die Dividendenerklärung und -ausschüttung in Bezug auf die Administrative Class von vierteljährlich in monatlich.

Am 20. Januar 2022 wurde von der Verwaltungsgesellschaft eine Zeichnung in Höhe von USD 7.000.000 im US Short-Term Fund durchgeführt.

Am 7. Februar 2022 wurden der Prospekt und die Ergänzungen für die Gesellschaft aufgrund der Auflegung von Back-End-Anteilsklassen, und zwar „BE Retail", „BN Retail" und „BM Retail" (die „Back-End-Anteilsklassen"), im Diversified Income Fund, dem Dynamic Multi-Asset Fund, dem Emerging Markets Bond Fund, dem Global High Yield Bond Fund und dem StockPLUS™ Fund aktualisiert. Darüber hinaus wird für die GBP-Anteilsklassen in Bezug auf jeden Fonds kein Ausgabeaufschlag erhoben und der Abschreibungszeitraum für den PIMCO Climate Bond Fund, den PIMCO ESG Income Fund und den Income Fund II wurde von einem Jahr auf drei Jahre verlängert.

Im Februar 2022 begann Russland eine Invasion der Ukraine, die zu Sanktionen gegen verschiedene russische Einrichtungen und Personen führte. Die Fonds können in Wertpapiere und Instrumente investieren, die wirtschaftlich mit Russland verbunden sind.

Diese Anlagen wurden möglicherweise durch die Sanktionen und Gegensanktionen Russlands negativ beeinflusst, einschließlich Wertverlusten und Liquiditätseinbußen. Die Verringerung der Liquidität bei mit Russland verbundenen Anlagen kann die Fonds dazu veranlassen, Portfoliopositionen zu einem ungünstigen Zeitpunkt oder Preis zu verkaufen oder weiterhin mit Russland verbundene Anlagen zu halten, die die Fonds möglicherweise nicht mehr halten wollen. PIMCO wird diese Positionen weiterhin aktiv im besten Interesse der Fonds und ihrer Anteilinhaber verwalten.

Am 13. April 2022 wurde der Inflation Strategy Fund in Inflation Multi-Asset Fund umbenannt. Am selben Tag wurde der Vergleichsindex geändert in 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return. Der Satz der Verwaltungsgebühr wurde für die Anteilsklassen Administrative, Institutional, G Institutional und Investor in 0,79 % und für die Anteilsklassen E und Retail in 1,69 % geändert.

Am 13. April 2022 senkte der PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund die Verwaltungsgebühr für die Class E von 2,20 % auf 1,89 %.

Am 25. April 2022 wurde eine Rücknahme in Höhe von USD 11.500.000 im US Short-Term Fund von der Verwaltungsgesellschaft durchgeführt.

Abgesehen von den oben erwähnten Ereignissen waren während des Berichtszeitraums keine wesentlichen Ereignisse zu verzeichnen.

## 22. EREIGNISSE NACH ABSCHLUSS DES BERICHTSZEITRAUMS

Am 01. Juli 2022 wurde der Global Libor Plus Bond Fund in Low Duration Opportunities Fund umbenannt. Am selben Tag wurde die Benchmark für den PIMCO Capital Securities Fund, den PIMCO Credit Opportunities Bond Fund, den Dynamic Bond Fund, den Dynamic Multi-Asset Fund, den Low Duration Opportunities Fund, den Mortgage Opportunities Fund und den PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund in die Secured Overnight Financing Rate (SOFR) geändert.

Am 27. Juli 2022 wurden der Diversified Income ESG Fund, der Emerging Local Bond ESG Fund und der Low Duration Opportunities ESG Fund aufgelegt.

Am 29. Juli 2022 wurde der Vergleichsindex für den Strategic Income Fund in 75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index / 25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index geändert. Der Satz der Verwaltungsgebühr wurde für die Anteilsklassen Administrative, Institutional, G Institutional und Investor in 0,79 %, für die Anteilsklasse H Institutional Class in 0,96 % und für die Anteilsklassen E, R, T und Retail in 1,69 % geändert.

Abgesehen von den oben erwähnten Ereignissen waren nach Abschluss des Berichtszeitraums keine signifikanten Ereignisse zu verzeichnen.

## 23. GENEHMIGUNG VON FINANZABSCHLÜSSEN

Dieser Abschluss wurde am 30. August 2022 vom Verwaltungsrat genehmigt.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 35.596.743 $ | 354.168 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **1MDB Global Investments Ltd.** 4,400 % fällig am 09.03.2023 | $ | 60.100 | 59.799 |
| **NWD Finance BVI Ltd.** 6,150 % fällig am 16.03.2025 | | 58.900 | 58.796 |
| **Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.** 5,500 % fällig am 06.04.2025 | | 39.900 | 39.436 |
| **Malaysia Government International Bond** 3,900 % fällig am 30.11.2026 | MYR | 135.700 | 33.181 |
| **Singapore Airlines Ltd.** 3,375 % fällig am 19.01.2029 | $ | 33.300 | 32.563 |
| **Mong Duong Finance Holdings BV** 5,125 % fällig am 07.05.2029 | | 29.419 | 25.571 |
| **Indika Energy Capital Pte. Ltd.** 8,250 % fällig am 22.10.2025 | | 23.700 | 24.017 |
| **Bank of East Asia Ltd.** 4,875 % fällig am 22.04.2032 | | 22.100 | 21.852 |
| **Industrial & Commercial Bank of China Ltd.** 3,200 % fällig am 24.03.2023 | | 21.200 | 21.405 |
| **Freeport Indonesia PT** 5,315 % fällig am 14.04.2032 | | 21.800 | 21.363 |
| **Periama Holdings LLC** 5,950 % fällig am 19.04.2026 | | 20.337 | 19.857 |
| **India Toll Roads** 5,500 % fällig am 19.08.2024 | | 19.543 | 19.196 |
| **Muthoot Finance Ltd.** 4,400 % fällig am 02.09.2023 | | 18.900 | 18.740 |
| **Shriram Transport Finance Co. Ltd.** 4,150 % fällig am 18.07.2025 | | 17.900 | 17.900 |
| **ICBCIL Finance Co. Ltd.** 1,880 % fällig am 25.01.2027 | | 17.700 | 17.643 |
| **Vedanta Resources Finance PLC** 8,950 % fällig am 11.03.2025 | | 19.500 | 17.618 |
| **Medco Bell Pte. Ltd.** 6,375 % fällig am 30.01.2027 | | 19.000 | 17.083 |
| **Mineral Resources Ltd.** 8,000 % fällig am 01.11.2027 | | 16.040 | 16.018 |
| **West China Cement Ltd.** 4,950 % fällig am 08.07.2026 | | 18.175 | 15.861 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 52.677.197 $ | 524.130 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Malaysia Government International Bond** 3,900 % fällig am 30.11.2026 | MYR | 135.700 | 32.874 |
| **China Development Bank** 4,040 % fällig am 06.07.2028 | CNY | 167.700 | 28.001 |
| **Vedanta Resources Finance PLC** 13,875 % fällig am 21.01.2024 | $ | 25.695 | 25.766 |
| **CNAC HK Finbridge Co. Ltd.** 4,625 % fällig am 14.03.2023 | | 23.360 | 23.858 |
| **Industrial & Commercial Bank of China Ltd.** 3,200 % fällig am 24.03.2023 | | 21.200 | 20.470 |
| **JSW Steel Ltd.** 5,375 % fällig am 04.04.2025 | | 17.681 | 17.805 |
| **Celestial Miles Ltd.** 5,750 % fällig am 31.01.2024 | | 17.500 | 17.671 |
| **NWD Finance BVI Ltd.** 5,250 % fällig am 22.03.2026 | | 18.000 | 17.649 |
| **ICBCIL Finance Co. Ltd.** 1,880 % fällig am 25.01.2027 | | 17.700 | 17.336 |
| **Central China Real Estate Ltd.** 6,875 % fällig am 08.08.2022 | | 23.000 | 16.936 |
| **JSW Steel Ltd.** 5,050 % fällig am 05.04.2032 | | 18.900 | 16.885 |
| **GC Treasury Center Co. Ltd.** 4,400 % fällig am 30.03.2032 | | 15.300 | 14.641 |
| **CNAC HK Finbridge Co. Ltd.** 3,375 % fällig am 19.06.2024 | | 12.791 | 13.167 |
| **Indika Energy Capital Pte. Ltd.** 5,875 % fällig am 09.11.2024 | | 12.700 | 12.556 |
| **Dah Sing Bank Ltd.** 1,000 % fällig am 02.11.2031 | | 12.500 | 12.433 |
| **Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT** 3,750 % fällig am 30.03.2026 | | 11.600 | 11.691 |
| **SF Holding Investment Ltd.** 3,125 % fällig am 17.11.2031 | | 12.700 | 11.516 |
| **Mongolia Government International Bond** 3,500 % fällig am 07.07.2027 | | 13.187 | 11.354 |
| **Greenland Global Investment Ltd.** 6,750 % fällig am 25.06.2023 | | 12.745 | 10.929 |

(a) Der PIMCO Asia High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 7.890.670 $ | 78.534 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Korea National Oil Corp.** 2,125 % fällig am 18.04.2027 | $ | 5.300 | 5.101 |
| **Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.** 4,602 % fällig am 15.06.2032 | | 4.800 | 4.800 |
| **China Construction Bank Corp.** 2,850 % fällig am 21.01.2032 | | 4.400 | 4.390 |
| **Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia** 4,700 % fällig am 06.06.2032 | | 4.000 | 4.057 |
| **Misc Capital Two Labuan Ltd.** 3,625 % fällig am 06.04.2025 | | 3.900 | 3.897 |
| **Sunny Express Enterprises Corp.** 2,950 % fällig am 01.03.2027 | | 3.900 | 3.891 |
| **Reliance Industries Ltd.** 2,875 % fällig am 12.01.2032 | | 3.700 | 3.691 |
| **Airport Authority Hong Kong** 2,500 % fällig am 12.01.2032 | | 3.600 | 3.597 |
| **Shinhan Card Co. Ltd.** 2,500 % fällig am 27.01.2027 | | 3.600 | 3.530 |
| **Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara** 3,375 % fällig am 05.02.2030 | | 3.600 | 3.528 |
| **Malaysia Government International Bond** 3,900 % fällig am 30.11.2026 | MYR | 14.300 | 3.497 |
| **Pertamina Persero PT** 2,300 % fällig am 09.02.2031 | $ | 3.800 | 3.482 |
| **Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT** 4,625 % fällig am 20.07.2023 | | 3.200 | 3.235 |
| **Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia** 4,400 % fällig am 06.06.2027 | | 3.200 | 3.200 |
| **KB Kookmin Card Co. Ltd.** 4,000 % fällig am 09.06.2025 | | 3.200 | 3.198 |
| **Bangkok Bank PCL** 4,300 % fällig am 15.06.2027 | | 3.200 | 3.196 |
| **Tencent Holdings Ltd.** 3,595 % fällig am 19.01.2028 | | 3.100 | 3.186 |
| **TSMC Global Ltd.** 1,750 % fällig am 23.04.2028 | | 3.300 | 3.046 |
| **Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.** 3,750 % fällig am 23.01.2023 | | 2.600 | 2.632 |
| **Hana Bank** 3,250 % fällig am 30.03.2027 | | 2.500 | 2.493 |
| **NWD Finance BVI Ltd.** 6,150 % fällig am 16.03.2025 | | 2.400 | 2.400 |
| **United Overseas Bank Ltd.** 1,750 % fällig am 16.03.2031 | | 2.500 | 2.376 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 8.133.363 $ | 80.962 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **AIA Group Ltd.** 2,700 % fällig am 07.04.2023 | $ | 4.800 | 4.511 |
| **Sunny Express Enterprises Corp.** 2,950 % fällig am 01.03.2027 | | 3.900 | 3.869 |
| **Malaysia Government International Bond** 3,900 % fällig am 30.11.2026 | MYR | 14.300 | 3.464 |
| **Pertamina Persero PT** 2,300 % fällig am 09.02.2031 | $ | 3.800 | 3.193 |
| **China Construction Bank Corp.** 2,850 % fällig am 21.01.2032 | | 3.400 | 3.189 |
| **Reliance Industries Ltd.** 2,875 % fällig am 12.01.2032 | | 3.000 | 2.615 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** 2,564 % fällig am 13.09.2031 | | 2.900 | 2.428 |
| **Indonesia Government International Bond** 1,300 % fällig am 23.03.2034 | € | 2.800 | 2.293 |
| **Development Bank of the Philippines** 2,375 % fällig am 11.03.2031 | $ | 2.400 | 2.148 |
| **Prudential PLC** 2,950 % fällig am 03.11.2033 | | 2.300 | 2.107 |
| **Dianjian Haiyu Ltd.** 4,300 % fällig am 20.06.2024 | | 2.000 | 2.045 |
| **Bangkok Bank PCL** 3,466 % fällig am 23.09.2036 | | 2.300 | 2.010 |
| **Asahi Mutual Life Insurance Co.** 4,100 % fällig am 27.01.2023 | | 2.100 | 1.934 |
| **Dah Sing Bank Ltd.** 1,000 % fällig am 02.11.2031 | | 1.900 | 1.890 |
| **Lendlease Finance Ltd.** 3,400 % fällig am 27.10.2027 | AUD | 2.800 | 1.860 |
| **BOC Aviation Ltd.** 1,750 % fällig am 21.01.2026 | $ | 2.000 | 1.836 |
| **SF Holding Investment Ltd.** 3,125 % fällig am 17.11.2031 | | 1.900 | 1.801 |
| **Azure Power Solar Energy Pvt Ltd.** 5,650 % fällig am 24.12.2024 | | 1.700 | 1.782 |
| **Beijing Gas Singapore Capital Corp.** 1,875 % fällig am 18.01.2025 | | 1.800 | 1.731 |

(a) Der Asia Strategic Interest Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | |
| **Credit Suisse Group AG** 9,750 % fällig am 23.06.2027 | $ | 77.000 $ | 77.000 |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** 6,500 % | € | 50.300 | 74.676 |
| | | **AKTIEN** | |
| **Wells Fargo & Co.** | | 1.197.200 | 63.954 |
| **Bank of America Corp.** | | 1.429.200 | 63.135 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | 438.400 | 62.632 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **BNP Paribas S.A.** 4,625 % fällig am 12.01.2027 | $ | 60.100 | 57.959 |
| **Societe Generale S.A.** 6,221 % fällig am 15.06.2033 | | 56.800 | 56.800 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 4.681.874 | 46.603 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Bank of America Corp.** 1,843 % fällig am 04.02.2025 | $ | 44.500 | 44.500 |
| **Barclays PLC** 8,875 % fällig am 15.09.2027 | £ | 36.200 | 44.430 |
| **Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen** 5,875 % fällig am 23.05.2042 | $ | 39.400 | 39.400 |
| **UBS Group AG** 4,875 % fällig am 12.02.2027 | | 38.400 | 38.400 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** 4,875 % fällig am 29.06.2029 | € | 32.800 | 36.620 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** 6,375 % fällig am 30.03.2028 | | 29.000 | 31.904 |
| **Deutsche Bank AG** 6,750 % fällig am 30.10.2028 | | 26.200 | 28.744 |
| **Deutsche Bank AG** 4,000 % fällig am 24.06.2032 | | 25.000 | 27.643 |
| **AIB Group PLC** 6,250 % fällig am 23.06.2025 | | 21.200 | 23.698 |
| **Erste Group Bank AG** 4,250 % fällig am 15.10.2027 | | 24.200 | 23.655 |
| **Electricite de France S.A.** 2,875 % fällig am 15.12.2026 | | 21.600 | 22.668 |
| **BNP Paribas S.A.** 5,125 % fällig am 15.11.2022 | $ | 20.500 | 20.572 |
| **ING Groep NV** 3,875 % fällig am 16.05.2027 | | 22.500 | 19.994 |
| **Bank of Ireland Group PLC** 7,500 % fällig am 19.05.2025 | € | 18.200 | 19.213 |
| **UBS Group AG** 4,875 % fällig am 12.02.2027 | $ | 19.100 | 19.123 |
| **BCP Modular Services Finance PLC** 4,750 % fällig am 30.11.2028 | € | 19.300 | 18.739 |
| **NatWest Group PLC** 4,600 % fällig am 28.06.2031 | $ | 19.559 | 18.436 |
| **Nordea Bank Abp** 3,750 % fällig am 01.03.2029 | | 20.200 | 18.052 |
| **Virgin Money UK PLC** 8,250 % fällig am 17.06.2027 | £ | 13.734 | 17.269 |
| **de Volksbank NV** 7,000 % fällig am 15.12.2027 | € | 16.000 | 17.170 |
| **AXA S.A.** 4,250 % fällig am 10.03.2043 | | 15.600 | 16.590 |
| **Lloyds Banking Group PLC** 4,947 % fällig am 27.06.2025 | | 15.800 | 16.516 |
| **Credit Suisse Group AG** 6,375 % fällig am 21.08.2026 | $ | 15.700 | 16.367 |
| **Commerzbank AG** 6,500 % fällig am 09.10.2029 | € | 14.600 | 15.714 |
| **Credit Suisse Group AG** 5,250 % fällig am 11.02.2027 | $ | 15.150 | 15.208 |
| **UBS Group AG** 4,375 % fällig am 10.02.2031 | | 15.411 | 13.848 |
| **Banco Santander S.A.** 5,250 % fällig am 29.09.2023 | € | 11.200 | 13.289 |
| **CaixaBank S.A.** 6,375 % fällig am 19.09.2023 | | 10.800 | 13.189 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)** | | 4.576.800 $ | 459.765 |
| **Bank of America Corp.** | | 3.585.748 | 156.263 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | 720.500 | 97.236 |
| **Wells Fargo & Co.** | | 1.929.696 | 95.435 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **UBS AG** 1,750 % fällig am 21.04.2022 | $ | 85.273 | 85.421 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** 6,000 % fällig am 29.03.2024 | € | 67.400 | 70.243 |
| | | **AKTIEN** | |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | 146.782 | 53.847 |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 5.333.730 | 53.101 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** 5,875 % fällig am 24.09.2023 | € | 44.000 | 52.732 |
| | | **AKTIEN** | |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | 70.635.700 | 50.317 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **UBS AG** 7,625 % fällig am 17.08.2022 | $ | 41.200 | 41.752 |
| **Lloyds Banking Group PLC** 7,625 % fällig am 27.06.2023 | £ | 28.400 | 38.940 |
| **UniCredit SpA** 9,250 % fällig am 03.06.2022 | € | 30.000 | 32.890 |
| **Deutsche Bank AG** 5,625 % fällig am 19.05.2031 | | 25.200 | 29.547 |
| **Nationwide Building Society** 5,750 % fällig am 20.06.2027 | £ | 20.800 | 27.204 |
| **Standard Chartered PLC** 4,750 % fällig am 14.01.2031 | $ | 29.400 | 26.423 |
| **Credit Agricole S.A.** 7,500 % fällig am 23.06.2026 | £ | 21.000 | 25.853 |
| **Credit Suisse Group AG** 7,500 % fällig am 17.07.2023 | $ | 24.800 | 24.526 |
| **HSBC Holdings PLC** 6,000 % fällig am 22.05.2027 | | 24.100 | 24.392 |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** 6,500 % | € | 20.900 | 23.695 |
| **Virgin Money UK PLC** 7,875 % fällig am 14.12.2028 | £ | 16.440 | 23.106 |

(a) Der PIMCO Capital Securities Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** 1,375 % fällig am 07.06.2032 | € | 13.700 $ | 13.200 |
| **Europäische Investitionsbank** 1,500 % fällig am 15.06.2032 | | 5.600 | 5.927 |
| **U.S. Treasury Notes** 1,125 % fällig am 15.01.2025 | $ | 3.600 | 3.583 |
| **Vonovia SE** 2,375 % fällig am 25.03.2032 | € | 2.700 | 2.954 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** 2,000 % fällig am 15.11.2029 | | 2.400 | 2.503 |
| **Canada Government International Bond** 2,250 % fällig am 01.12.2029 | CAD | 2.800 | 2.212 |
| **Deutsche Bank AG** 1,875 % fällig am 23.02.2028 | € | 1.900 | 2.149 |
| **Telus Corp.** 3,400 % fällig am 13.05.2032 | $ | 1.900 | 1.895 |
| **ABN AMRO Bank NV** 2,470 % fällig am 13.12.2029 | | 2.000 | 1.812 |
| **NE Property BV** 2,000 % fällig am 20.01.2030 | € | 1.400 | 1.584 |
| **Bundesrepublik Deutschland** 0,000 % fällig am 15.08.2031 | | 1.400 | 1.464 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** 2,472 % fällig am 14.01.2029 | $ | 1.300 | 1.300 |
| **Amgen, Inc.** 3,000 % fällig am 22.02.2029 | | 1.300 | 1.296 |
| **Logicor Financing SARL** 2,000 % fällig am 17.01.2034 | € | 1.100 | 1.230 |
| **Svensk Exportkredit AB** 2,000 % fällig am 30.06.2027 | | 1.100 | 1.158 |
| **NXP BV** 5,000 % fällig am 15.01.2033 | $ | 1.100 | 1.097 |
| **GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust** 4,000 % fällig am 20.04.2049 | | 1.100 | 1.085 |
| **BPCE S.A.** 0,500 % fällig am 14.01.2028 | € | 900 | 1.011 |
| **Indian Railway Finance Corp. Ltd.** 3,570 % fällig am 21.01.2032 | $ | 1.000 | 1.000 |
| **Goodman U.S. Finance Five LLC** 4,625 % fällig am 04.05.2032 | | 1.000 | 998 |
| **Zenith Finco PLC** 6,500 % fällig am 30.06.2027 | £ | 700 | 956 |
| **AES Corp.** 1,375 % fällig am 15.01.2026 | $ | 1.000 | 918 |
| **Rayonier LP** 2,750 % fällig am 17.05.2031 | | 1.000 | 906 |
| **Duke Energy Carolinas LLC** 2,850 % fällig am 15.03.2032 | | 900 | 899 |
| **Severn Trent Utilities Finance PLC** 2,625 % fällig am 22.02.2033 | £ | 600 | 809 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** 3,261 % fällig am 22.05.2030 | $ | 800 | 800 |
| **Chile Government International Bond** 2,750 % fällig am 31.01.2027 | | 800 | 800 |
| **Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.** 2,800 % fällig am 10.03.2027 | | 800 | 799 |
| **ESB Finance DAC** 1,000 % fällig am 19.07.2034 | € | 700 | 793 |
| **Dominion Energy, Inc.** 2,250 % fällig am 15.08.2031 | $ | 900 | 756 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | |
| **Realty Income Corp.** 1,125 % fällig am 13.07.2027 | £ | 1.800 $ | 2.266 |
| **CTP NV** 0,625 % fällig am 27.09.2026 | € | 2.100 | 2.228 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** 0,750 % fällig am 30.09.2030 | $ | 2.100 | 1.743 |
| **Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement** 0,125 % fällig am 16.09.2025 | € | 1.400 | 1.530 |
| **Boston Properties LP** 3,400 % fällig am 21.06.2029 | $ | 1.400 | 1.451 |
| **HAT Holdings LLC** 3,375 % fällig am 15.06.2026 | | 1.500 | 1.365 |
| **Hilton Domestic Operating Co., Inc.** 4,875 % fällig am 15.01.2030 | | 1.200 | 1.180 |
| **Enel Finance International NV** 2,650 % fällig am 10.09.2024 | | 1.200 | 1.170 |
| **Wesfarmers Ltd.** 0,954 % fällig am 21.10.2033 | € | 1.200 | 1.079 |
| **Nidec Corp.** 0,046 % fällig am 30.03.2026 | | 900 | 975 |
| **Natura Cosmeticos S.A.** 4,125 % fällig am 03.05.2028 | $ | 1.000 | 927 |
| **Mondelez International Holdings Netherlands BV** 0,625 % fällig am 09.09.2032 | € | 900 | 812 |
| **Xylem, Inc.** 2,250 % fällig am 30.01.2031 | $ | 900 | 774 |
| **Equitable Financial Life Global Funding** 1,300 % fällig am 12.07.2026 | | 800 | 759 |
| **MTR Corp. Ltd.** 1,625 % fällig am 19.08.2030 | | 900 | 759 |
| **ESB Finance DAC** 1,000 % fällig am 19.07.2034 | € | 700 | 645 |
| **DNB Bank ASA** 0,375 % fällig am 18.01.2028 | | 600 | 623 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** 6,000 % fällig am 15.01.2026 | | 600 | 623 |
| **AXA S.A.** 1,375 % fällig am 07.10.2041 | | 600 | 586 |
| **Sunnova Energy Corp.** 5,875 % fällig am 01.09.2026 | $ | 630 | 571 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** 0,934 % fällig am 11.10.2024 | € | 500 | 567 |
| **Starwood Property Trust, Inc.** 4,375 % fällig am 15.01.2027 | $ | 600 | 560 |
| **Stora Enso Oyj** 2,500 % fällig am 21.03.2028 | € | 500 | 557 |
| **Hilton Domestic Operating Co., Inc.** 4,000 % fällig am 01.05.2031 | $ | 500 | 471 |
| **Yanlord Land HK Co. Ltd.** 5,125 % fällig am 20.05.2026 | | 500 | 435 |
| **Bank of Ireland Group PLC** 0,375 % fällig am 10.05.2027 | € | 400 | 426 |
| **HSBC Holdings PLC** 3,033 % fällig am 22.11.2023 | $ | 400 | 400 |
| **Kia Corp.** 1,000 % fällig am 16.04.2024 | | 400 | 391 |
| **Greenko Solar Mauritius Ltd.** 5,950 % fällig am 29.07.2026 | | 400 | 382 |
| **Citigroup, Inc.** 3,875 % fällig am 18.02.2022 | | 400 | 378 |
| **Banco BTG Pactual S.A.** 2,750 % fällig am 11.01.2026 | | 400 | 376 |
| **Greenko Power Ltd.** 4,300 % fällig am 13.12.2028 | | 400 | 349 |
| **Development Bank of Japan, Inc.** 0,010 % fällig am 15.10.2024 | € | 300 | 335 |

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.10.2026 (a) | $ | 122.432 | $ | 130.556 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,625 % fällig am 15.01.2024 (a) | | 61.007 | | 63.239 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,250 % fällig am 15.01.2025 (a) | | 31.808 | | 33.578 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.01.2032 (a) | | 30.382 | | 32.909 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.10.2025 (a) | | 29.633 | | 31.799 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,500 % fällig am 15.01.2028 (a) | | 29.625 | | 31.196 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.04.2027 (a) | | 28.645 | | 29.365 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.10.2024 (a) | | 27.416 | | 29.144 |
| **Spain Government International Bond** 0,650 % fällig am 30.11.2027 | € | 24.564 | | 28.729 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 0,100 % fällig am 15.05.2033 | | 22.885 | | 26.551 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,625 % fällig am 15.04.2023 (a) | $ | 25.206 | | 26.094 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 1,400 % fällig am 26.05.2025 | € | 21.190 | | 24.723 |
| **France Government International Bond** 0,100 % fällig am 25.07.2031 | | 18.355 | | 24.376 |
| **France Government International Bond** 0,100 % fällig am 01.03.2025 | | 18.245 | | 22.059 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,375 % fällig am 15.07.2027 (a) | $ | 19.033 | | 20.029 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,375 % fällig am 15.07.2025 (a) | | 18.135 | | 19.615 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.01.2023 (a) | | 18.081 | | 18.608 |
| **Nykredit Realkredit A/S** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 119.700 | | 16.300 |
| **Spain Government International Bond** 0,150 % fällig am 30.11.2023 | € | 12.305 | | 14.693 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 2,350 % fällig am 15.09.2024 | | 11.607 | | 14.680 |
| **Bundesrepublik Deutschland** 0,100 % fällig am 15.04.2023 | | 12.523 | | 14.671 |
| **France Government International Bond** 1,500 % fällig am 25.05.2031 | | 11.800 | | 11.658 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.04.2026 (a) | $ | 11.042 | | 11.569 |
| **OCP Euro CLO DAC** 0,820 % fällig am 15.01.2032 | € | 10.100 | | 10.993 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.04.2022 (a) | $ | 61.136 | $ | 61.472 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 0,400 % fällig am 15.05.2030 | € | 45.115 | | 52.461 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.07.2031 (a) | $ | 35.104 | | 34.168 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 0,100 % fällig am 15.05.2033 | € | 17.197 | | 15.480 |
| **France Government International Bond** 1,500 % fällig am 25.05.2031 | | 11.800 | | 11.720 |
| **France Government International Bond** 0,100 % fällig am 25.07.2031 | | 10.039 | | 10.822 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.01.2023 (a) | $ | 9.816 | | 10.071 |
| **France Government International Bond** 0,100 % fällig am 01.03.2029 | € | 8.694 | | 9.453 |
| **Japan Government International Bond** 0,100 % fällig am 10.03.2028 | ¥ | 538.082 | | 4.829 |
| **Japan Government International Bond** 0,005 % fällig am 10.03.2031 | | 363.883 | | 3.329 |
| **Nykredit Realkredit A/S** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 27.700 | | 3.194 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.01.2030 (a) | $ | 2.582 | | 2.851 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.01.2031 (a) | | 2.065 | | 2.061 |
| **Credit-Based Asset Servicing and Securitization LLC** 2,674 % fällig am 25.06.2035 | | 1.995 | | 1.995 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.07.2030 (a) | | 1.727 | | 1.919 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.02.2051 (a) | | 658 | | 573 |
| **Qatar Government International Bond** 3,875 % fällig am 23.04.2023 | | 300 | | 304 |
| **Peru Government International Bond** 6,150 % fällig am 12.08.2032 | PEN | 1.100 | | 282 |
| **Realkredit Danmark A/S** 1,000 % fällig am 01.10.2053 | DKK | 1.300 | | 152 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,375 % fällig am 15.01.2027 (a) | $ | 115 | | 124 |

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **U.S. Treasury Notes** 2,875 % fällig am 15.05.2032 | $ | 2.100 | $ | 2.098 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,750 % fällig am 30.04.2027 | | 2.100 | | 2.087 |
| **South Africa Government International Bond** 10,500 % fällig am 21.12.2026 | ZAR | 26.800 | | 1.962 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,500 % fällig am 30.04.2024 | $ | 1.900 | | 1.895 |
| **U.S. Treasury Bonds** 1,875 % fällig am 15.11.2051 | | 1.759 | | 1.649 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 142.627 | | 1.420 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **U.S. Treasury Bonds** 2,000 % fällig am 15.11.2041 | $ | 1.200 | | 1.179 |
| **U.S. Treasury Notes** 1,875 % fällig am 15.02.2032 | | 1.187 | | 1.112 |
| **Weyerhaeuser Co.** 4,000 % fällig am 09.03.2052 | | 1.125 | | 998 |
| **American Tower Corp.** 2,950 % fällig am 15.01.2051 | | 1.425 | | 948 |
| **Market Bidco Finco PLC** 4,750 % fällig am 04.11.2027 | € | 800 | | 733 |
| **American International Group, Inc.** 3,750 % fällig am 10.07.2025 | $ | 700 | | 730 |
| **Magallanes, Inc.** 5,141 % fällig am 15.03.2052 | | 775 | | 720 |
| **NCL Corp. Ltd.** 5,875 % fällig am 15.02.2027 | | 700 | | 674 |
| **HCA, Inc.** 4,625 % fällig am 15.03.2052 | | 725 | | 669 |
| **NXP BV** 3,250 % fällig am 11.05.2041 | | 875 | | 665 |
| **Intercontinental Exchange, Inc.** 3,000 % fällig am 15.09.2060 | | 975 | | 652 |
| **Boeing Co.** 3,950 % fällig am 01.08.2059 | | 900 | | 647 |
| **Baxter International, Inc.** 3,132 % fällig am 01.12.2051 | | 900 | | 644 |
| **T-Mobile USA, Inc.** 3,600 % fällig am 15.11.2060 | | 875 | | 636 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** 4,950 % fällig am 28.05.2027 | | 600 | | 600 |
| **American Homes 4 Rent LP** 3,375 % fällig am 15.07.2051 | | 600 | | 422 |
| **Caesars Entertainment, Inc.** 6,250 % fällig am 01.07.2025 | | 400 | | 414 |
| **American Airlines Pass-Through Trust** 3,375 % fällig am 01.11.2028 | | 406 | | 402 |
| **United Airlines, Inc.** 4,625 % fällig am 15.04.2029 | | 400 | | 400 |
| **U.S. Treasury Notes** 1,375 % fällig am 15.11.2031 | | 406 | | 386 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 301.765 | $ | 3.003 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Caesars Entertainment, Inc.** 6,250 % fällig am 01.07.2025 | $ | 1.500 | | 1.550 |
| **U.S. Treasury Bonds** 1,875 % fällig am 15.11.2051 | | 1.759 | | 1.536 |
| **Cornerstone Building Brands, Inc.** 4,574 % fällig am 12.04.2028 | | 1.440 | | 1.333 |
| **U.S. Treasury Bonds** 1,875 % fällig am 15.02.2041 | | 1.347 | | 1.293 |
| **U.S. Treasury Bonds** 2,000 % fällig am 15.11.2041 | | 1.400 | | 1.201 |
| **U.S. Treasury Notes** 1,875 % fällig am 15.02.2032 | | 1.187 | | 1.078 |
| **Live Nation Entertainment, Inc.** 6,500 % fällig am 15.05.2027 | | 1.000 | | 1.054 |
| **Carnival Corp.** 4,000 % fällig am 01.08.2028 | | 1.000 | | 983 |
| **Endeavor Energy Resources LP** 5,750 % fällig am 30.01.2028 | | 700 | | 724 |
| **Marks & Spencer PLC** 3,750 % fällig am 19.05.2026 | £ | 500 | | 686 |
| **Viking Cruises Ltd.** 13,000 % fällig am 15.05.2025 | $ | 600 | | 661 |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** 3,000 % fällig am 29.03.2025 | € | 600 | | 615 |
| **Twin River Worldwide Holdings, Inc.** 1,000 % fällig am 02.20.2028 | $ | 599 | | 596 |
| **TransDigm, Inc.** 3,916 % fällig am 09.12.2025 | | 594 | | 584 |
| **Hertz Corp.** 4,625 % fällig am 01.12.2026 | | 600 | | 563 |
| **Air Canada** 3,875 % fällig am 15.08.2026 | | 600 | | 551 |
| **Royal Caribbean Cruises Ltd.** 11,500 % fällig am 01.06.2025 | | 477 | | 522 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** 3,625 % fällig am 17.06.2031 | | 500 | | 516 |
| **Jaguar Land Rover Automotive PLC** 5,625 % fällig am 01.02.2023 | | 500 | | 501 |
| **Bellis Acquisition Co. PLC** 3,250 % fällig am 16.02.2026 | £ | 500 | | 493 |
| **NCL Corp. Ltd.** 5,875 % fällig am 15.02.2027 | $ | 500 | | 491 |
| **CPUK Finance Ltd.** 4,875 % fällig am 28.08.2025 | £ | 400 | | 478 |
| **PRA Group, Inc.** 7,375 % fällig am 01.09.2025 | $ | 450 | | 464 |
| **NatWest Group PLC** 5,076 % fällig am 27.01.2030 | | 400 | | 440 |
| **Sabre GLBL, Inc.** 9,250 % fällig am 15.04.2025 | | 400 | | 438 |
| **Chesapeake Energy Corp.** 6,750 % fällig am 15.04.2029 | | 400 | | 424 |
| **Weyerhaeuser Co.** 7,375 % fällig am 15.03.2032 | | 300 | | 409 |
| **Resolute Forest Products, Inc.** 4,875 % fällig am 01.03.2026 | | 400 | | 402 |
| **Grifols Escrow Issuer S.A.** 4,750 % fällig am 15.10.2028 | | 400 | | 399 |
| **Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC** 5,500 % fällig am 01.05.2028 | | 450 | | 397 |
| **U.S. Treasury Notes** 1,375 % fällig am 15.11.2031 | | 406 | | 383 |
| **PUG LLC** 5,166 % fällig am 12.02.2027 | | 397 | | 377 |
| **Ortho-Clinical Diagnostics S.A.** 4,553 % fällig am 30.06.2025 | | 376 | | 376 |

(a) Der PIMCO Credit Opportunities Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 28.535.128 $ | 284.035 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Nexi SpA** 2,125 % fällig am 30.04.2029 | € | 43.300 | 47.439 |
| **Organon & Co.** 2,875 % fällig am 30.04.2028 | | 39.000 | 42.644 |
| **Volvo Car AB** 4,250 % fällig am 31.05.2028 | | 31.900 | 33.996 |
| **Atlantia SpA** 1,875 % fällig am 12.02.2028 | | 28.800 | 31.235 |
| **Corsair International Ltd.** 4,850 % fällig am 28.01.2027 | | 18.800 | 20.989 |
| **Vmed O2 UK Financing PLC** 4,000 % fällig am 31.01.2029 | £ | 15.600 | 19.959 |
| **Prosus NV** 3,680 % fällig am 21.01.2030 | $ | 20.200 | 19.911 |
| **Market Bidco Finco PLC** 4,750 % fällig am 04.11.2027 | € | 21.200 | 19.425 |
| **Albion Financing SARL** 5,250 % fällig am 15.10.2026 | | 16.700 | 18.641 |
| **Deutsche Bank AG** 2,552 % fällig am 07.01.2028 | $ | 15.600 | 15.600 |
| **TDC Net A/S** 5,056 % fällig am 31.05.2028 | € | 12.800 | 13.730 |
| **CPI Property Group S.A.** 1,750 % fällig am 14.01.2030 | | 10.700 | 11.875 |
| **United Group BV** 5,250 % fällig am 01.02.2030 | | 9.400 | 10.773 |
| **UniCredit SpA** 1,982 % fällig am 03.06.2027 | $ | 11.200 | 10.457 |
| **Volkswagen Financial Services AG** 0,875 % fällig am 31.01.2028 | € | 8.900 | 10.024 |
| **Nova Kreditna Banka Maribor d.d.** 1,875 % fällig am 27.01.2025 | | 8.500 | 9.638 |
| **AA Bond Co. Ltd.** 7,375 % fällig am 31.07.2050 | £ | 7.800 | 9.455 |
| **Corsair International Ltd.** 5,200 % fällig am 28.01.2029 | € | 8.200 | 9.134 |
| **Holding d'Infrastructures de Transport SASU** 1,475 % fällig am 18.01.2031 | | 7.800 | 8.916 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 34.595.561 $ | 344.300 |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)** | | 2.862.000 | 286.774 |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (a)** | | 20.706.660 | 209.000 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Saudi Arabia Government International Bond** 4,500 % fällig am 26.10.2046 | $ | 125.200 | 118.350 |
| **Qatar Government International Bond** 4,400 % fällig am 16.04.2050 | | 58.900 | 56.894 |
| **Occidental Petroleum Corp.** 5,500 % fällig am 01.12.2025 | | 52.000 | 53.474 |
| **South Africa Government International Bond** 5,750 % fällig am 30.09.2049 | | 55.900 | 48.665 |
| **AT&T, Inc.** 3,650 % fällig am 15.09.2059 | | 53.173 | 45.787 |
| **Emirate of Abu Dhabi Government International Bond** 2,700 % fällig am 02.09.2070 | | 55.300 | 45.379 |
| **UPC Broadband Finco BV** 4,875 % fällig am 15.07.2031 | | 51.900 | 43.372 |
| **Abertis Infraestructuras S.A.** 3,375 % fällig am 27.11.2026 | £ | 27.500 | 38.225 |
| **Indonesia Government International Bond** 0,900 % fällig am 14.02.2027 | € | 37.483 | 38.074 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** 1,361 % fällig am 20.07.2045 | £ | 28.193 | 37.867 |
| **Indonesia Government International Bond** 4,625 % fällig am 15.04.2043 | $ | 35.100 | 37.450 |
| **Iliad Holding SASU** 6,500 % fällig am 15.10.2026 | | 37.150 | 36.370 |
| **Albion Financing SARL** 5,250 % fällig am 17.08.2026 | € | 32.354 | 34.855 |
| **Saudi Government International Bond** 4,000 % fällig am 17.04.2025 | $ | 31.500 | 33.225 |
| **Turkey Government International Bond** 4,875 % fällig am 09.10.2026 | | 38.100 | 30.682 |
| **Turkey Government International Bond** 5,125 % fällig am 17.02.2028 | | 38.300 | 29.911 |
| **Petroleos Mexicanos** 5,950 % fällig am 28.01.2031 | | 36.000 | 29.384 |

(a) Der Diversified Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 1.869.684 | $ | 18.610 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Organon & Co.** 2,875 % fällig am 30.04.2028 | € | 4.200 | | 4.584 |
| **SIG Combibloc Purchase Co. SARL** 1,875 % fällig am 18.06.2023 | | 3.900 | | 4.102 |
| **Nexi SpA** 2,125 % fällig am 30.04.2029 | | 3.600 | | 3.944 |
| **Petroleos Mexicanos** 4,875 % fällig am 21.02.2028 | | 2.500 | | 2.839 |
| **Volvo Car AB** 4,250 % fällig am 31.05.2028 | | 2.600 | | 2.771 |
| **Atlantia SpA** 1,875 % fällig am 12.02.2028 | | 1.900 | | 2.058 |
| **CPI Property Group S.A.** 1,750 % fällig am 14.01.2030 | | 1.800 | | 1.998 |
| **Altice Financing S.A.** 3,000 % fällig am 15.01.2028 | | 2.000 | | 1.952 |
| **Corsair International Ltd.** 4,850 % fällig am 28.01.2027 | | 1.600 | | 1.786 |
| **Albion Financing SARL** 5,250 % fällig am 15.10.2026 | | 1.600 | | 1.786 |
| **Prosus NV** 3,680 % fällig am 21.01.2030 | $ | 1.700 | | 1.676 |
| **Market Bidco Finco PLC** 4,750 % fällig am 04.11.2027 | € | 1.700 | | 1.558 |
| **Nova Kreditna Banka Maribor d.d.** 1,875 % fällig am 27.01.2025 | | 1.200 | | 1.361 |
| **TDC Net A/S** 5,056 % fällig am 31.05.2028 | | 1.100 | | 1.180 |
| **Bacardi Ltd.** 2,750 % fällig am 03.07.2023 | | 1.000 | | 1.072 |
| **United Group BV** 5,250 % fällig am 01.02.2030 | | 900 | | 1.031 |
| **Vmed O2 UK Financing PLC** 4,000 % fällig am 31.01.2029 | £ | 800 | | 1.024 |
| **Luminent Mortgage Trust** 2,024 % fällig am 25.10.2046 | $ | 767 | | 718 |
| **Prosus NV** 4,193 % fällig am 19.01.2032 | | 700 | | 700 |
| **Deutsche Bank AG** 3,742 % fällig am 07.01.2033 | | 700 | | 700 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** 4,950 % fällig am 28.05.2027 | | 700 | | 700 |
| **Corsair International Ltd.** 5,200 % fällig am 28.01.2029 | € | 600 | | 668 |
| **Petroleos Mexicanos** 6,750 % fällig am 21.09.2047 | $ | 800 | | 663 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)** | | 327.300 | $ | 32.718 |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (a)** | | 1.585.189 | | 16.000 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Saudi Arabia Government International Bond** 4,500 % fällig am 26.10.2046 | $ | 11.900 | | 12.530 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 1.135.461 | | 11.300 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Qatar Government International Bond** 4,400 % fällig am 16.04.2050 | $ | 5.500 | | 5.225 |
| **Deutsche Bank AG** 1,625 % fällig am 20.01.2027 | € | 4.500 | | 5.161 |
| **HSBC Holdings PLC** 4,300 % fällig am 08.03.2026 | $ | 3.900 | | 4.188 |
| **AerCap Ireland Capital DAC** 3,150 % fällig am 15.02.2024 | | 3.800 | | 3.873 |
| **Pertamina Persero PT** 6,500 % fällig am 07.11.2048 | | 3.700 | | 3.780 |
| **Petroleos Mexicanos** 4,875 % fällig am 21.02.2028 | € | 4.000 | | 3.771 |
| **HSBC Holdings PLC** 3,900 % fällig am 25.05.2026 | $ | 3.400 | | 3.596 |
| **South Africa Government International Bond** 5,750 % fällig am 30.09.2049 | | 4.000 | | 3.449 |
| **FCE Bank PLC** 1,134 % fällig am 10.02.2022 | € | 3.000 | | 3.364 |
| **AerCap Ireland Capital DAC** 4,625 % fällig am 15.10.2027 | $ | 3.100 | | 3.335 |
| **AA Bond Co. Ltd.** 5,500 % fällig am 31.07.2050 | £ | 2.271 | | 3.324 |
| **Peru Government International Bond** 3,300 % fällig am 11.03.2041 | $ | 3.400 | | 3.196 |
| **Iliad Holding SASU** 6,500 % fällig am 15.10.2026 | | 3.200 | | 3.134 |
| **Indonesia Government International Bond** 4,625 % fällig am 15.04.2043 | | 3.500 | | 3.128 |
| **Sinopec Group Overseas Development Ltd.** 2,150 % fällig am 13.05.2025 | | 2.900 | | 2.908 |
| **UniCredit SpA** 2,200 % fällig am 22.07.2027 | € | 2.500 | | 2.905 |

(a) Der Diversified Income Duration Hedged Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 10.374.264 | $ | 103.249 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Harmony French Home Loans** 0,301 % fällig am 27.05.2062 | € | 7.500 | | 8.412 |
| **JPMorgan Chase & Co.** 2,595 % fällig am 24.02.2026 | $ | 6.400 | | 6.400 |
| **Babson CLO Ltd.** 2,053 % fällig am 20.01.2031 | | 5.700 | | 5.659 |
| **Aurium CLO DAC** 1,050 % fällig am 23.03.2032 | € | 5.000 | | 5.487 |
| **Stratton BTL Mortgage Funding** 1,217 % fällig am 20.01.2054 | £ | 3.800 | | 5.151 |
| **OCP Euro CLO DAC** 0,820 % fällig am 15.01.2032 | € | 4.000 | | 4.336 |
| **Citigroup, Inc.** 3,290 % fällig am 17.03.2026 | $ | 4.300 | | 4.300 |
| **Madison Park Funding Ltd.** 1,794 % fällig am 15.04.2029 | | 3.967 | | 3.935 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** 1,944 % fällig am 25.10.2036 | | 10.099 | | 3.781 |
| **Shamrock Residential DAC** 0,338 % fällig am 24.01.2061 | € | 3.500 | | 3.762 |
| **Societe Generale S.A.** 4,677 % fällig am 15.06.2027 | $ | 3.700 | | 3.700 |
| **Constellation Brands, Inc.** 3,600 % fällig am 09.05.2024 | | 3.500 | | 3.498 |
| **Ginnie Mae** 4,000 % fällig am 15.02.2052 | | 3.280 | | 3.295 |
| **Magallanes, Inc.** 3,528 % fällig am 15.03.2024 | | 3.100 | | 3.100 |
| **GSK Consumer Healthcare Capital UK PLC** 3,125 % fällig am 24.03.2025 | | 3.000 | | 2.992 |
| **AMMC CLO 21 Ltd.** 2,536 % fällig am 02.11.2030 | | 2.400 | | 2.394 |
| **Prologis International Funding S.A.** 3,125 % fällig am 01.06.2031 | € | 2.200 | | 2.307 |
| **Balder Finland Oyj** 1,000 % fällig am 18.01.2027 | | 1.800 | | 2.031 |
| **Morgan Stanley** 2,630 % fällig am 18.02.2026 | $ | 2.000 | | 2.000 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 17.199.530 | $ | 171.170 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **U.S. Treasury Notes** 1,875 % fällig am 31.07.2022 | $ | 46.570 | | 46.592 |
| **U.S. Treasury Notes** 1,375 % fällig am 31.10.2028 | | 41.550 | | 40.065 |
| **U.S. Treasury Notes** 0,875 % fällig am 15.11.2030 | | 35.600 | | 33.048 |
| **U.S. Treasury Notes** 0,500 % fällig am 28.02.2026 | | 30.100 | | 28.181 |
| **Lloyds Banking Group PLC** 7,625 % fällig am 27.06.2023 | £ | 20.128 | | 27.598 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,000 % fällig am 31.07.2022 | $ | 19.900 | | 19.915 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,375 % fällig am 15.05.2029 | | 7.700 | | 8.046 |
| **U.S. Treasury Notes** 1,750 % fällig am 15.07.2022 | | 7.740 | | 7.743 |
| **U.S. Treasury Notes** 0,250 % fällig am 30.09.2025 | | 7.600 | | 7.105 |
| **Peru Government International Bond** 6,350 % fällig am 12.08.2028 | PEN | 27.500 | | 6.898 |
| **Transocean, Inc.** 7,250 % fällig am 01.11.2025 | $ | 8.000 | | 6.700 |
| **Darrowby PLC** 1,320 % fällig am 20.12.2057 | £ | 4.195 | | 5.506 |
| **Qatar Government International Bond** 4,500 % fällig am 23.04.2028 | $ | 5.100 | | 5.247 |
| **Friary PLC** 1,358 % fällig am 21.11.2067 | £ | 3.675 | | 4.880 |
| **U.S. Treasury Notes** 0,625 % fällig am 15.08.2030 | $ | 5.100 | | 4.645 |
| **U.S. Treasury Bonds** 2,500 % fällig am 15.02.2045 | | 4.220 | | 4.472 |
| **BK LC Lux Finco SARL** 5,250 % fällig am 30.04.2029 | € | 4.800 | | 4.472 |
| **Saudi Government International Bond** 3,625 % fällig am 04.03.2028 | $ | 4.000 | | 3.905 |
| **Carnival Corp.** 4,000 % fällig am 01.08.2028 | | 4.000 | | 3.601 |

(a) Der Dynamic Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **Japan Treasury Bills** 0,000 % fällig am 30.05.2022 | ¥ | 13.700.000 | € | 104.930 |
| **Japan Treasury Bills** 0,000 % fällig am 27.06.2022 | | 13.690.000 | | 104.065 |
| **Bundesrepublik Deutschland** 1,750 % fällig am 04.07.2022 | € | 71.900 | | 72.302 |
| **Japan Treasury Bills** 0,000 % fällig am 01.08.2022 | ¥ | 9.030.000 | | 65.254 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **Merck & Co., Inc.** | | 364.700 | | 29.252 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **France Treasury Bills** 0,000 % fällig am 16.03.2022 | € | 29.000 | | 29.005 |
| **Europäische Union** 0,000 % fällig am 05.05.2022 | | 27.800 | | 27.844 |
| **European Union Treasury Bills** 0,000 % fällig am 05.08.2022 | | 27.000 | | 27.036 |
| **Bundesrepublik Deutschland** 0,000 % fällig am 08.04.2022 | | 23.900 | | 23.907 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **GXO Logistics, Inc.** | | 287.100 | | 21.813 |
| Micron Technology, Inc. | | 288.300 | | 19.570 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 0,579 % fällig am 07.02.2025 | € | 17.700 | | 17.861 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **Cigna Corp.** | | 76.900 | | 17.747 |
| **Humana, Inc.** | | 39.500 | | 14.807 |
| **ABB Ltd.** | | 446.800 | | 14.589 |
| **Schneider Electric SE** | | 104.100 | | 14.566 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Hill FL BV** 0,202 % fällig am 18.05.2030 | € | 13.700 | | 13.700 |
| **Polaris 2022-2 PLC** 2,241 % fällig am 23.05.2059 | £ | 11.300 | | 13.237 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **ITM Power PLC** | | 2.640.362 | | 11.544 |
| **Molina Healthcare, Inc.** | | 40.500 | | 11.501 |
| **Xinyi Solar Holdings Ltd.** | | 6.722.500 | | 10.858 |
| **thyssenkrupp AG** | | 1.278.600 | | 10.856 |
| **AbbVie, Inc.** | | 77.300 | | 10.782 |
| **Chugai Pharmaceutical Co. Ltd.** | | 347.000 | | 10.599 |
| **Titan Wind Energy Suzhou Co. Ltd. 'A'** | | 3.792.647 | | 10.492 |
| **Regeneron Pharmaceuticals, Inc.** | | 14.800 | | 9.594 |
| **Vertex Pharmaceuticals, Inc.** | | 37.800 | | 9.544 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd.** | | 14.474.222 | € | 66.490 |
| **Apple, Inc.** | | 254.600 | | 40.709 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **France Treasury Bills** 0,000 % fällig am 04.05.2022 | € | 38.200 | | 38.227 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **Alphabet, Inc.** | | 14.350 | | 34.118 |
| **Stora Enso Oyj 'R'** | | 1.623.100 | | 29.009 |
| **COSCO Shipping Holdings Co. Ltd.** | | 16.606.137 | | 28.378 |
| **Baidu, Inc.** | | 193.550 | | 25.544 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Bundesrepublik Deutschland** 1,750 % fällig am 04.07.2022 | € | 24.900 | | 24.952 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **Fortum Oyj** | | 1.135.200 | | 24.717 |
| **Coinbase Global, Inc.** | | 144.300 | | 22.903 |
| **Mondi PLC** | | 1.312.400 | | 22.734 |
| **AP Moller - Maersk A/S** | | 7.781 | | 22.659 |
| **Genscript Biotech Corp.** | | 6.344.400 | | 21.951 |
| **Tokyo Electron Ltd.** | | 45.300 | | 21.874 |
| **Regeneron Pharmaceuticals, Inc.** | | 38.100 | | 21.273 |
| **Mastercard, Inc.** | | 64.600 | | 20.834 |
| **Lundin Mining Corp.** | | 2.103.409 | | 17.451 |
| **Holmen AB 'B'** | | 336.200 | | 17.011 |
| **Arista Networks, Inc.** | | 133.300 | | 16.545 |
| **West Fraser Timber Co. Ltd.** | | 183.100 | | 15.373 |
| **PayPal Holdings, Inc.** | | 154.900 | | 14.951 |
| **Gilead Sciences, Inc.** | | 194.400 | | 11.183 |
| **Biogen, Inc.** | | 53.900 | | 11.171 |
| **Nintendo Co. Ltd.** | | 22.400 | | 10.000 |
| **Kubota Corp.** | | 593.600 | | 9.907 |
| **UPM-Kymmene Oyj** | | 337.300 | | 9.870 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Hyundai Capital America** 0,800 % fällig am 03.04.2023 | $ | 10.800 | | 9.634 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **AbbVie, Inc.** | | 63.200 | | 9.313 |
| **Incyte Corp.** | | 131.400 | | 9.204 |
| **Otsuka Holdings Co. Ltd.** | | 294.300 | | 9.032 |
| **Cigna Corp.** | | 38.450 | | 9.001 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Volkswagen Leasing GmbH** 0,000 % fällig am 12.07.2023 | € | 9.000 | | 8.958 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **Canon, Inc.** | | 376.800 | | 8.903 |
| **Deere & Co.** | | 24.200 | | 8.419 |

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 86.575.958 $ | 861.690 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Indonesia Government International Bond** 6,375 % fällig am 15.04.2032 | IDR | 1.782.171.000 | 116.427 |
| **Singapore Government International Bond** 1,625 % fällig am 01.07.2031 | SGD | 61.700 | 44.253 |
| **Colombian TES** 6,250 % fällig am 26.11.2025 | COP | 182.766.900 | 42.071 |
| **Thailand Government International Bond** 2,000 % fällig am 17.12.2031 | THB | 1.479.000 | 41.413 |
| **Indonesia Government International Bond** 9,000 % fällig am 15.03.2029 | IDR | 516.966.000 | 40.816 |
| **Singapore Government International Bond** 2,875 % fällig am 01.09.2030 | SGD | 40.900 | 32.942 |
| **Indonesia Government International Bond** 8,375 % fällig am 15.03.2034 | IDR | 430.372.000 | 32.106 |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos** 5,000 % fällig am 01.10.2028 | CLP | 22.890.000 | 27.303 |
| **Poland Government International Bond** 2,750 % fällig am 25.04.2028 | PLN | 139.500 | 26.786 |
| **Colombian TES** 7,500 % fällig am 26.08.2026 | COP | 91.722.200 | 22.284 |
| **Malaysia Government International Bond** 3,900 % fällig am 30.11.2026 | MYR | 87.500 | 21.344 |
| **Indonesia Government International Bond** 6,500 % fällig am 15.02.2031 | IDR | 304.540.000 | 21.253 |
| **Thailand Government International Bond** 1,585 % fällig am 17.12.2035 | THB | 809.400 | 20.886 |
| **South Africa Government International Bond** 10,500 % fällig am 21.12.2026 | ZAR | 293.300 | 20.482 |
| **Indonesia Government International Bond** 7,000 % fällig am 15.09.2030 | IDR | 278.789.000 | 20.018 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Global Investors Series PLC - Emerging Markets Opportunities Fund (a)** | | 1.946.138 | 19.150 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Malaysia Government International Bond** 3,465 % fällig am 15.10.2030 | MYR | 80.200 | 18.801 |
| **Thailand Government International Bond** 2,875 % fällig am 17.12.2028 | THB | 624.900 | 18.635 |
| **Malaysia Government Investment Issue** 4,369 % fällig am 31.10.2028 | MYR | 73.600 | 18.267 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 87.909.982 $ | 875.000 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **China Development Bank** 3,000 % fällig am 07.08.2023 | CNY | 510.900 | 81.460 |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos** 5,000 % fällig am 01.10.2028 | CLP | 54.900.000 | 61.660 |
| **Indonesia Government International Bond** 6,375 % fällig am 15.04.2032 | IDR | 929.507.000 | 60.958 |
| **Thailand Government International Bond** 1,585 % fällig am 17.12.2035 | THB | 2.021.650 | 48.290 |
| **China Development Bank** 3,420 % fällig am 02.07.2024 | CNY | 260.700 | 42.006 |
| **Singapore Government International Bond** 1,625 % fällig am 01.07.2031 | SGD | 61.700 | 41.482 |
| **Thailand Government International Bond** 2,000 % fällig am 17.12.2031 | THB | 1.482.500 | 41.463 |
| **Indonesia Government International Bond** 8,375 % fällig am 15.03.2034 | IDR | 554.211.000 | 41.334 |
| **Indonesia Government International Bond** 9,000 % fällig am 15.03.2029 | | 516.966.000 | 40.590 |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos** 2,500 % fällig am 01.03.2025 | CLP | 31.660.000 | 35.236 |
| **Singapore Government International Bond** 3,375 % fällig am 01.09.2033 | SGD | 40.850 | 34.728 |
| **Malaysia Government International Bond** 3,733 % fällig am 15.06.2028 | MYR | 143.800 | 33.551 |
| **Singapore Government International Bond** 2,875 % fällig am 01.09.2030 | SGD | 40.900 | 30.723 |
| **China Development Bank** 3,090 % fällig am 18.06.2030 | CNY | 185.500 | 29.176 |
| **Deutsche Bank AG** 6,680 % fällig am 23.01.2025 | IDR | 398.800.000 | 28.307 |
| **BNP Paribas S.A.** 6,240 % fällig am 06.02.2025 | | 396.200.000 | 27.661 |
| **China Government Bond** 3,280 % fällig am 03.12.2027 | CNY | 169.290 | 25.741 |
| **Malaysia Government Investment Issue** 4,369 % fällig am 31.10.2028 | MYR | 96.300 | 23.436 |
| **Egypt Government International Bond** 13,765 % fällig am 05.01.2024 | EGP | 370.700 | 23.377 |
| **Malaysia Government International Bond** 3,828 % fällig am 05.07.2034 | MYR | 99.500 | 23.338 |
| **Malaysia Government International Bond** 3,900 % fällig am 30.11.2026 | | 87.500 | 21.176 |

(a) Der Emerging Local Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 30.309.792 $ | 301.641 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Israel Treasury Bills** 0,000 % fällig am 03.05.2023 | ILS | 132.800 | 38.211 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Global Investors Series PLC - Emerging Markets Opportunities Fund (a)** | | 3.577.236 | 35.200 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S** 7,250 % fällig am 24.02.2027 | $ | 34.400 | 34.400 |
| **Angolan Government International Bond** 8,750 % fällig am 14.04.2032 | | 20.500 | 20.470 |
| **Hungary Government International Bond** 5,250 % fällig am 16.06.2029 | | 17.800 | 17.585 |
| **Corsair International Ltd.** 4,850 % fällig am 28.01.2027 | € | 15.600 | 17.416 |
| **Chile Government International Bond** 4,340 % fällig am 07.03.2042 | $ | 14.800 | 14.788 |
| **BOI Finance BV** 7,500 % fällig am 16.02.2027 | € | 12.900 | 14.743 |
| **Republic of Angola Via Avenir Issuer Ireland DAC** 6,927 % fällig am 19.02.2027 | $ | 15.571 | 14.678 |
| **Israel Electric Corp. Ltd.** 3,750 % fällig am 22.02.2032 | | 13.800 | 13.757 |
| **Chile Government International Bond** 2,750 % fällig am 31.01.2027 | | 13.400 | 13.338 |
| **Colombia Government International Bond** 4,000 % fällig am 26.02.2024 | | 12.900 | 13.248 |
| **Petronas Capital Ltd.** 3,404 % fällig am 28.04.2061 | | 14.000 | 12.804 |
| **Steas Funding DAC** 7,230 % fällig am 17.03.2026 | | 12.500 | 12.431 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (a)** | | 1.110.057 | 11.700 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Chile Government International Bond** 3,500 % fällig am 31.01.2034 | $ | 11.300 | 11.292 |
| **Egypt Government International Bond** 5,875 % fällig am 16.02.2031 | | 13.000 | 10.879 |
| **Singapore Airlines Ltd.** 3,375 % fällig am 19.01.2029 | | 10.300 | 10.225 |
| **Panama Government International Bond** 4,500 % fällig am 19.01.2063 | | 10.200 | 10.136 |
| **Dominican Republic Government International Bond** 5,500 % fällig am 22.02.2029 | | 10.100 | 10.100 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 46.717.975 $ | 464.931 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S** 7,250 % fällig am 24.02.2027 | $ | 34.400 | 34.017 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (a)** | | 3.053.291 | 28.396 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Ukraine Government International Bond** 7,750 % fällig am 01.09.2022 | $ | 26.600 | 25.689 |
| **Chile Government International Bond** 3,100 % fällig am 07.05.2041 | | 27.300 | 24.316 |
| **Ivory Coast Government International Bond** 5,250 % fällig am 22.03.2030 | € | 22.250 | 20.501 |
| **Angolan Government International Bond** 8,750 % fällig am 14.04.2032 | $ | 20.200 | 19.828 |
| **Indonesia Asahan Aluminium Persero PT** 5,450 % fällig am 15.05.2030 | | 16.800 | 17.917 |
| **Ecuador Government International Bond** 1,000 % fällig am 31.07.2035 | | 25.400 | 16.672 |
| **KSA Sukuk Ltd.** 2,250 % fällig am 17.05.2031 | | 14.100 | 13.265 |
| **Indonesia Government International Bond** 6,750 % fällig am 15.01.2044 | | 9.650 | 13.191 |
| **Egypt Government International Bond** 7,600 % fällig am 30.06.2029 | | 13.700 | 13.084 |
| **Israel Electric Corp. Ltd.** 3,750 % fällig am 22.02.2032 | | 12.700 | 11.466 |
| **Airport Authority Hong Kong** 2,400 % fällig am 08.03.2028 | | 12.100 | 10.850 |
| **Angolan Government International Bond** 9,375 % fällig am 08.05.2048 | | 10.500 | 9.536 |
| **Angolan Government International Bond** 8,000 % fällig am 26.11.2029 | | 9.500 | 9.423 |
| **SPIC MTN Co. Ltd.** 1,625 % fällig am 27.07.2025 | | 9.600 | 9.151 |
| **Nigeria Government International Bond** 8,747 % fällig am 21.01.2031 | | 10.000 | 9.078 |
| **Egypt Government International Bond** 4,750 % fällig am 11.04.2025 | € | 8.300 | 8.951 |
| **Sinopec Group Overseas Development Ltd.** 2,700 % fällig am 13.05.2030 | $ | 9.800 | 8.682 |

(a) Der Emerging Markets Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S** 7,250 % fällig am 24.02.2027 | $ | 20.300 | $ | 20.300 |
| **Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia** 4,700 % fällig am 06.06.2032 | | 16.900 | | 16.900 |
| **Kazakhstan Government International Bond** 6,500 % fällig am 21.07.2045 | | 13.700 | | 14.456 |
| **Panama Government International Bond** 4,500 % fällig am 19.01.2063 | | 14.500 | | 14.409 |
| **South Africa Government International Bond** 5,875 % fällig am 20.04.2032 | | 13.500 | | 13.500 |
| **Ecuador Government International Bond** 1,000 % fällig am 31.07.2035 | | 21.400 | | 13.391 |
| **Chile Government International Bond** 2,750 % fällig am 31.01.2027 | | 13.100 | | 13.009 |
| **Fondo MIVIVIENDA S.A.** 4,625 % fällig am 12.04.2027 | | 13.000 | | 12.955 |
| **Indonesia Government International Bond** 5,250 % fällig am 17.01.2042 | | 11.400 | | 12.027 |
| **Indian Railway Finance Corp. Ltd.** 3,570 % fällig am 21.01.2032 | | 11.700 | | 11.701 |
| **Hungary Government International Bond** 5,250 % fällig am 16.06.2029 | | 11.600 | | 11.460 |
| **Kenya Government International Bond** 6,875 % fällig am 24.06.2024 | | 12.900 | | 11.146 |
| **South Africa Government International Bond** 7,300 % fällig am 20.04.2052 | | 11.000 | | 11.000 |
| **Chile Government International Bond** 4,340 % fällig am 07.03.2042 | | 10.700 | | 10.691 |
| **Ivory Coast Government International Bond** 5,250 % fällig am 22.03.2030 | € | 9.000 | | 8.987 |
| **Shinhan Bank Co. Ltd.** 4,375 % fällig am 13.04.2032 | $ | 9.000 | | 8.956 |
| **Corsair International Ltd.** 4,850 % fällig am 28.01.2027 | € | 7.900 | | 8.820 |
| **Serbia Government International Bond** 1,650 % fällig am 03.03.2033 | | 10.000 | | 8.715 |
| **Natura Cosmeticos S.A.** 4,125 % fällig am 03.05.2028 | $ | 8.800 | | 8.428 |
| **Export-Import Bank of Korea** 2,125 % fällig am 18.01.2032 | | 8.000 | | 7.961 |
| **Turkey Government International Bond** 5,750 % fällig am 11.05.2047 | | 10.200 | | 7.895 |
| **KB Kookmin Card Co. Ltd.** 4,000 % fällig am 09.06.2025 | | 7.900 | | 7.894 |
| **Asian Development Bank** 6,550 % fällig am 26.01.2025 | ZAR | 118.000 | | 7.723 |
| **Dominican Republic Government International Bond** 5,500 % fällig am 22.02.2029 | $ | 7.400 | | 7.400 |
| **NMC OpCo Ltd.** 7,000 % fällig am 25.03.2027 | AED | 24.487 | | 6.910 |
| **Chile Government International Bond** 3,500 % fällig am 31.01.2034 | $ | 6.900 | | 6.895 |
| **Hanwha Life Insurance Co. Ltd.** 3,379 % fällig am 04.02.2032 | | 6.700 | | 6.700 |
| **America Movil S.A.B. de C.V.** 5,375 % fällig am 04.04.2032 | | 6.500 | | 6.500 |
| **Korea Water Resources Corp.** 3,500 % fällig am 27.04.2025 | | 6.500 | | 6.479 |
| **Argentina Government International Bond** 2,500 % fällig am 09.07.2041 | | 19.400 | | 6.377 |
| **NE Property BV** 2,000 % fällig am 20.01.2030 | € | 5.600 | | 6.335 |
| **Credit Suisse Group AG** 9,750 % fällig am 23.06.2027 | $ | 5.900 | | 5.900 |
| **Kazakhstan Government International Bond** 1,550 % fällig am 09.11.2023 | € | 5.140 | | 5.632 |
| **Russia Government International Bond** 4,375 % fällig am 21.03.2029 | $ | 5.000 | | 5.188 |
| **Ghana Government International Bond** 8,750 % fällig am 11.03.2061 | | 8.000 | | 5.120 |
| **Sweihan PV Power Co. PJSC** 3,625 % fällig am 31.01.2049 | | 5.100 | | 5.100 |
| **Colombia Government International Bond** 4,000 % fällig am 26.02.2024 | | 5.000 | | 5.075 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **Egypt Government International Bond** 5,250 % fällig am 06.10.2025 | $ | 22.400 | $ | 20.520 |
| **Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S** 7,250 % fällig am 24.02.2027 | | 20.300 | | 20.097 |
| **Ecuador Government International Bond** 5,000 % fällig am 31.07.2030 | | 13.200 | | 11.450 |
| **Indonesia Government International Bond** 4,350 % fällig am 11.01.2048 | | 11.400 | | 11.022 |
| **Mongolia Government International Bond** 4,450 % fällig am 07.07.2031 | | 12.200 | | 10.885 |
| **Indonesia Government International Bond** 5,250 % fällig am 17.01.2042 | | 10.300 | | 10.467 |
| **Ukraine Government International Bond** 7,750 % fällig am 01.09.2022 | | 8.800 | | 8.565 |
| **UltraTech Cement Ltd.** 2,800 % fällig am 16.02.2031 | | 8.000 | | 7.491 |
| **Uruguay Government International Bond** 4,375 % fällig am 23.01.2031 | | 6.604 | | 7.116 |
| **Ivory Coast Government International Bond** 5,250 % fällig am 22.03.2030 | € | 7.300 | | 6.728 |
| **Klabin Austria GmbH** 3,200 % fällig am 12.01.2031 | $ | 7.200 | | 6.200 |
| **Akbank T.A.S.** 6,800 % fällig am 22.06.2031 | | 6.500 | | 6.135 |
| **Dominican Republic Government International Bond** 4,875 % fällig am 23.09.2032 | | 7.500 | | 6.088 |
| **Turkiye Vakiflar Bankasi TAO** 5,500 % fällig am 01.10.2026 | | 6.800 | | 6.061 |
| **Israel Government International Bond** 3,800 % fällig am 13.05.2060 | | 5.500 | | 5.725 |
| **Emirate of Abu Dhabi Government International Bond** 3,125 % fällig am 30.09.2049 | | 5.497 | | 5.324 |
| **Indonesia Government International Bond** 6,750 % fällig am 15.01.2044 | | 4.300 | | 5.060 |
| **TC Ziraat Bankasi A/S** 5,375 % fällig am 02.03.2026 | | 5.500 | | 4.991 |
| **Russia Government International Bond** 5,100 % fällig am 28.03.2035 | | 9.600 | | 4.824 |
| **Emirate of Abu Dhabi Government International Bond** 2,700 % fällig am 02.09.2070 | | 5.400 | | 4.658 |
| **Absa Group Ltd.** 6,375 % fällig am 27.05.2026 | | 4.600 | | 4.512 |
| **Chile Government International Bond** 3,500 % fällig am 31.01.2034 | | 5.000 | | 4.456 |
| **Turkiye Vakiflar Bankasi TAO** 6,500 % fällig am 08.01.2026 | | 4.600 | | 4.311 |
| **Kenya Government International Bond** 8,000 % fällig am 22.05.2032 | | 5.000 | | 4.269 |
| **Ecuador Government International Bond** 1,000 % fällig am 31.07.2035 | | 5.900 | | 3.972 |
| **Ecuador Government International Bond** 0,500 % fällig am 31.07.2040 | | 6.700 | | 3.923 |
| **Morocco Government International Bond** 3,000 % fällig am 15.12.2032 | | 5.000 | | 3.860 |
| **Egypt Government International Bond** 7,600 % fällig am 30.06.2029 | | 4.000 | | 3.821 |
| **Senegal Government International Bond** 6,250 % fällig am 23.05.2033 | | 4.000 | | 3.575 |
| **Suzano Austria GmbH** 2,500 % fällig am 15.09.2028 | | 3.800 | | 3.457 |
| **Egypt Government International Bond** 7,500 % fällig am 16.02.2061 | | 5.000 | | 3.369 |

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 5.065.241 | $ | 50.414 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** 3,750 % fällig am 09.05.2027 | € | 2.100 | | 2.159 |
| **Samba Funding Ltd.** 2,900 % fällig am 29.01.2027 | $ | 1.700 | | 1.717 |
| **LG Chem Ltd.** 3,625 % fällig am 15.04.2029 | | 1.600 | | 1.532 |
| **Fab Sukuk Co. Ltd.** 3,875 % fällig am 22.01.2024 | | 1.500 | | 1.513 |
| **Saudi Arabian Oil Co.** 4,250 % fällig am 16.04.2039 | | 1.500 | | 1.439 |
| **Indian Railway Finance Corp. Ltd.** 3,570 % fällig am 21.01.2032 | | 1.400 | | 1.303 |
| **NBK SPC Ltd.** 1,625 % fällig am 15.09.2027 | | 1.200 | | 1.075 |
| **Israel Electric Corp. Ltd.** 3,750 % fällig am 22.02.2032 | | 1.000 | | 997 |
| **CT Trust** 5,125 % fällig am 03.02.2032 | | 1.000 | | 960 |
| **Kookmin Bank** 2,500 % fällig am 04.11.2030 | | 1.100 | | 937 |
| **Freeport Indonesia PT** 4,763 % fällig am 14.04.2027 | | 900 | | 900 |
| **Medco Oak Tree Pte. Ltd.** 7,375 % fällig am 14.05.2026 | | 700 | | 716 |
| **Altice Financing S.A.** 3,000 % fällig am 15.01.2028 | € | 700 | | 682 |
| **Shriram Transport Finance Co. Ltd.** 4,150 % fällig am 18.07.2025 | $ | 700 | | 681 |
| **Reliance Industries Ltd.** 2,875 % fällig am 12.01.2032 | | 600 | | 599 |
| **America Movil S.A.B. de C.V.** 5,375 % fällig am 04.04.2032 | | 500 | | 500 |
| **Pertamina Persero PT** 5,625 % fällig am 20.05.2043 | | 500 | | 479 |
| **NE Property BV** 2,000 % fällig am 20.01.2030 | € | 400 | | 453 |
| **Antofagasta PLC** 2,375 % fällig am 14.10.2030 | $ | 500 | | 417 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 5.274.912 | $ | 52.500 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **South Africa Government International Bond** 10,500 % fällig am 21.12.2026 | ZAR | 35.500 | | 2.341 |
| **Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.** 6,000 % fällig am 27.11.2023 | $ | 2.200 | | 2.295 |
| **Saudi Arabian Oil Co.** 2,875 % fällig am 16.04.2024 | | 1.400 | | 1.385 |
| **Lenovo Group Ltd.** 5,875 % fällig am 24.04.2025 | | 1.300 | | 1.346 |
| **Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari A/S** 6,950 % fällig am 14.03.2026 | | 1.100 | | 1.075 |
| **Altice Financing S.A.** 2,250 % fällig am 15.01.2025 | € | 900 | | 952 |
| **Tullow Oil PLC** 10,250 % fällig am 15.05.2026 | $ | 900 | | 920 |
| **Deutsche Bank AG** 3,547 % fällig am 18.09.2031 | | 900 | | 785 |
| **Amipeace Ltd.** 2,250 % fällig am 22.10.2030 | | 850 | | 750 |
| **Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.** 4,950 % fällig am 23.03.2027 | | 800 | | 731 |
| **Israel Electric Corp. Ltd.** 4,250 % fällig am 14.08.2028 | | 700 | | 687 |
| **Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.** 1,832 % fällig am 10.09.2030 | | 750 | | 686 |
| **Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.** 6,125 % fällig am 15.05.2029 | | 600 | | 672 |
| **Sands China Ltd.** 4,875 % fällig am 18.06.2030 | | 800 | | 669 |
| **Kuwait Projects Co. SPC Ltd.** 4,500 % fällig am 23.02.2027 | | 700 | | 657 |
| **Tingyi Cayman Islands Holding Corp.** 1,625 % fällig am 24.09.2025 | | 700 | | 656 |
| **Vale Overseas Ltd.** 6,875 % fällig am 21.11.2036 | | 600 | | 648 |
| **Dominican Republic Government International Bond** 5,300 % fällig am 21.01.2041 | | 600 | | 585 |
| **TML Holdings Pte. Ltd.** 4,350 % fällig am 09.06.2026 | | 600 | | 543 |

(a) Der Emerging Markets Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 7.235.506 $ | 72.028 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **U.S. Treasury Bonds** 2,375 % fällig am 15.02.2042 | $ | 24.500 | 23.653 |
| **Singapore Government International Bond** 2,875 % fällig am 01.07.2029 | SGD | 16.052 | 12.395 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,500 % fällig am 30.04.2024 | $ | 5.600 | 5.586 |
| **Israel Treasury Bills** 0,000 % fällig am 07.10.2022 | ILS | 19.000 | 5.530 |
| **Empresa de los Ferrocarriles del Estado** 3,068 % fällig am 18.08.2050 | $ | 5.100 | 3.689 |
| **Israel Treasury Bills** 0,000 % fällig am 08.02.2023 | ILS | 11.000 | 3.187 |
| **Dominican Republic Government International Bond** 5,300 % fällig am 21.01.2041 | $ | 3.700 | 3.105 |
| **Israel Government International Bond** 1,250 % fällig am 30.11.2022 | ILS | 9.300 | 2.952 |
| **Vale S.A.** 0,000 % | BRL | 29.580 | 2.941 |
| **Mong Duong Finance Holdings BV** 5,125 % fällig am 07.05.2029 | $ | 2.800 | 2.548 |
| **Trust Fibra Uno** 6,390 % fällig am 15.01.2050 | | 2.500 | 2.535 |
| **LLPL Capital Pte. Ltd.** 6,875 % fällig am 04.02.2039 | | 2.528 | 2.534 |
| **Israel Treasury Bills** 0,000 % fällig am 03.05.2023 | ILS | 8.600 | 2.475 |
| **Petroleos del Peru S.A.** 5,625 % fällig am 19.06.2047 | $ | 3.000 | 2.430 |
| **Corsair International Ltd.** 4,850 % fällig am 28.01.2027 | € | 1.700 | 1.898 |
| **Globe Telecom, Inc.** 3,000 % fällig am 23.07.2035 | $ | 2.300 | 1.818 |
| **Prosus NV** 4,987 % fällig am 19.01.2052 | | 1.600 | 1.600 |
| **Ghana Government International Bond** 8,625 % fällig am 07.04.2034 | | 2.100 | 1.525 |
| **Ghana Government International Bond** 8,875 % fällig am 07.05.2042 | | 2.100 | 1.504 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 6.067.338 $ | 60.400 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Singapore Government International Bond** 2,875 % fällig am 01.07.2029 | SGD | 16.052 | 11.846 |
| **Singapore Government International Bond** 3,375 % fällig am 01.09.2033 | | 10.200 | 8.362 |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos** 5,000 % fällig am 01.10.2028 | CLP | 6.670.000 | 7.289 |
| **Emirate of Dubai Government International Bond** 3,900 % fällig am 09.09.2050 | $ | 4.700 | 3.956 |
| **Ecuador Government International Bond** 5,000 % fällig am 31.07.2030 | | 4.000 | 3.493 |
| **South Africa Government International Bond** 10,500 % fällig am 21.12.2026 | ZAR | 48.000 | 3.454 |
| **Dominican Republic Government International Bond** 5,300 % fällig am 21.01.2041 | $ | 4.500 | 3.434 |
| **Israel Government International Bond** 1,250 % fällig am 30.11.2022 | ILS | 9.300 | 2.814 |
| **Peru Government International Bond** 6,900 % fällig am 12.08.2037 | PEN | 11.800 | 2.757 |
| **LLPL Capital Pte. Ltd.** 6,875 % fällig am 04.02.2039 | $ | 2.528 | 2.414 |
| **Romania Government International Bond** 2,500 % fällig am 08.02.2030 | € | 2.500 | 2.400 |
| **Midwest Connector Capital Co. LLC** 3,900 % fällig am 01.04.2024 | $ | 2.000 | 2.070 |
| **Ghana Government International Bond** 8,875 % fällig am 07.05.2042 | | 3.600 | 1.998 |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos** 4,700 % fällig am 01.09.2030 | CLP | 1.900.000 | 1.968 |
| **Jordan Government International Bond** 7,375 % fällig am 10.10.2047 | $ | 2.200 | 1.954 |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos** 2,500 % fällig am 01.03.2025 | CLP | 1.820.000 | 1.909 |
| **Saudi Arabian Oil Co.** 3,250 % fällig am 24.11.2050 | $ | 2.000 | 1.835 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** 4,550 % fällig am 01.07.2030 | | 1.700 | 1.791 |
| **PTT Treasury Center Co. Ltd.** 3,700 % fällig am 16.07.2070 | | 2.000 | 1.745 |

(a) Der PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **Israel Treasury Bills** 0,000 % fällig am 07.10.2022 | ILS | 3.600 | $ | 1.048 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 70.356 | | 700 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Israel Treasury Bills** 0,000 % fällig am 08.02.2023 | ILS | 2.100 | | 608 |
| **Israel Treasury Bills** 0,000 % fällig am 03.05.2023 | | 1.600 | | 460 |
| **Steas Funding DAC** 7,230 % fällig am 17.03.2026 | $ | 200 | | 199 |
| **Flourish Century** 6,600 % fällig am 04.02.2049 | | 200 | | 194 |
| **Colombian TES** 6,250 % fällig am 26.11.2025 | COP | 760.000 | | 174 |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos** 5,800 % fällig am 01.06.2024 | CLP | 130.000 | | 161 |
| **Harbour Energy PLC** 1,405 % fällig am 28.01.2054 | £ | 100 | | 129 |
| **Corsair International Ltd.** 4,850 % fällig am 28.01.2027 | € | 100 | | 112 |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos** 4,500 % fällig am 01.03.2026 | CLP | 90.000 | | 107 |
| **Colombian TES** 7,500 % fällig am 26.08.2026 | COP | 411.300 | | 100 |
| **Rio Oil Finance Trust** 9,250 % fällig am 06.07.2024 | $ | 89 | | 96 |
| **Colombian TES** 5,750 % fällig am 03.11.2027 | COP | 458.100 | | 92 |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos** 2,500 % fällig am 01.03.2025 | CLP | 60.000 | | 68 |
| **Vale S.A.** 0,000 % | BRL | 590 | | 59 |
| **Poland Government International Bond** 0,250 % fällig am 25.10.2026 | PLN | 300 | | 55 |
| **South Africa Government International Bond** 10,500 % fällig am 21.12.2026 | ZAR | 800 | | 55 |
| **Ukraine Government International Bond** 7,750 % fällig am 01.09.2023 | $ | 100 | | 50 |
| **Poland Government International Bond** 2,750 % fällig am 25.10.2029 | PLN | 200 | | 40 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 70.334 | $ | 700 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos** 2,500 % fällig am 01.03.2025 | CLP | 430.000 | | 464 |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos** 5,000 % fällig am 01.10.2028 | | 255.000 | | 291 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (a)** | | 16.369 | | 220 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Banco Santander S.A.** 6,750 % fällig am 25.04.2022 | € | 200 | | 219 |
| **MAF Global Securities Ltd.** 4,750 % fällig am 07.05.2024 | $ | 200 | | 206 |
| **Growthpoint Properties International Pty. Ltd.** 5,872 % fällig am 02.05.2023 | | 200 | | 201 |
| **BOC Aviation Ltd.** 2,750 % fällig am 18.09.2022 | | 200 | | 200 |
| **Banco BTG Pactual S.A.** 4,500 % fällig am 10.01.2025 | | 200 | | 197 |
| **Egypt Government International Bond** 14,605 % fällig am 08.09.2025 | EGP | 3.100 | | 196 |
| **Sands China Ltd.** 5,125 % fällig am 08.08.2025 | $ | 200 | | 195 |
| **Health & Happiness H&H International Holdings Ltd.** 5,625 % fällig am 24.10.2024 | | 200 | | 174 |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos** 4,500 % fällig am 01.03.2026 | CLP | 150.000 | | 173 |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos** 5,800 % fällig am 01.06.2024 | | 130.000 | | 152 |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos** 4,700 % fällig am 01.09.2030 | | 135.000 | | 150 |
| **Ukraine Government International Bond** 7,750 % fällig am 01.09.2022 | $ | 200 | | 118 |
| **South Africa Government International Bond** 10,500 % fällig am 21.12.2026 | ZAR | 1.200 | | 83 |
| **Zambia Government International Bond** 13,000 % fällig am 25.01.2031 | ZMW | 1.900 | | 63 |
| **RCI Banque S.A.** 0,250 % fällig am 08.03.2023 | € | 28 | | 30 |
| **Zambia Government International Bond** 15,000 % fällig am 16.02.2027 | ZMW | 700 | | 29 |

(a) Der Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung** 3,000 % fällig am 27.09.2023 | $ | 10.950 | $ | 11.353 |
| **Asian Development Bank** 6,550 % fällig am 26.01.2025 | ZAR | 42.000 | | 2.746 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,375 % fällig am 31.03.2029 | $ | 2.100 | | 2.083 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** 1,934 % fällig am 25.08.2036 | | 2.727 | | 1.618 |
| **Barclays Commercial Mortgage Securities Trust** 4,498 % fällig am 10.08.2035 | | 1.600 | | 1.562 |
| **GSAMP Trust** 2,104 % fällig am 25.06.2036 | | 2.105 | | 1.500 |
| **InTown Hotel Portfolio Trust** 2,775 % fällig am 15.01.2033 | | 1.325 | | 1.316 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** 1,914 % fällig am 25.07.2036 | | 1.306 | | 1.311 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** 2,599 % fällig am 25.05.2035 | | 1.405 | | 1.311 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** 2,164 % fällig am 25.03.2036 | | 1.446 | | 1.311 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** 1,752 % fällig am 19.03.2037 | | 1.475 | | 1.291 |
| **280 Park Avenue Mortgage Trust** 2,271 % fällig am 15.09.2034 | | 1.300 | | 1.274 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** 2,124 % fällig am 25.08.2036 | | 1.287 | | 1.219 |
| **1211 Avenue of the Americas Trust** 4,280 % fällig am 10.08.2035 | | 1.295 | | 1.217 |
| **Natixis Commercial Mortgage Securities Trust** 3,917 % fällig am 15.11.2032 | | 1.200 | | 1.204 |
| **Liberty Street Trust** 4,501 % fällig am 10.02.2036 | | 1.100 | | 1.072 |
| **NXP BV** 5,000 % fällig am 15.01.2033 | | 1.000 | | 997 |
| **Indian Railway Finance Corp. Ltd.** 3,570 % fällig am 21.01.2032 | | 950 | | 950 |
| **MAD Mortgage Trust** 4,108 % fällig am 15.08.2034 | | 805 | | 806 |
| **RELX Capital, Inc.** 4,750 % fällig am 20.05.2032 | | 800 | | 793 |
| **Argent Securities Trust** 1,924 % fällig am 25.06.2036 | | 2.000 | | 737 |
| **Goodman U.S. Finance Five LLC** 4,625 % fällig am 04.05.2032 | | 700 | | 699 |
| **Soundview Home Loan Trust** 2,124 % fällig am 25.10.2036 | | 697 | | 668 |
| **BBCCRE Trust** 4,715 % fällig am 10.08.2033 | | 650 | | 655 |
| **Philippines Government International Bond** 4,200 % fällig am 29.03.2047 | | 650 | | 650 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Trust** 3,196 % fällig am 10.07.2034 | | 600 | | 602 |
| **Mosaic Solar Loans LLC** 4,450 % fällig am 20.06.2042 | | 603 | | 594 |
| **Logicor Financing SARL** 2,000 % fällig am 17.01.2034 | € | 500 | | 559 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **Philippines Government International Bond** 4,200 % fällig am 29.03.2047 | $ | 650 | $ | 680 |
| **UBS AG** 5,125 % fällig am 15.05.2024 | | 500 | | 506 |
| **Cyrusone Europe Finance DAC** 1,125 % fällig am 26.05.2028 | € | 400 | | 435 |
| **Azure Power Solar Energy Pvt Ltd.** 5,650 % fällig am 24.12.2024 | $ | 400 | | 402 |
| **Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.** 3,750 % fällig am 23.01.2023 | | 400 | | 401 |
| **NextEra Energy Operating Partners LP** 4,250 % fällig am 15.07.2024 | | 400 | | 400 |
| **Northern States Power Co.** 4,500 % fällig am 01.06.2052 | | 300 | | 309 |
| **Lloyds Banking Group PLC** 7,625 % fällig am 27.06.2023 | £ | 200 | | 274 |
| **Duke Energy Carolinas LLC** 3,550 % fällig am 15.03.2052 | $ | 330 | | 272 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** 3,096 % fällig am 04.05.2023 | | 200 | | 199 |
| **MAF Sukuk Ltd.** 3,933 % fällig am 28.02.2030 | | 200 | | 194 |
| **Boral Finance Pty. Ltd.** 3,750 % fällig am 01.05.2028 | | 200 | | 191 |
| **Public Service Co. of Oklahoma** 2,200 % fällig am 15.08.2031 | | 200 | | 171 |
| **Marks & Spencer PLC** 4,500 % fällig am 10.07.2027 | £ | 100 | | 140 |

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)** | | 2.115.800 € | 203.729 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **France Government International Bond** 0,100 % fällig am 25.07.2031 | € | 43.464 | 50.840 |
| **Belgium Government International Bond** 1,400 % fällig am 22.06.2053 | | 21.500 | 21.598 |
| **Spain Government International Bond** 3,450 % fällig am 30.07.2066 | | 15.200 | 20.989 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 3,850 % fällig am 01.09.2049 | | 16.300 | 18.883 |
| **Spain Government International Bond** 1,900 % fällig am 31.10.2052 | | 19.200 | 18.482 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** 2,000 % fällig am 15.11.2029 | | 17.100 | 16.959 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 2,150 % fällig am 01.09.2052 | | 19.000 | 15.523 |
| **Spain Government International Bond** 0,100 % fällig am 30.04.2031 | | 18.000 | 15.465 |
| **Electricite de France S.A.** 2,875 % fällig am 15.12.2026 | | 12.800 | 12.358 |
| **Spain Government International Bond** 2,550 % fällig am 31.10.2032 | | 11.000 | 10.998 |
| **Ripon Mortgages PLC** 1,351 % fällig am 28.08.2056 | £ | 8.600 | 10.237 |
| **France Government International Bond** 0,100 % fällig am 25.07.2038 | € | 9.287 | 10.088 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 0,100 % fällig am 15.05.2033 | | 9.764 | 10.028 |
| **Slovenia Government International Bond** 3,125 % fällig am 07.08.2045 | | 7.000 | 8.916 |
| **Slovenia Government International Bond** 1,175 % fällig am 13.02.2062 | | 8.410 | 8.389 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** 0,720 % fällig am 15.10.2031 | | 7.500 | 7.500 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 0,579 % fällig am 07.02.2025 | | 7.300 | 7.366 |
| **Credit Suisse AG** 0,862 % fällig am 31.05.2024 | | 6.800 | 6.800 |
| **DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH** 2,500 % fällig am 25.01.2027 | | 6.500 | 6.465 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** 0,092 % fällig am 07.12.2022 | | 6.400 | 6.368 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)** | | 1.740.000 € | 167.978 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 0,250 % fällig am 15.03.2028 | € | 79.900 | 67.436 |
| **Spain Government International Bond** 1,400 % fällig am 30.07.2028 | | 39.700 | 40.495 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.07.2030 (b) | $ | 31.915 | 30.374 |
| **Spain Government International Bond** 1,450 % fällig am 31.10.2027 | € | 29.500 | 28.120 |
| **France Government International Bond** 0,100 % fällig am 25.07.2031 | | 23.758 | 28.095 |
| **Japan Government International Bond** 0,100 % fällig am 10.03.2029 | ¥ | 3.469.624 | 27.423 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.07.2031 (b) | $ | 28.558 | 27.361 |
| **Spain Government International Bond** 1,950 % fällig am 30.04.2026 | € | 23.700 | 23.988 |
| **Spain Government International Bond** 0,800 % fällig am 30.07.2027 | | 23.500 | 22.386 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 0,400 % fällig am 15.05.2030 | | 19.399 | 20.294 |
| **France Government International Bond** 0,750 % fällig am 25.05.2052 | | 23.000 | 20.229 |
| **Spain Government International Bond** 1,000 % fällig am 31.10.2050 | | 22.000 | 17.486 |
| **Jyske Realkredit A/S** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 150.112 | 17.255 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** 0,000 % fällig am 15.09.2028 | € | 18.500 | 16.406 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 137.300 | 15.908 |
| **Nykredit Realkredit A/S** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 135.800 | 15.410 |
| **Dexia Credit Local S.A.** 0,000 % fällig am 29.05.2024 | € | 14.600 | 14.673 |
| **Spain Government International Bond** 1,450 % fällig am 31.10.2071 | | 17.771 | 13.648 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 2,800 % fällig am 01.03.2067 | | 14.200 | 12.963 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 2,150 % fällig am 01.03.2072 | | 16.600 | 12.535 |
| **Spain Government International Bond** 0,100 % fällig am 30.04.2031 | | 14.400 | 11.900 |
| **NatWest Group PLC** 2,500 % fällig am 22.03.2023 | | 10.300 | 10.631 |
| **Spain Government International Bond** 2,550 % fällig am 31.10.2032 | | 11.000 | 10.439 |
| **Spain Government International Bond** 1,400 % fällig am 30.04.2028 | | 10.600 | 10.012 |
| **Bank of China Ltd.** 0,950 % fällig am 21.09.2023 | $ | 10.350 | 9.253 |

(a) Der Euro Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)** | | 643.000 € | 62.211 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 0,875 % fällig am 09.05.2029 | € | 19.900 | 19.024 |
| **Banque Federative du Credit Mutuel S.A.** 0,625 % fällig am 19.11.2027 | | 15.400 | 15.300 |
| **Wells Fargo & Co.** 1,000 % fällig am 02.02.2027 | | 14.900 | 15.101 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** 0,603 % fällig am 13.09.2029 | | 10.100 | 9.851 |
| **Barclays PLC** 0,577 % fällig am 09.08.2029 | | 9.000 | 8.750 |
| **ABN AMRO Bank NV** 2,375 % fällig am 01.06.2027 | | 6.200 | 6.178 |
| **ABN AMRO Bank NV** 2,470 % fällig am 13.12.2029 | $ | 7.100 | 6.141 |
| **easyJet FinCo BV** 1,875 % fällig am 03.03.2028 | € | 6.000 | 6.059 |
| **SBB Treasury Oyj** 0,129 % fällig am 08.02.2024 | | 6.000 | 6.007 |
| **JAB Holdings BV** 4,750 % fällig am 29.06.2032 | | 5.600 | 5.600 |
| **Atlantia SpA** 1,875 % fällig am 12.02.2028 | | 5.200 | 5.213 |
| **Balder Finland Oyj** 1,375 % fällig am 24.05.2030 | | 5.300 | 5.128 |
| **Global Switch Holdings Ltd.** 1,500 % fällig am 31.01.2024 | | 4.800 | 4.832 |
| **CPI Property Group S.A.** 1,500 % fällig am 27.01.2031 | | 5.000 | 4.810 |
| **Societe Generale S.A.** 1,792 % fällig am 09.06.2027 | $ | 5.600 | 4.768 |
| **Vilmorin & Cie S.A.** 1,375 % fällig am 26.03.2028 | € | 4.400 | 4.400 |
| **Chanel Ceres PLC** 0,500 % fällig am 31.07.2026 | | 4.300 | 4.288 |
| **Lloyds Banking Group PLC** 3,750 % fällig am 18.03.2028 | $ | 4.600 | 4.216 |
| **GN Store Nord A/S** 0,875 % fällig am 25.11.2024 | € | 4.000 | 4.024 |
| **P3 Group SARL** 1,625 % fällig am 26.01.2029 | | 4.000 | 3.968 |
| **Dutch Property Finance BV** 0,320 % fällig am 28.10.2059 | | 3.700 | 3.689 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** 2,750 % fällig am 29.03.2028 | | 3.300 | 3.545 |
| **Sofina S.A.** 1,000 % fällig am 23.09.2028 | | 3.200 | 3.097 |
| **CTP NV** 0,875 % fällig am 20.01.2026 | | 3.100 | 3.092 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)** | | 785.000 € | 75.940 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 1,375 % fällig am 15.05.2024 | € | 18.700 | 18.962 |
| **ABN AMRO Bank NV** 2,470 % fällig am 13.12.2029 | $ | 17.200 | 14.207 |
| **Wells Fargo & Co.** 1,625 % fällig am 02.06.2025 | € | 12.400 | 12.933 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** 3,625 % fällig am 14.01.2026 | £ | 10.000 | 12.763 |
| **Credit Agricole S.A.** 0,500 % fällig am 21.09.2029 | € | 10.400 | 9.060 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 0,875 % fällig am 09.05.2029 | | 10.000 | 8.812 |
| **Barclays PLC** 3,125 % fällig am 17.01.2024 | £ | 6.000 | 7.397 |
| **Lloyds Banking Group PLC** 1,875 % fällig am 15.01.2026 | | 5.400 | 6.492 |
| **UniCredit SpA** 2,200 % fällig am 22.07.2027 | € | 6.700 | 6.376 |
| **Morgan Stanley** 1,342 % fällig am 23.10.2026 | | 6.300 | 6.275 |
| **Morgan Stanley** 1,000 % fällig am 02.12.2022 | | 6.000 | 6.053 |
| **Conti-Gummi Finance BV** 1,125 % fällig am 25.09.2024 | | 6.000 | 6.006 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 2,000 % fällig am 27.07.2023 | | 5.600 | 5.729 |
| **Societa' Per LA Gestione DI Attivita' SpA** 2,625 % fällig am 13.02.2024 | | 5.500 | 5.682 |
| **Volkswagen Financial Services AG** 0,875 % fällig am 12.04.2023 | | 5.600 | 5.598 |
| **Vonovia Finance BV** 0,625 % fällig am 09.07.2026 | | 6.000 | 5.549 |
| **HSBC Holdings PLC** 1,589 % fällig am 24.05.2027 | $ | 6.500 | 5.468 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** 2,625 % fällig am 15.01.2024 | € | 5.100 | 5.318 |
| **Bureau Veritas S.A.** 1,250 % fällig am 07.09.2023 | | 5.300 | 5.281 |
| **Thermo Fisher Scientific Finance BV** 0,000 % fällig am 18.11.2023 | | 5.200 | 5.204 |
| **Atlantia SpA** 1,875 % fällig am 12.02.2028 | | 5.200 | 4.698 |
| **Banco de Sabadell S.A.** 0,875 % fällig am 16.06.2028 | | 5.200 | 4.621 |
| **CaixaBank S.A.** 0,750 % fällig am 10.07.2026 | | 4.600 | 4.485 |
| **JAB Holdings BV** 1,625 % fällig am 30.04.2025 | | 4.200 | 4.376 |
| **Lloyds Banking Group PLC** 2,250 % fällig am 16.10.2024 | £ | 3.600 | 4.112 |

(a) Der Euro Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)** | | 1.882.500 | € | 181.850 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 1,250 % fällig am 07.02.2029 | € | 9.762 | | 9.731 |
| **P3 Group SARL** 1,625 % fällig am 26.01.2029 | | 9.800 | | 9.721 |
| **Societe Generale S.A.** 2,226 % fällig am 21.01.2026 | $ | 11.000 | | 9.700 |
| **Societe Generale S.A.** 2,797 % fällig am 19.01.2028 | | 10.800 | | 9.523 |
| **United Kingdom Gilt** 0,500 % fällig am 22.07.2022 | £ | 7.200 | | 8.606 |
| **Toro European CLO DAC** 0,920 % fällig am 12.01.2032 | € | 8.700 | | 8.548 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** 4,125 % fällig am 17.08.2027 | $ | 9.200 | | 8.494 |
| **Dutch Property Finance BV** 0,320 % fällig am 28.10.2059 | € | 7.400 | | 7.379 |
| **Digital Intrepid Holding BV** 1,375 % fällig am 18.07.2032 | | 7.500 | | 7.273 |
| **easyJet FinCo BV** 1,875 % fällig am 03.03.2028 | | 6.500 | | 6.566 |
| **Balder Finland Oyj** 2,000 % fällig am 18.01.2031 | | 6.500 | | 6.478 |
| **DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH** 2,500 % fällig am 25.01.2027 | | 6.400 | | 6.366 |
| **Jubilee Place BV** 0,402 % fällig am 17.01.2059 | | 6.300 | | 6.329 |
| **Carlyle Euro CLO DAC** 0,630 % fällig am 15.08.2030 | | 6.384 | | 6.297 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** 0,720 % fällig am 15.10.2031 | | 5.900 | | 5.897 |
| **Nexi SpA** 2,125 % fällig am 30.04.2029 | | 6.000 | | 5.817 |
| **Castellum Helsinki Finance Holding Abp** 2,000 % fällig am 24.03.2025 | | 5.500 | | 5.491 |
| **Primrose Residential DAC** 0,488 % fällig am 24.10.2061 | | 5.400 | | 5.393 |
| **Contego CLO DAC** 0,640 % fällig am 23.01.2030 | | 5.295 | | 5.231 |
| **UniCredit SpA** 3,127 % fällig am 03.06.2032 | $ | 6.000 | | 5.019 |
| **Volvo Car AB** 4,250 % fällig am 31.05.2028 | € | 4.700 | | 4.670 |
| **Balder Finland Oyj** 1,000 % fällig am 18.01.2027 | | 4.300 | | 4.278 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)** | | 1.624.600 | € | 157.248 |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (a)** | | 4.670.091 | | 42.399 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Jyske Realkredit A/S** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 233.848 | | 27.345 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 224.800 | | 26.089 |
| **Aeroporti di Roma SpA** 5,441 % fällig am 20.02.2023 | £ | 15.000 | | 18.581 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 0,875 % fällig am 09.05.2029 | € | 19.400 | | 17.942 |
| **Oman Government International Bond** 4,875 % fällig am 01.02.2025 | $ | 18.900 | | 17.292 |
| **Stratton Mortgage Funding PLC** 1,361 % fällig am 20.07.2060 | £ | 12.926 | | 15.425 |
| **InterContinental Hotels Group PLC** 1,625 % fällig am 08.10.2024 | € | 14.900 | | 15.125 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** 3,625 % fällig am 24.09.2024 | | 14.800 | | 14.267 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** 1,000 % fällig am 01.10.2053 | DKK | 113.874 | | 14.074 |
| **Ivory Coast Government International Bond** 5,250 % fällig am 22.03.2030 | € | 14.400 | | 14.000 |
| **ABN AMRO Bank NV** 2,470 % fällig am 13.12.2029 | $ | 16.500 | | 13.878 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** 1,361 % fällig am 20.07.2045 | £ | 11.526 | | 13.770 |
| **Nykredit Realkredit A/S** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 113.500 | | 13.352 |
| **Jyske Realkredit A/S** 1,000 % fällig am 01.10.2053 | | 99.770 | | 11.440 |
| **Altareit S.C.A.** 2,875 % fällig am 02.07.2025 | € | 11.100 | | 11.157 |
| **Cie Plastic Omnium S.A.** 1,250 % fällig am 26.06.2024 | | 11.000 | | 11.143 |
| **CyrusOne LP** 1,450 % fällig am 22.01.2027 | | 11.100 | | 11.065 |
| **Huarong Finance Co. Ltd.** 2,125 % fällig am 30.09.2023 | $ | 11.700 | | 10.805 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** 0,092 % fällig am 07.12.2022 | € | 10.500 | | 10.461 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** 1,605 % fällig am 20.10.2051 | £ | 8.516 | | 10.239 |
| **BEL S.A.** 1,500 % fällig am 18.04.2024 | € | 9.900 | | 10.033 |

(a) Der Euro Income Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **France Government International Bond** 0,750 % fällig am 25.05.2052 | € | 9.200 | € | 8.070 |
| **Bundesrepublik Deutschland** 0,000 % fällig am 15.08.2052 | | 7.700 | | 6.588 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)** | | 47.500 | | 4.578 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **France Government International Bond** 4,000 % fällig am 25.04.2055 | € | 2.000 | | 3.339 |
| **France Government International Bond** 0,100 % fällig am 25.07.2031 | | 2.509 | | 2.995 |
| **Slovenia Government International Bond** 1,500 % fällig am 25.03.2035 | | 2.200 | | 2.192 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.01.2032 (b) | $ | 1.517 | | 1.478 |
| **Belgium Government International Bond** 1,400 % fällig am 22.06.2053 | € | 1.400 | | 1.401 |
| **France Government International Bond** 0,500 % fällig am 25.06.2044 | | 1.600 | | 1.344 |
| **Spain Government International Bond** 1,900 % fällig am 31.10.2052 | | 900 | | 869 |
| **United Kingdom Gilt** 1,250 % fällig am 22.11.2032 | £ | 439 | | 829 |
| **Nykredit Realkredit A/S** 3,500 % fällig am 01.10.2053 | DKK | 6.100 | | 805 |
| **France Government International Bond** 4,000 % fällig am 25.04.2060 | € | 350 | | 603 |
| **Harmony French Home Loans** 0,301 % fällig am 27.05.2062 | | 600 | | 603 |
| **Primrose Residential DAC** 0,488 % fällig am 24.10.2061 | | 600 | | 599 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** 1,050 % fällig am 15.10.2031 | | 500 | | 500 |
| **Ripon Mortgages PLC** 1,351 % fällig am 28.08.2056 | £ | 400 | | 476 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 0,100 % fällig am 15.05.2033 | € | 407 | | 418 |
| **Credit Suisse AG** 0,862 % fällig am 31.05.2024 | | 400 | | 400 |
| **Dutch Property Finance BV** 0,320 % fällig am 28.10.2059 | | 400 | | 399 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **Bundesrepublik Deutschland** 0,000 % fällig am 15.08.2052 | € | 5.800 | € | 4.658 |
| **Bundesrepublik Deutschland** 0,000 % fällig am 15.08.2050 | | 4.300 | | 4.000 |
| **France Government International Bond** 1,500 % fällig am 25.05.2050 | | 3.650 | | 3.791 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** 0,875 % fällig am 04.07.2039 | | 3.000 | | 3.169 |
| **France Government International Bond** 0,100 % fällig am 25.07.2031 | | 2.523 | | 2.982 |
| **France Government International Bond** 1,250 % fällig am 25.05.2036 | | 2.600 | | 2.839 |
| **Japan Government International Bond** 0,100 % fällig am 10.03.2029 | ¥ | 332.845 | | 2.629 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.07.2030 (b) | $ | 2.273 | | 2.162 |
| **France Government International Bond** 0,750 % fällig am 25.05.2052 | € | 2.400 | | 1.996 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)** | | 20.000 | | 1.917 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Nykredit Realkredit A/S** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 14.370 | | 1.625 |
| **Atlantia SpA** 1,875 % fällig am 12.02.2028 | € | 1.200 | | 1.196 |
| **Nykredit Realkredit A/S** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 7.800 | | 885 |
| **Spain Government International Bond** 1,000 % fällig am 31.10.2050 | € | 1.000 | | 795 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 0,400 % fällig am 15.05.2030 | | 749 | | 786 |
| **France Government International Bond** 3,250 % fällig am 25.05.2045 | | 500 | | 759 |
| **Credit Suisse Group AG** 7,500 % fällig am 17.07.2023 | $ | 800 | | 737 |
| **Israel Government International Bond** 0,000 % fällig am 22.07.2022 | € | 700 | | 700 |
| **Jyske Realkredit A/S** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 5.959 | | 685 |
| **France Government International Bond** 1,750 % fällig am 25.06.2039 | € | 600 | | 679 |
| **Spain Government International Bond** 1,900 % fällig am 31.10.2052 | | 900 | | 634 |
| **France Government International Bond** 4,000 % fällig am 25.04.2060 | | 300 | | 589 |
| **Wabtec Transportation Netherlands BV** 1,250 % fällig am 03.12.2027 | | 600 | | 586 |

(a) Der Euro Long Average Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **Japan Treasury Bills** 0,000 % fällig am 27.06.2022 | ¥ | 1.830.000 | € | 13.911 |
| **Spain Treasury Bills** 0,000 % fällig am 07.10.2022 | € | 8.010 | | 8.028 |
| **Korea Housing Finance Corp.** 0,723 % fällig am 22.03.2025 | | 5.700 | | 5.700 |
| **Israel Treasury Bills** 0,000 % fällig am 03.08.2022 | ILS | 20.000 | | 5.576 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** 0,550 % fällig am 06.11.2023 | € | 5.200 | | 5.165 |
| **Virgin Money UK PLC** 0,375 % fällig am 27.05.2024 | | 5.200 | | 5.133 |
| **HSBC Holdings PLC** 0,875 % fällig am 06.09.2024 | | 4.200 | | 4.284 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 0,579 % fällig am 07.02.2025 | | 4.000 | | 4.036 |
| **Credit Suisse AG** 0,862 % fällig am 31.05.2024 | | 3.700 | | 3.700 |
| **NatWest Group PLC** 2,000 % fällig am 04.03.2025 | | 3.400 | | 3.443 |
| **Volkswagen Financial Services AG** 0,250 % fällig am 31.01.2025 | | 3.400 | | 3.395 |
| **Australia & New Zealand Banking Group Ltd.** 0,250 % fällig am 17.03.2025 | | 3.400 | | 3.391 |
| **Banque Federative du Credit Mutuel S.A.** 1,487 % fällig am 26.01.2025 | £ | 2.700 | | 3.232 |
| **United Overseas Bank Ltd.** 0,387 % fällig am 17.03.2025 | € | 2.800 | | 2.800 |
| **Lloyds Banking Group PLC** 3,500 % fällig am 01.04.2026 | | 2.600 | | 2.732 |
| **CaixaBank S.A.** 0,375 % fällig am 03.02.2025 | | 2.800 | | 2.724 |
| **Wells Fargo & Co.** 1,338 % fällig am 04.05.2025 | | 2.700 | | 2.698 |
| **Free and Hanseatic City of Hamburg** 1,875 % fällig am 26.09.2022 | | 2.600 | | 2.636 |
| **Bank of Ireland Group PLC** 1,375 % fällig am 29.08.2023 | | 2.600 | | 2.604 |
| **Dexia Credit Local S.A.** 0,250 % fällig am 01.06.2023 | | 2.600 | | 2.601 |
| **HSBC Holdings PLC** 1,500 % fällig am 04.12.2024 | | 2.600 | | 2.597 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** 1,125 % fällig am 08.09.2023 | | 2.600 | | 2.596 |
| **Morgan Stanley** 0,637 % fällig am 26.07.2024 | | 2.600 | | 2.580 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** 2,875 % fällig am 16.07.2024 | | 2.500 | | 2.563 |
| **Shamrock Residential DAC** 0,338 % fällig am 24.12.2059 | | 2.564 | | 2.557 |
| **ConocoPhillips Co.** 2,125 % fällig am 08.03.2024 | $ | 2.700 | | 2.381 |
| **AA Bond Co. Ltd.** 2,750 % fällig am 31.07.2043 | £ | 2.000 | | 2.377 |
| **Toronto-Dominion Bank** 1,395 % fällig am 22.04.2025 | | 1.900 | | 2.278 |
| **Ripon Mortgages PLC** 1,351 % fällig am 28.08.2056 | | 1.900 | | 2.262 |
| **Yorkshire Building Society** 0,375 % fällig am 11.04.2023 | € | 2.000 | | 1.998 |
| **Mitsubishi HC Capital UK PLC** 0,250 % fällig am 03.02.2025 | | 2.000 | | 1.969 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **Santander UK Group Holdings PLC** 0,664 % fällig am 27.03.2024 | € | 9.700 | € | 9.768 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 0,555 % fällig am 30.04.2024 | | 9.100 | | 9.146 |
| **Israel Government International Bond** 0,000 % fällig am 22.07.2022 | | 7.100 | | 7.101 |
| **First Abu Dhabi Bank PJSC** 1,189 % fällig am 16.04.2022 | $ | 7.400 | | 6.585 |
| **Virgin Money UK PLC** 2,875 % fällig am 24.06.2025 | € | 6.500 | | 6.506 |
| **DBS Bank Ltd.** 2,087 % fällig am 17.11.2025 | £ | 4.700 | | 5.780 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** 0,000 % fällig am 26.03.2022 | € | 5.300 | | 5.304 |
| **BAT International Finance PLC** 7,250 % fällig am 12.03.2024 | £ | 3.800 | | 4.821 |
| **Worldline S.A.** 0,500 % fällig am 30.06.2023 | € | 4.700 | | 4.716 |
| **Industrial & Commercial Bank of China Ltd.** 1,000 % fällig am 09.09.2023 | $ | 5.400 | | 4.702 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** 1,605 % fällig am 20.10.2051 | £ | 3.629 | | 4.256 |
| **HSBC Holdings PLC** 0,875 % fällig am 06.09.2024 | € | 4.200 | | 4.170 |
| **Nissan Motor Co. Ltd.** 1,940 % fällig am 15.09.2023 | | 4.100 | | 4.121 |
| **Hamburg Commercial Bank AG** 0,750 % fällig am 23.11.2023 | | 3.800 | | 3.804 |
| **Credit Suisse AG** 0,646 % fällig am 01.09.2023 | | 3.700 | | 3.715 |
| **Banco de Sabadell S.A.** 1,750 % fällig am 29.06.2023 | | 3.100 | | 3.115 |
| **Silver Arrow Merfina SRL** 0,206 % fällig am 20.07.2033 | | 3.084 | | 3.094 |
| **Scentre Group Trust** 1,375 % fällig am 22.03.2023 | | 2.900 | | 2.940 |
| **MPT Operating Partnership LP** 2,550 % fällig am 05.12.2023 | £ | 2.500 | | 2.853 |
| **Volkswagen Bank GmbH** 1,875 % fällig am 31.01.2024 | € | 2.700 | | 2.793 |
| **United Overseas Bank Ltd.** 0,387 % fällig am 17.03.2025 | | 2.800 | | 2.789 |
| **Bank of Ireland Group PLC** 1,375 % fällig am 29.08.2023 | | 2.600 | | 2.581 |
| **UniCredit SpA** 1,000 % fällig am 18.01.2023 | | 2.500 | | 2.529 |
| **Lanebrook Mortgage Transaction PLC** 1,852 % fällig am 12.06.2057 | £ | 2.155 | | 2.518 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** 0,125 % fällig am 03.12.2022 | € | 2.500 | | 2.508 |
| **easyJet PLC** 1,750 % fällig am 09.02.2023 | | 2.400 | | 2.422 |
| **ConocoPhillips Co.** 2,125 % fällig am 08.03.2024 | $ | 2.700 | | 2.412 |
| **Red & Black Auto Italy SRL** 0,153 % fällig am 28.12.2031 | € | 2.098 | | 2.107 |
| **Babcock International Group PLC** 1,750 % fällig am 06.10.2022 | | 2.000 | | 2.009 |
| **PBD Germany Auto Lease Master S.A., Compartment** 0,188 % fällig am 26.11.2030 | | 2.000 | | 2.009 |
| **BBVA Consumer Auto** 0,270 % fällig am 20.07.2031 | | 2.025 | | 1.992 |

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)** | | 24.500 | € 2.363 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Cellnex Finance Co. S.A.** 1,500 % fällig am 08.06.2028 | € | 2.000 | 1.855 |
| **Albion Financing SARL** 5,250 % fällig am 15.10.2026 | | 1.700 | 1.678 |
| **Lorca Telecom Bondco S.A.** 4,000 % fällig am 18.09.2027 | | 1.600 | 1.626 |
| **Market Bidco Finco PLC** 4,750 % fällig am 04.11.2027 | | 1.600 | 1.360 |
| **Inter Media and Communication SpA** 6,750 % fällig am 09.02.2027 | | 1.300 | 1.300 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK)** 3,875 % fällig am 15.05.2027 | | 1.200 | 1.222 |
| **Adevinta ASA** 3,000 % fällig am 15.11.2027 | | 1.200 | 1.195 |
| **La Financiere Atalian SASU** 5,125 % fällig am 15.05.2025 | | 1.300 | 1.105 |
| **Altice Financing S.A.** 3,000 % fällig am 15.01.2028 | | 1.200 | 1.067 |
| **Norican A/S** 4,500 % fällig am 15.05.2023 | | 1.100 | 1.065 |
| **Clarios Global LP** 4,375 % fällig am 15.05.2026 | | 1.000 | 990 |
| **Zenith Finco PLC** 6,500 % fällig am 30.06.2027 | £ | 800 | 951 |
| **FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA** 5,625 % fällig am 01.08.2027 | € | 900 | 900 |
| **Cellnex Finance Co. S.A.** 2,000 % fällig am 15.09.2032 | | 1.300 | 896 |
| **Volvo Car AB** 4,250 % fällig am 31.05.2028 | | 900 | 894 |
| **InPost S.A.** 2,250 % fällig am 15.07.2027 | | 900 | 861 |
| **Nidda Healthcare Holding GmbH** 3,500 % fällig am 30.09.2024 | | 850 | 810 |
| **Nexi SpA** 2,125 % fällig am 30.04.2029 | | 800 | 790 |
| **Electricite de France S.A.** 3,375 % fällig am 15.06.2030 | | 1.000 | 787 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** 1,875 % fällig am 31.03.2027 | | 900 | 767 |
| **Credit Suisse Group AG** 9,750 % fällig am 23.06.2027 | $ | 800 | 762 |
| **Elior Group S.A.** 3,750 % fällig am 15.07.2026 | € | 900 | 756 |
| **Air France-KLM** 1,875 % fällig am 16.01.2025 | | 800 | 734 |
| **Vmed O2 UK Financing PLC** 3,250 % fällig am 31.01.2031 | | 700 | 687 |
| **Castor SpA** 6,000 % fällig am 15.02.2029 | | 600 | 600 |
| **CT Investment GmbH** 5,500 % fällig am 15.04.2026 | | 600 | 538 |
| **Trafigura Funding S.A.** 3,875 % fällig am 02.02.2026 | | 500 | 440 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** 6,375 % fällig am 30.03.2028 | | 400 | 400 |
| **Cidron Aida Finco SARL** 5,000 % fällig am 01.04.2028 | | 400 | 398 |
| **Olympus Water U.S. Holding Corp.** 5,375 % fällig am 01.10.2029 | | 400 | 386 |
| **Loarre Investments SARL** 6,500 % fällig am 15.05.2029 | | 400 | 380 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)** | | 40.000 | € 3.866 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Lincoln Financing SARL** 3,625 % fällig am 01.04.2024 | € | 1.950 | 1.927 |
| **Petroleos Mexicanos** 3,625 % fällig am 24.11.2025 | | 1.750 | 1.747 |
| **Mauser Packaging Solutions Holding Co.** 4,750 % fällig am 15.04.2024 | | 1.800 | 1.723 |
| **Albion Financing SARL** 5,250 % fällig am 17.08.2026 | | 1.700 | 1.694 |
| **Casino Guichard Perrachon S.A.** 3,580 % fällig am 07.02.2025 | | 1.900 | 1.625 |
| **Altice Financing S.A.** 2,250 % fällig am 15.01.2025 | | 1.500 | 1.440 |
| **eG Global Finance PLC** 4,375 % fällig am 07.02.2025 | | 1.200 | 1.170 |
| **Ortho-Clinical Diagnostics S.A.** 1,000 % fällig am 30.06.2025 | | 1.133 | 1.133 |
| **CGG S.A.** 7,750 % fällig am 01.04.2027 | | 1.000 | 958 |
| **Axalta Coating Systems Dutch Holding BV** 3,750 % fällig am 15.01.2025 | | 900 | 909 |
| **Matterhorn Telecom S.A.** 3,125 % fällig am 15.09.2026 | | 900 | 899 |
| **IQVIA, Inc.** 2,250 % fällig am 15.03.2029 | | 900 | 892 |
| **Fenix Marine Service Holdings Ltd.** 8,000 % fällig am 15.01.2024 | $ | 900 | 868 |
| **Banijay Entertainment SASU** 5,375 % fällig am 01.03.2025 | | 950 | 855 |
| **Ithaca Energy North Sea PLC** 9,000 % fällig am 15.07.2026 | | 900 | 847 |
| **Bausch Health Americas, Inc.** 9,250 % fällig am 01.04.2026 | | 900 | 840 |
| **Lagardere S.A.** 1,750 % fällig am 07.10.2027 | € | 800 | 782 |
| **IQVIA, Inc.** 2,875 % fällig am 15.09.2025 | | 700 | 699 |
| **ADLER Group S.A.** 1,875 % fällig am 14.01.2026 | | 1.100 | 682 |
| **ADLER Group S.A.** 2,750 % fällig am 13.11.2026 | | 1.100 | 668 |
| **Jaguar Land Rover Automotive PLC** 6,875 % fällig am 15.11.2026 | | 600 | 638 |
| **eG Global Finance PLC** 3,625 % fällig am 07.02.2024 | | 600 | 590 |
| **Gruenenthal GmbH** 4,125 % fällig am 15.05.2028 | | 600 | 585 |
| **Ardagh Packaging Finance PLC** 4,750 % fällig am 15.07.2027 | £ | 500 | 562 |
| **Pro-Gest SpA** 3,250 % fällig am 15.12.2024 | € | 750 | 551 |
| **Harbour Energy PLC** 5,500 % fällig am 15.10.2026 | $ | 600 | 515 |
| **Lune Holdings SARL** 5,625 % fällig am 15.11.2028 | € | 600 | 498 |
| **ADLER Group S.A.** 2,250 % fällig am 27.04.2027 | | 600 | 475 |
| **AA Bond Co. Ltd.** 6,500 % fällig am 31.01.2026 | £ | 400 | 474 |
| **United Airlines Pass-Through Trust** 2,900 % fällig am 01.11.2029 | $ | 558 | 469 |
| **DIC Asset AG** 2,250 % fällig am 22.09.2026 | € | 500 | 446 |
| **Gruenenthal GmbH** 3,625 % fällig am 15.11.2026 | | 400 | 397 |
| **Altice Financing S.A.** 4,250 % fällig am 15.08.2029 | | 400 | 390 |
| **HSBC Bank Capital Funding Sterling LP** 5,844 % fällig am 05.11.2031 | £ | 250 | 377 |

(a) Der PIMCO European High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)** | | 271.400 | € | 26.185 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **France Government International Bond** 0,100 % fällig am 25.07.2031 | € | 3.339 | | 3.908 |
| **Spain Government International Bond** 2,550 % fällig am 31.10.2032 | | 3.000 | | 3.000 |
| **Nykredit Realkredit A/S** 3,500 % fällig am 01.10.2053 | DKK | 19.700 | | 2.573 |
| **DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH** 2,500 % fällig am 25.01.2027 | € | 1.900 | | 1.890 |
| **Realkredit Danmark A/S** 3,000 % fällig am 01.10.2053 | DKK | 13.900 | | 1.800 |
| **Ripon Mortgages PLC** 1,351 % fällig am 28.08.2056 | £ | 1.200 | | 1.428 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** 1,050 % fällig am 15.10.2031 | € | 1.300 | | 1.300 |
| **Slovenia Government International Bond** 1,175 % fällig am 13.02.2062 | | 1.300 | | 1.297 |
| **Silfin NV** 2,875 % fällig am 11.04.2027 | | 1.200 | | 1.189 |
| **Electricite de France S.A.** 2,625 % fällig am 01.12.2027 | | 1.200 | | 1.142 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 0,579 % fällig am 07.02.2025 | | 1.100 | | 1.110 |
| **Slovenia Government International Bond** 1,750 % fällig am 03.11.2040 | | 1.100 | | 1.107 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** 0,720 % fällig am 15.10.2031 | | 1.100 | | 1.100 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** 2,750 % fällig am 29.03.2028 | | 1.000 | | 1.079 |
| **Slovenia Government International Bond** 3,125 % fällig am 07.08.2045 | | 800 | | 1.029 |
| **ING Groep NV** 1,250 % fällig am 16.02.2027 | | 1.000 | | 997 |
| **Electricite de France S.A.** 2,875 % fällig am 15.12.2026 | | 1.000 | | 974 |
| **Prosus NV** 3,257 % fällig am 19.01.2027 | $ | 1.100 | | 970 |
| **Stratton Mortgage Funding PLC** 1,361 % fällig am 20.07.2060 | £ | 760 | | 910 |
| **Dutch Property Finance BV** 0,285 % fällig am 28.04.2059 | € | 900 | | 905 |
| **Barclays PLC** 2,885 % fällig am 31.01.2027 | | 900 | | 900 |
| **Credit Suisse AG** 0,862 % fällig am 31.05.2024 | | 900 | | 900 |
| **Primrose Residential DAC** 0,488 % fällig am 24.10.2061 | | 900 | | 899 |
| **Dutch Property Finance BV** 1,250 % fällig am 28.04.2050 | | 900 | | 891 |
| **United Overseas Bank Ltd.** 0,387 % fällig am 17.03.2025 | | 800 | | 800 |
| **Nova Kreditna Banka Maribor d.d.** 1,875 % fällig am 27.01.2025 | | 800 | | 799 |
| **UBS Group AG** 1,000 % fällig am 21.03.2025 | | 800 | | 798 |
| **Dutch Property Finance BV** 0,320 % fällig am 28.10.2059 | | 800 | | 798 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)** | | 257.900 | € | 24.861 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Jyske Realkredit A/S** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 108.600 | | 12.450 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.01.2030 (b) | $ | 6.949 | | 6.579 |
| **Nykredit Realkredit A/S** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 50.400 | | 5.689 |
| **Spain Government International Bond** 1,250 % fällig am 31.10.2030 | € | 5.800 | | 5.193 |
| **France Government International Bond** 0,100 % fällig am 25.07.2031 | | 3.259 | | 3.856 |
| **Bayer Capital Corp. BV** 0,067 % fällig am 27.06.2022 | | 3.800 | | 3.806 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 32.400 | | 3.694 |
| **Coventry Building Society** 1,500 % fällig am 23.01.2023 | £ | 3.100 | | 3.648 |
| **Nykredit Realkredit A/S** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 30.030 | | 3.396 |
| **Societe Generale S.A.** 0,277 % fällig am 01.04.2022 | € | 2.900 | | 2.905 |
| **Spain Government International Bond** 2,550 % fällig am 31.10.2032 | | 3.000 | | 2.847 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.07.2031 (b) | $ | 2.835 | | 2.716 |
| **Spain Government International Bond** 0,100 % fällig am 30.04.2031 | € | 2.600 | | 2.133 |
| **Jyske Realkredit A/S** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 19.300 | | 2.109 |
| **Europäische Union** 0,000 % fällig am 04.07.2031 | € | 2.100 | | 2.015 |
| **Deutsche Bank AG** 1,875 % fällig am 14.02.2022 | | 1.800 | | 1.803 |
| **Realkredit Danmark A/S** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 16.400 | | 1.796 |
| **BNP Paribas S.A.** 0,672 % fällig am 22.09.2022 | € | 1.700 | | 1.709 |
| **Marks & Spencer PLC** 4,250 % fällig am 08.12.2023 | £ | 1.400 | | 1.690 |
| **Nykredit Realkredit A/S** 1,000 % fällig am 01.10.2053 | DKK | 15.649 | | 1.616 |
| **Spain Government International Bond** 0,500 % fällig am 31.10.2031 | € | 1.900 | | 1.591 |
| **CVC Cordatus Loan Fund DAC** 0,650 % fällig am 21.07.2030 | | 1.529 | | 1.525 |

(a) Der PIMCO European Short-Term Opportunities Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 8.270.253 | $ | 82.305 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Singapore Government International Bond** 1,625 % fällig am 01.07.2031 | SGD | 9.000 | | 6.360 |
| **Ripon Mortgages PLC** 1,351 % fällig am 28.08.2056 | £ | 3.900 | | 5.324 |
| **Japan Government International Bond** 0,005 % fällig am 20.03.2027 | ¥ | 490.000 | | 3.812 |
| **Israel Treasury Bills** 0,000 % fällig am 08.02.2023 | ILS | 9.900 | | 2.948 |
| **China Government Bond** 2,680 % fällig am 21.05.2030 | CNY | 18.200 | | 2.819 |
| **Dominican Republic Government International Bond** 5,500 % fällig am 22.02.2029 | $ | 2.600 | | 2.600 |
| **Singapore Government International Bond** 2,875 % fällig am 01.09.2030 | SGD | 3.200 | | 2.504 |
| **Thailand Government International Bond** 1,585 % fällig am 17.12.2035 | THB | 94.700 | | 2.076 |
| **China Government Bond** 3,810 % fällig am 14.09.2050 | CNY | 10.600 | | 1.790 |
| **Prosus NV** 1,207 % fällig am 19.01.2026 | € | 1.500 | | 1.713 |
| **ING Groep NV** 1,750 % fällig am 16.02.2031 | | 1.500 | | 1.705 |
| **Prosus NV** 3,257 % fällig am 19.01.2027 | $ | 1.600 | | 1.600 |
| **Morocco Government International Bond** 2,000 % fällig am 30.09.2030 | € | 1.800 | | 1.581 |
| **Ivory Coast Government International Bond** 5,250 % fällig am 22.03.2030 | | 1.600 | | 1.519 |
| **Malaysia Government International Bond** 3,447 % fällig am 15.07.2036 | MYR | 6.800 | | 1.495 |
| **CIFC Funding Ltd.** 2,044 % fällig am 18.04.2031 | $ | 1.500 | | 1.490 |
| **Freddie Mac** 2,500 % fällig am 01.01.2052 | | 1.582 | | 1.440 |
| **Dryden CLO Ltd.** 2,064 % fällig am 15.04.2031 | | 1.400 | | 1.395 |
| **CBAM CLO Ltd.** 2,064 % fällig am 17.04.2031 | | 1.300 | | 1.301 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 7.765.856 | $ | 77.300 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **China Government Bond** 3,280 % fällig am 03.12.2027 | CNY | 64.900 | | 10.586 |
| **Japan Government International Bond** 0,100 % fällig am 20.09.2031 | ¥ | 1.280.000 | | 9.934 |
| **China Government Bond** 3,020 % fällig am 22.10.2025 | CNY | 55.700 | | 8.930 |
| **Japan Government International Bond** 0,100 % fällig am 20.06.2031 | ¥ | 850.000 | | 6.475 |
| **Kuwait International Government Bond** 3,500 % fällig am 20.03.2027 | $ | 3.800 | | 4.044 |
| **Japan Government International Bond** 0,005 % fällig am 20.03.2027 | ¥ | 490.000 | | 3.617 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,875 % fällig am 30.04.2025 | $ | 3.400 | | 3.413 |
| **China Development Bank** 3,340 % fällig am 14.07.2025 | CNY | 19.800 | | 3.168 |
| **Malaysia Government International Bond** 3,733 % fällig am 15.06.2028 | MYR | 12.200 | | 2.898 |
| **China Government Bond** 2,680 % fällig am 21.05.2030 | CNY | 18.200 | | 2.819 |
| **Dominican Republic Government International Bond** 5,500 % fällig am 22.02.2029 | $ | 2.600 | | 2.438 |
| **Singapore Government International Bond** 1,625 % fällig am 01.07.2031 | SGD | 3.500 | | 2.250 |
| **China Development Bank** 4,040 % fällig am 10.04.2027 | CNY | 13.200 | | 2.180 |
| **Lloyds Bank PLC** 4,875 % fällig am 30.03.2027 | £ | 1.400 | | 2.123 |
| **Singapore Government International Bond** 3,375 % fällig am 01.09.2033 | SGD | 2.400 | | 1.962 |
| **Saudi Arabia Government International Bond** 4,375 % fällig am 16.04.2029 | $ | 1.700 | | 1.892 |
| **Australia Government International Bond** 0,500 % fällig am 21.09.2026 | AUD | 2.600 | | 1.815 |
| **Peru Government International Bond** 3,000 % fällig am 15.01.2034 | $ | 1.800 | | 1.507 |
| **Lloyds Banking Group PLC** 4,582 % fällig am 10.12.2025 | | 1.400 | | 1.401 |

(a) Der Global Advantage Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 78.532.190 | $ | 781.667 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Japan Government International Bond** 0,005 % fällig am 20.03.2027 | ¥ | 34.700.000 | | 269.917 |
| **Singapore Government International Bond** 1,625 % fällig am 01.07.2031 | SGD | 241.048 | | 170.953 |
| **Ripon Mortgages PLC** 1,351 % fällig am 28.08.2056 | £ | 105.800 | | 144.417 |
| **Israel Treasury Bills** 0,000 % fällig am 08.02.2023 | ILS | 365.200 | | 108.662 |
| **Singapore Government International Bond** 2,875 % fällig am 01.09.2030 | SGD | 84.850 | | 66.337 |
| **Thailand Government International Bond** 1,585 % fällig am 17.12.2035 | THB | 2.670.500 | | 59.446 |
| **China Government Bond** 3,810 % fällig am 14.09.2050 | CNY | 324.100 | | 54.596 |
| **Freddie Mac** 2,500 % fällig am 01.01.2052 | $ | 44.681 | | 40.689 |
| **Malaysia Government International Bond** 3,900 % fällig am 30.11.2026 | MYR | 155.600 | | 37.955 |
| **Australia Government International Bond** 4,500 % fällig am 21.04.2033 | AUD | 49.000 | | 36.376 |
| **Malaysia Government International Bond** 4,065 % fällig am 15.06.2050 | MYR | 156.400 | | 34.270 |
| **U.S. Treasury Bonds** 3,250 % fällig am 15.05.2042 | $ | 35.500 | | 34.178 |
| **JPMorgan Chase & Co.** 4,080 % fällig am 26.04.2026 | | 33.800 | | 33.800 |
| **China Government Bond** 3,530 % fällig am 18.10.2051 | CNY | 204.100 | | 33.366 |
| **Citigroup, Inc.** 3,290 % fällig am 17.03.2026 | $ | 33.100 | | 33.100 |
| **Morgan Stanley** 2,103 % fällig am 08.05.2026 | € | 30.000 | | 31.591 |
| **Thailand Government International Bond** 2,000 % fällig am 17.12.2031 | THB | 1.010.600 | | 30.161 |
| **Singapore Government International Bond** 2,250 % fällig am 01.08.2036 | SGD | 38.869 | | 29.148 |
| **Singapore Government International Bond** 2,875 % fällig am 01.07.2029 | | 35.700 | | 27.942 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 73.994.426 | $ | 736.500 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Japan Government International Bond** 0,100 % fällig am 20.06.2031 | ¥ | 54.860.000 | | 412.252 |
| **Japan Government International Bond** 0,005 % fällig am 20.03.2027 | | 34.700.000 | | 257.441 |
| **China Development Bank** 3,680 % fällig am 26.02.2026 | CNY | 1.542.800 | | 252.670 |
| **China Development Bank** 4,040 % fällig am 10.04.2027 | | 1.133.400 | | 187.159 |
| **Japan Government International Bond** 1,400 % fällig am 20.09.2034 | ¥ | 14.880.000 | | 125.153 |
| **Japan Government International Bond** 0,100 % fällig am 20.09.2031 | | 15.395.550 | | 118.591 |
| **Spain Government International Bond** 1,400 % fällig am 30.07.2028 | € | 98.150 | | 111.732 |
| **China Development Bank** 4,240 % fällig am 24.08.2027 | CNY | 663.600 | | 110.814 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 1,850 % fällig am 01.07.2025 | € | 100.000 | | 100.779 |
| **China Development Bank** 3,050 % fällig am 25.08.2026 | CNY | 635.000 | | 100.417 |
| **Australia Government International Bond** 0,500 % fällig am 21.09.2026 | AUD | 143.300 | | 99.909 |
| **Spain Government International Bond** 0,850 % fällig am 30.07.2037 | € | 67.450 | | 66.141 |
| **China Development Bank** 3,180 % fällig am 05.04.2026 | CNY | 392.900 | | 62.367 |
| **Singapore Government International Bond** 1,625 % fällig am 01.07.2031 | SGD | 95.000 | | 61.201 |
| **China Development Bank** 4,880 % fällig am 09.02.2028 | CNY | 373.300 | | 60.490 |
| **Royal Bank of Canada** 1,450 % fällig am 03.10.2024 | £ | 40.500 | | 54.157 |
| **Japan Government International Bond** 0,700 % fällig am 20.06.2051 | ¥ | 6.930.000 | | 50.031 |
| **Singapore Government International Bond** 3,375 % fällig am 01.09.2033 | SGD | 47.588 | | 39.826 |
| **Kuwait International Government Bond** 3,500 % fällig am 20.03.2027 | $ | 36.600 | | 38.949 |

(a) Der Global Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **Bundesrepublik Deutschland** 0,000 % fällig am 15.08.2031 | € | 53.800 | $ | 61.360 |
| **Japan Government International Bond** 0,005 % fällig am 20.03.2027 | ¥ | 7.460.000 | | 58.028 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** 2,500 % fällig am 01.12.2051 | $ | 45.582 | | 45.511 |
| **Singapore Government International Bond** 1,625 % fällig am 01.07.2031 | SGD | 41.300 | | 29.298 |
| **Japan Treasury Bills** 0,000 % fällig am 05.09.2022 | ¥ | 3.390.000 | | 25.938 |
| **Ripon Mortgages PLC** 1,351 % fällig am 28.08.2056 | £ | 18.100 | | 24.707 |
| **Japan Treasury Bills** 0,000 % fällig am 27.06.2022 | ¥ | 2.850.000 | | 24.068 |
| **China Government Bond** 2,680 % fällig am 21.05.2030 | CNY | 151.100 | | 23.403 |
| **Deutsche Bank AG** 1,875 % fällig am 23.02.2028 | € | 16.400 | | 18.570 |
| **Singapore Government International Bond** 2,875 % fällig am 01.09.2030 | SGD | 19.600 | | 15.323 |
| **Japan Treasury Bills** 0,000 % fällig am 30.05.2022 | ¥ | 1.370.000 | | 11.901 |
| **Genesis Mortgage Funding PLC** 2,149 % fällig am 15.09.2059 | £ | 9.500 | | 11.879 |
| **Thailand Government International Bond** 1,585 % fällig am 17.12.2035 | THB | 528.100 | | 11.744 |
| **Communaute Francaise de Belgique** 1,625 % fällig am 03.05.2032 | € | 10.300 | | 10.943 |
| **Credit Suisse Group AG** 2,875 % fällig am 02.04.2032 | | 8.100 | | 8.970 |
| **U.S. Treasury Bonds** 3,250 % fällig am 15.05.2042 | $ | 9.000 | | 8.665 |
| **ING Groep NV** 2,125 % fällig am 23.05.2026 | € | 8.200 | | 8.525 |
| **China Government Bond** 3,720 % fällig am 12.04.2051 | CNY | 49.800 | | 8.251 |
| **China Government Bond** 3,810 % fällig am 14.09.2050 | | 48.800 | | 8.230 |
| **Israel Treasury Bills** 0,000 % fällig am 04.01.2023 | ILS | 25.000 | | 7.839 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **Japan Government International Bond** 0,100 % fällig am 20.06.2031 | ¥ | 10.157.600 | $ | 75.044 |
| **Japan Government International Bond** 0,005 % fällig am 20.03.2027 | | 7.460.000 | | 55.316 |
| **China Government Bond** 3,020 % fällig am 22.10.2025 | CNY | 187.300 | | 30.011 |
| **China Development Bank** 4,240 % fällig am 24.08.2027 | | 159.800 | | 26.796 |
| **Japan Government International Bond** 0,100 % fällig am 20.09.2031 | ¥ | 3.350.000 | | 25.891 |
| **China Government Bond** 2,680 % fällig am 21.05.2030 | CNY | 128.800 | | 19.159 |
| **China Government Bond** 3,280 % fällig am 03.12.2027 | | 93.900 | | 15.356 |
| **Japan Government International Bond** 0,700 % fällig am 20.06.2051 | ¥ | 1.830.000 | | 13.283 |
| **China Development Bank** 3,680 % fällig am 26.02.2026 | CNY | 67.600 | | 11.070 |
| **China Government Bond** 3,010 % fällig am 13.05.2028 | | 62.300 | | 9.927 |
| **Singapore Government International Bond** 1,625 % fällig am 01.07.2031 | SGD | 15.100 | | 9.688 |
| **U.S. Treasury Bonds** 3,250 % fällig am 15.05.2042 | $ | 9.000 | | 8.623 |
| **BPCE S.A.** 2,045 % fällig am 19.10.2027 | | 9.600 | | 8.610 |
| **U.S. Treasury Bonds** 1,375 % fällig am 15.11.2040 | | 11.400 | | 8.075 |
| **Standard Chartered PLC** 0,900 % fällig am 02.07.2027 | € | 6.500 | | 7.454 |
| **Malaysia Government International Bond** 4,254 % fällig am 31.05.2035 | MYR | 32.300 | | 7.165 |
| **Peru Government International Bond** 3,000 % fällig am 15.01.2034 | $ | 8.500 | | 7.117 |
| **Societe Du Grand Paris EPIC** 0,300 % fällig am 25.11.2031 | € | 7.100 | | 7.113 |
| **China Development Bank** 3,340 % fällig am 14.07.2025 | CNY | 43.600 | | 6.976 |
| **China Government Bond** 2,740 % fällig am 04.08.2026 | | 43.100 | | 6.835 |
| **Singapore Government International Bond** 3,375 % fällig am 01.09.2033 | SGD | 8.100 | | 6.785 |

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 33.247.471 | $ | 330.925 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Japan Government International Bond** 0,005 % fällig am 20.03.2027 | ¥ | 2.690.000 | | 20.923 |
| **Singapore Government International Bond** 1,625 % fällig am 01.07.2031 | SGD | 14.600 | | 10.367 |
| **China Development Bank** 4,040 % fällig am 10.04.2027 | CNY | 60.800 | | 10.159 |
| **Ripon Mortgages PLC** 1,351 % fällig am 28.08.2056 | £ | 7.300 | | 9.965 |
| **Japan Government International Bond** 0,100 % fällig am 20.09.2031 | ¥ | 680.000 | | 5.860 |
| **China Government Bond** 3,010 % fällig am 13.05.2028 | CNY | 35.900 | | 5.760 |
| **France Government International Bond** 2,250 % fällig am 25.10.2022 | € | 5.300 | | 5.617 |
| **China Government Bond** 3,810 % fällig am 14.09.2050 | CNY | 32.800 | | 5.527 |
| **Japan Government International Bond** 0,700 % fällig am 20.09.2051 | ¥ | 610.000 | | 5.156 |
| **Singapore Government International Bond** 2,875 % fällig am 01.09.2030 | SGD | 6.500 | | 5.058 |
| **China Government Bond** 3,530 % fällig am 18.10.2051 | CNY | 29.100 | | 4.754 |
| **Thailand Government International Bond** 1,585 % fällig am 17.12.2035 | THB | 199.700 | | 4.510 |
| **Thailand Government International Bond** 2,000 % fällig am 17.12.2031 | | 142.600 | | 4.256 |
| **China Government Bond** 2,680 % fällig am 21.05.2030 | CNY | 26.100 | | 4.042 |
| **Genesis Mortgage Funding PLC** 2,149 % fällig am 15.09.2059 | £ | 3.100 | | 3.876 |
| **Ontario Teachers' Finance Trust** 1,850 % fällig am 03.05.2032 | € | 3.300 | | 3.510 |
| **U.S. Treasury Bonds** 3,250 % fällig am 15.05.2042 | $ | 3.400 | | 3.273 |
| **Realkredit Danmark A/S** 2,000 % fällig am 01.10.2053 | DKK | 19.400 | | 2.924 |
| **Malaysia Government International Bond** 4,065 % fällig am 15.06.2050 | MYR | 13.700 | | 2.912 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 29.406.007 | $ | 292.700 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Japan Government International Bond** 0,100 % fällig am 20.06.2031 | ¥ | 4.844.700 | | 36.617 |
| **China Development Bank** 4,040 % fällig am 10.04.2027 | CNY | 129.000 | | 21.356 |
| **Japan Government International Bond** 0,005 % fällig am 20.03.2027 | ¥ | 2.690.000 | | 19.958 |
| **China Development Bank** 3,680 % fällig am 26.02.2026 | CNY | 113.900 | | 18.604 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 1,450 % fällig am 15.11.2024 | € | 13.100 | | 13.226 |
| **Japan Government International Bond** 0,100 % fällig am 20.09.2031 | ¥ | 1.650.000 | | 12.799 |
| **China Government Bond** 3,030 % fällig am 11.03.2026 | CNY | 74.700 | | 11.993 |
| **Spain Government International Bond** 1,400 % fällig am 30.07.2028 | € | 9.200 | | 10.473 |
| **China Government Bond** 3,280 % fällig am 03.12.2027 | CNY | 59.100 | | 9.657 |
| **Australia Government International Bond** 0,500 % fällig am 21.09.2026 | AUD | 10.400 | | 7.249 |
| **China Development Bank** 3,500 % fällig am 13.08.2026 | CNY | 38.000 | | 6.118 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 1,850 % fällig am 01.07.2025 | € | 5.600 | | 5.637 |
| **U.S. Treasury Notes** 0,625 % fällig am 15.05.2030 | $ | 5.900 | | 5.304 |
| **China Development Bank** 3,430 % fällig am 14.01.2027 | CNY | 32.400 | | 5.204 |
| **Japan Government International Bond** 0,700 % fällig am 20.12.2048 | ¥ | 640.000 | | 5.156 |
| **China Development Bank** 3,180 % fällig am 05.04.2026 | CNY | 30.300 | | 4.810 |
| **China Development Bank** 3,050 % fällig am 25.08.2026 | | 30.100 | | 4.754 |
| **Thailand Government International Bond** 2,000 % fällig am 17.12.2031 | THB | 142.600 | | 4.272 |
| **China Government Bond** 2,680 % fällig am 21.05.2030 | CNY | 26.100 | | 4.040 |

(a) Der Global Bond Ex-US Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 52.928.023 | $ | 526.757 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Colombian TES** 6,250 % fällig am 26.11.2025 | COP | 48.202.000 | | 11.233 |
| **Colombian TES** 7,750 % fällig am 18.09.2030 | | 39.400.000 | | 9.540 |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos** 4,700 % fällig am 01.09.2030 | CLP | 5.580.000 | | 6.415 |
| **South Africa Government International Bond** 10,500 % fällig am 21.12.2026 | ZAR | 87.400 | | 6.266 |
| **South Africa Government International Bond** 10,500 % fällig am 21.12.2026 | | 87.600 | | 6.154 |
| **Japan Government International Bond** 1,700 % fällig am 20.09.2044 | ¥ | 600.000 | | 5.185 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **Activision Blizzard, Inc.** | | 63.273 | | 5.135 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Spain Government International Bond** 0,700 % fällig am 30.04.2032 | € | 5.000 | | 4.241 |
| **South Africa Government International Bond** 8,000 % fällig am 31.01.2030 | ZAR | 66.800 | | 4.131 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **Airbus SE** | | 35.755 | | 4.071 |
| **Renewable Energy Group, Inc.** | | 63.204 | | 3.859 |
| **First Horizon Corp.** | | 161.653 | | 3.847 |
| **LHC Group, Inc.** | | 22.910 | | 3.837 |
| **TEGNA, Inc.** | | 168.148 | | 3.831 |
| **Alleghany Corp.** | | 4.414 | | 3.698 |
| **Twitter, Inc.** | | 70.963 | | 3.561 |
| **Regeneron Pharmaceuticals, Inc.** | | 5.035 | | 3.464 |
| **Vertex Pharmaceuticals, Inc.** | | 12.713 | | 3.316 |
| **Biohaven Pharmaceutical Holding Co. Ltd.** | | 23.306 | | 3.280 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 51.773.986 | $ | 515.300 |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Mortgage Opportunities Fund (a)** | | 12.863.704 | | 131.853 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Japan Government International Bond** 0,100 % fällig am 20.09.2031 | ¥ | 4.000.000 | | 29.942 |
| **Colombian TES** 6,250 % fällig am 26.11.2025 | COP | 71.450.000 | | 17.308 |
| **South Africa Government International Bond** 10,500 % fällig am 21.12.2026 | ZAR | 180.550 | | 13.289 |
| **South Africa Government International Bond** 10,500 % fällig am 21.12.2026 | | 179.500 | | 12.631 |
| **China Government Bond** 3,280 % fällig am 03.12.2027 | CNY | 76.300 | | 12.434 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **Apple, Inc.** | | 66.100 | | 10.735 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Nykredit Realkredit A/S** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 42.959 | | 5.777 |
| **Jyske Realkredit A/S** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 31.892 | | 4.294 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **Airbus SE** | | 35.755 | | 3.759 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **South Africa Government International Bond** 8,000 % fällig am 31.01.2030 | ZAR | 66.800 | | 3.627 |
| **Peru Government International Bond** 5,940 % fällig am 12.02.2029 | PEN | 13.700 | | 3.602 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 25.419 | | 3.423 |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** 3,000 % fällig am 29.03.2025 | € | 2.900 | | 3.105 |
| **Peru Government International Bond** 8,200 % fällig am 12.08.2026 | PEN | 9.100 | | 2.673 |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos** 4,700 % fällig am 01.09.2030 | CLP | 2.355.000 | | 2.396 |
| **BRF GmbH** 4,350 % fällig am 29.09.2026 | $ | 2.300 | | 2.131 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **Coca-Cola European Partners PLC** | | 40.051 | | 2.049 |
| **Compass Group PLC** | | 99.169 | | 2.000 |

(a) Der PIMCO Global Dividend Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 63.764.436 | $ | 634.659 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Ctec GmbH** 5,250 % fällig am 15.02.2030 | € | 12.000 | | 13.406 |
| **Inter Media and Communication SpA** 6,750 % fällig am 09.02.2027 | | 6.000 | | 6.689 |
| **FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA** 5,625 % fällig am 01.08.2027 | | 5.800 | | 6.622 |
| **ZF Europe Finance BV** 3,000 % fällig am 23.10.2029 | | 5.600 | | 5.365 |
| **Tenet Healthcare Corp.** 6,125 % fällig am 15.06.2030 | $ | 5.000 | | 5.000 |
| **Community Health Systems, Inc.** 5,250 % fällig am 15.05.2030 | | 5.000 | | 5.000 |
| **ZF Finance GmbH** 2,250 % fällig am 03.05.2028 | € | 5.000 | | 4.952 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** 2,900 % fällig am 10.02.2029 | $ | 4.900 | | 4.900 |
| **Oxford Finance LLC** 6,375 % fällig am 01.02.2027 | | 4.800 | | 4.800 |
| **Fertitta Entertainment LLC** 6,750 % fällig am 15.01.2030 | | 4.250 | | 4.250 |
| **ZF Finance GmbH** 3,750 % fällig am 21.09.2028 | € | 4.000 | | 4.219 |
| **Zenith Finco PLC** 6,500 % fällig am 30.06.2027 | £ | 3.000 | | 4.097 |
| **Callon Petroleum Co.** 7,500 % fällig am 15.06.2030 | $ | 4.000 | | 4.000 |
| **CDI Escrow Issuer, Inc.** 5,750 % fällig am 01.04.2030 | | 3.750 | | 3.750 |
| **Owens & Minor, Inc.** 6,625 % fällig am 01.04.2030 | | 3.750 | | 3.750 |
| **Diamond Sports Group LLC** 1,000 % fällig am 26.05.2026 | | 3.826 | | 3.689 |
| **Kinetik Holdings LP** 5,875 % fällig am 15.06.2030 | | 3.500 | | 3.486 |
| **Standard Industries, Inc.** 2,250 % fällig am 21.11.2026 | € | 3.000 | | 3.297 |
| **ZF Europe Finance BV** 2,000 % fällig am 23.02.2026 | | 3.000 | | 2.819 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 81.665.724 | $ | 812.865 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Sotera Health Holdings LLC** 4,416 % fällig am 11.12.2026 | $ | 25.000 | | 24.725 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** 5,200 % fällig am 15.07.2045 | | 18.250 | | 19.775 |
| **Sprint Corp.** 7,125 % fällig am 15.06.2024 | | 10.000 | | 10.775 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** 0,346 % fällig am 01.12.2024 | € | 9.250 | | 9.620 |
| **Telecom Italia SpA** 5,303 % fällig am 30.05.2024 | $ | 9.500 | | 9.498 |
| **Freeport-McMoRan, Inc.** 5,400 % fällig am 14.11.2034 | | 7.625 | | 8.741 |
| **WESCO Distribution, Inc.** 7,125 % fällig am 15.06.2025 | | 8.000 | | 8.304 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **Noble Corp.** | | 231.945 | | 7.328 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Targa Resources Partners LP** 5,500 % fällig am 01.03.2030 | $ | 7.000 | | 7.287 |
| **Lloyds Banking Group PLC** 7,625 % fällig am 27.06.2023 | £ | 5.000 | | 6.856 |
| **Targa Resources Partners LP** 5,000 % fällig am 15.01.2028 | $ | 6.500 | | 6.652 |
| **Sigma Holdco BV** 5,750 % fällig am 15.05.2026 | € | 8.000 | | 6.412 |
| **IRB Holding Corp.** 7,000 % fällig am 15.06.2025 | $ | 6.000 | | 6.248 |
| **Targa Resources Partners LP** 4,875 % fällig am 01.02.2031 | | 5.750 | | 5.908 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** 0,324 % fällig am 15.11.2023 | € | 5.000 | | 5.588 |
| **Par Pharmaceutical, Inc.** 7,500 % fällig am 01.04.2027 | $ | 7.000 | | 5.379 |
| **Sprint Corp.** 7,875 % fällig am 15.09.2023 | | 5.000 | | 5.372 |
| **Freeport-McMoRan, Inc.** 5,250 % fällig am 01.09.2029 | | 5.000 | | 5.278 |
| **Targa Resources Partners LP** 6,500 % fällig am 15.07.2027 | | 5.000 | | 5.275 |

(a) Der Global High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 187.332.784 | $ | 1.864.505 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **U.S. Treasury Bonds** 1,875 % fällig am 15.11.2051 | $ | 289.842 | | 267.938 |
| **U.S. Treasury Notes** 1,875 % fällig am 15.02.2032 | | 259.218 | | 248.932 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,875 % fällig am 15.05.2032 | | 236.574 | | 235.804 |
| **U.S. Treasury Bonds** 2,000 % fällig am 15.11.2041 | | 191.400 | | 187.451 |
| **U.S. Treasury Bonds** 2,875 % fällig am 15.05.2052 | | 77.200 | | 73.562 |
| **U.S. Treasury Bonds** 2,250 % fällig am 15.02.2052 | | 70.400 | | 58.995 |
| **U.S. Treasury Bonds** 2,375 % fällig am 15.02.2042 | | 53.700 | | 48.980 |
| **Australia Government International Bond** 4,500 % fällig am 21.04.2033 | AUD | 57.100 | | 42.448 |
| **South Africa Government International Bond** 10,500 % fällig am 21.12.2026 | ZAR | 455.600 | | 33.323 |
| **U.S. Treasury Bonds** 3,250 % fällig am 15.05.2042 | $ | 28.100 | | 27.892 |
| **Bank of America Corp.** 2,551 % fällig am 04.02.2028 | | 26.100 | | 26.100 |
| **Holding d'Infrastructures de Transport SASU** 1,475 % fällig am 18.01.2031 | € | 16.200 | | 18.197 |
| **Nova Kreditna Banka Maribor d.d.** 1,875 % fällig am 27.01.2025 | | 10.700 | | 12.133 |
| **CPI Property Group S.A.** 1,750 % fällig am 14.01.2030 | | 10.900 | | 12.097 |
| **Fells Point Funding Trust** 3,046 % fällig am 31.01.2027 | $ | 10.900 | | 10.900 |
| **Market Bidco Finco PLC** 4,750 % fällig am 04.11.2027 | € | 11.500 | | 10.537 |
| **GSK Consumer Healthcare Capital NL BV** 1,750 % fällig am 29.03.2030 | | 9.500 | | 10.460 |
| **BNP Paribas S.A.** 2,591 % fällig am 20.01.2028 | $ | 9.800 | | 9.800 |
| **Magallanes, Inc.** 5,141 % fällig am 15.03.2052 | | 9.800 | | 9.800 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 216.626.989 | $ | 2.156.300 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **U.S. Treasury Notes** 1,875 % fällig am 15.02.2032 | $ | 259.218 | | 236.426 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,875 % fällig am 15.05.2032 | | 139.762 | | 139.413 |
| **U.S. Treasury Bonds** 1,875 % fällig am 15.11.2051 | | 125.471 | | 119.434 |
| **U.S. Treasury Bonds** 2,875 % fällig am 15.05.2049 | | 59.006 | | 64.047 |
| **U.S. Treasury Bonds** 1,625 % fällig am 15.11.2050 | | 60.000 | | 47.991 |
| **U.S. Treasury Notes** 3,375 % fällig am 15.11.2048 | | 40.118 | | 47.124 |
| **Wells Fargo & Co.** 1,741 % fällig am 04.05.2030 | € | 37.400 | | 40.531 |
| **U.S. Treasury Bonds** 1,875 % fällig am 15.02.2041 | $ | 42.300 | | 36.845 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 0,000 % fällig am 05.06.2023 | | 34.000 | | 34.084 |
| **Foxconn Far East Ltd.** 1,625 % fällig am 28.10.2025 | | 34.200 | | 32.602 |
| **Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.** 4,150 % fällig am 18.04.2023 | | 31.600 | | 31.610 |
| **U.S. Treasury Bonds** 3,000 % fällig am 15.02.2048 | | 28.400 | | 30.678 |
| **United Airlines Pass-Through Trust** 5,875 % fällig am 15.04.2029 | | 27.226 | | 27.601 |
| **Australia Government International Bond** 1,750 % fällig am 21.06.2051 | AUD | 57.200 | | 25.453 |
| **Geely Automobile Holdings Ltd.** 4,000 % fällig am 09.12.2024 | $ | 26.500 | | 25.443 |
| **Nationwide Building Society** 5,750 % fällig am 20.06.2027 | £ | 20.400 | | 24.945 |
| **First Abu Dhabi Bank PJSC** 1,189 % fällig am 16.04.2022 | $ | 24.600 | | 24.623 |
| **NatWest Group PLC** 2,000 % fällig am 04.03.2025 | € | 22.220 | | 24.588 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** 6,000 % fällig am 15.01.2026 | | 23.400 | | 24.310 |

(a) Der Global Investment Grade Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **U.S. Treasury Bonds**<br>2,375 % fällig am 15.02.2042 | $ | 57.200 | $ | 54.814 |
| **U.S. Treasury Bonds**<br>2,000 % fällig am 15.11.2041 | | 19.600 | | 19.127 |
| **Bundesrepublik Deutschland**<br>0,000 % fällig am 15.08.2031 | € | 14.700 | | 15.455 |
| **Bank of America Corp.**<br>3,384 % fällig am 02.04.2026 | $ | 11.900 | | 11.896 |
| **Canada Government International Bond**<br>2,250 % fällig am 01.12.2029 | CAD | 12.200 | | 9.637 |
| **GSK Consumer Healthcare Capital U.S. LLC**<br>3,375 % fällig am 24.03.2029 | $ | 9.050 | | 8.954 |
| **Europäische Union**<br>1,250 % fällig am 04.02.2043 | € | 8.000 | | 8.556 |
| **Corebridge Financial, Inc.**<br>3,900 % fällig am 05.04.2032 | $ | 8.200 | | 8.166 |
| **Zoetis, Inc.**<br>2,000 % fällig am 15.05.2030 | | 8.500 | | 7.648 |
| **S&P Global, Inc.**<br>2,700 % fällig am 01.03.2029 | | 7.500 | | 7.444 |
| **Welltower, Inc.**<br>3,850 % fällig am 15.06.2032 | | 7.400 | | 7.396 |
| **Autonomous Community of Madrid**<br>1,723 % fällig am 30.04.2032 | € | 6.000 | | 6.699 |
| **Amgen, Inc.**<br>3,000 % fällig am 22.02.2029 | $ | 6.600 | | 6.526 |
| **Baxter International, Inc.**<br>2,272 % fällig am 01.12.2028 | | 7.000 | | 6.501 |
| **NXP BV**<br>5,000 % fällig am 15.01.2033 | | 6.500 | | 6.481 |
| **NE Property BV**<br>2,000 % fällig am 20.01.2030 | € | 5.400 | | 6.109 |
| **JPMorgan Chase & Co.**<br>2,545 % fällig am 08.11.2032 | $ | 6.300 | | 5.737 |
| **GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust**<br>4,000 % fällig am 20.04.2049 | | 5.800 | | 5.723 |
| **Union Electric Co.**<br>3,900 % fällig am 01.04.2052 | | 5.700 | | 5.697 |
| **Apple, Inc.**<br>1,400 % fällig am 05.08.2028 | | 6.100 | | 5.579 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **Banco do Brasil S.A.**<br>4,875 % fällig am 11.01.2029 | $ | 5.000 | $ | 4.865 |
| **Georgia Power Co.**<br>3,250 % fällig am 15.03.2051 | | 5.730 | | 4.232 |
| **PacifiCorp**<br>2,900 % fällig am 15.06.2052 | | 5.100 | | 3.706 |
| **NongHyup Bank**<br>0,875 % fällig am 28.07.2024 | | 3.500 | | 3.312 |
| **HAT Holdings LLC**<br>3,375 % fällig am 15.06.2026 | | 3.495 | | 3.180 |
| **Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT**<br>4,625 % fällig am 20.07.2023 | | 3.000 | | 3.139 |
| **Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen**<br>5,875 % fällig am 23.05.2042 | | 3.000 | | 3.034 |
| **VIA Outlets BV**<br>1,750 % fällig am 15.11.2028 | € | 3.400 | | 2.975 |
| **Starwood Property Trust, Inc.**<br>4,375 % fällig am 15.01.2027 | $ | 3.100 | | 2.918 |
| **Lloyds Banking Group PLC**<br>3,500 % fällig am 01.04.2026 | € | 2.400 | | 2.797 |
| **Enel Finance International NV**<br>2,650 % fällig am 10.09.2024 | $ | 2.750 | | 2.681 |
| **Southwestern Public Service Co.**<br>3,150 % fällig am 01.05.2050 | | 2.500 | | 2.540 |
| **Mississippi Power Co.**<br>3,100 % fällig am 30.07.2051 | | 3.500 | | 2.494 |
| **Itau Unibanco Holding S.A.**<br>3,250 % fällig am 24.01.2025 | | 2.500 | | 2.455 |
| **Tencent Holdings Ltd.**<br>3,975 % fällig am 11.04.2029 | | 2.200 | | 2.297 |
| **Mirae Asset Securities Co. Ltd.**<br>1,375 % fällig am 07.07.2024 | | 2.400 | | 2.274 |
| **Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.**<br>3,750 % fällig am 23.01.2023 | | 2.100 | | 2.127 |
| **BNG Bank NV**<br>0,250 % fällig am 12.01.2032 | € | 2.000 | | 2.050 |
| **China Construction Bank Corp.**<br>0,000 % fällig am 22.04.2024 | | 2.000 | | 2.029 |
| **Nucor Corp.**<br>3,950 % fällig am 23.05.2025 | $ | 2.000 | | 1.987 |
| **ASTM SpA**<br>1,000 % fällig am 25.11.2026 | € | 2.000 | | 1.932 |
| **Edison International**<br>5,000 % fällig am 15.12.2026 | $ | 1.900 | | 1.929 |
| **John Deere Capital Corp.**<br>3,350 % fällig am 18.04.2029 | | 2.000 | | 1.907 |
| **Hilton Domestic Operating Co., Inc.**<br>4,875 % fällig am 15.01.2030 | | 1.900 | | 1.893 |
| **GSK Consumer Healthcare Capital U.S. LLC**<br>3,375 % fällig am 24.03.2029 | | 2.000 | | 1.861 |
| **Amgen, Inc.**<br>3,000 % fällig am 22.02.2029 | | 2.000 | | 1.835 |
| **Acciona Energia Financiacion Filiales S.A.**<br>0,375 % fällig am 07.10.2027 | € | 2.000 | | 1.828 |
| **Public Service Electric & Gas Co.**<br>3,100 % fällig am 15.03.2032 | $ | 2.000 | | 1.824 |
| **S&P Global, Inc.**<br>2,700 % fällig am 01.03.2029 | | 2.000 | | 1.804 |
| **Natura Cosmeticos S.A.**<br>4,125 % fällig am 03.05.2028 | | 2.000 | | 1.790 |
| **Alexandria Real Estate Equities, Inc.**<br>2,950 % fällig am 15.03.2034 | | 2.000 | | 1.715 |
| **ABB Finance BV**<br>0,489 % fällig am 31.03.2024 | € | 1.600 | | 1.708 |
| **Acciona Energia Financiacion Filiales S.A.**<br>1,375 % fällig am 26.01.2032 | | 1.800 | | 1.686 |
| **UDR, Inc.**<br>3,100 % fällig am 01.11.2034 | $ | 2.000 | | 1.675 |
| **Blue Owl Finance LLC**<br>4,125 % fällig am 07.10.2051 | | 1.700 | | 1.668 |
| **Zoetis, Inc.**<br>2,000 % fällig am 15.05.2030 | | 2.000 | | 1.667 |
| **Quanta Services, Inc.**<br>2,900 % fällig am 01.10.2030 | | 2.000 | | 1.656 |
| **Indonesia Government International Bond**<br>1,300 % fällig am 23.03.2034 | € | 1.500 | | 1.616 |

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 11.101.774 | $ | 110.502 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.10.2026 (b) | $ | 33.606 | | 35.879 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.04.2027 (b) | | 29.345 | | 30.258 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.07.2026 (b) | | 26.438 | | 28.187 |
| **Bundesrepublik Deutschland** 0,100 % fällig am 15.04.2023 | € | 15.366 | | 17.897 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.10.2025 (b) | $ | 16.430 | | 17.452 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,375 % fällig am 15.07.2027 (b) | | 11.928 | | 11.963 |
| **United Kingdom Gilt** 0,125 % fällig am 22.03.2024 | £ | 8.256 | | 11.859 |
| **Nykredit Realkredit A/S** 1,500 % fällig am 01.10.2053 | DKK | 82.100 | | 11.535 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b) | $ | 8.356 | | 8.721 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 0,100 % fällig am 15.05.2033 | € | 6.611 | | 7.670 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b) | $ | 7.229 | | 7.401 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 6.822 | | 7.108 |
| **Nykredit Realkredit A/S** 3,000 % fällig am 01.10.2053 | DKK | 51.100 | | 6.985 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.07.2030 (b) | $ | 6.926 | | 6.887 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** 1,050 % fällig am 15.10.2031 | € | 5.900 | | 6.555 |
| **Ares European CLO DAC** 0,610 % fällig am 15.04.2030 | | 5.641 | | 6.078 |
| **Sound Point CLO Ltd.** 1,994 % fällig am 15.04.2029 | $ | 4.761 | | 4.735 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b) | | 3.978 | | 4.215 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b) | | 3.934 | | 4.125 |
| **Polaris PLC** 1,740 % fällig am 23.10.2059 | £ | 3.000 | | 4.018 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 12.326.608 | $ | 122.700 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.01.2023 (b) | $ | 85.413 | | 88.401 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.07.2031 (b) | | 42.316 | | 44.998 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b) | | 29.519 | | 29.799 |
| **United Kingdom Gilt** 2,500 % fällig am 17.07.2024 | £ | 5.330 | | 26.551 |
| **France Government International Bond** 1,100 % fällig am 25.07.2022 | € | 15.621 | | 17.937 |
| **Nykredit Realkredit A/S** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 121.130 | | 15.267 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 0,400 % fällig am 15.05.2030 | € | 13.074 | | 15.202 |
| **France Government International Bond** 0,250 % fällig am 25.07.2024 | | 11.176 | | 13.595 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.04.2027 (b) | $ | 12.585 | | 12.454 |
| **United Kingdom Gilt** 1,875 % fällig am 22.11.2022 | £ | 8.496 | | 11.905 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,625 % fällig am 15.04.2023 (b) | $ | 11.437 | | 11.803 |
| **France Government International Bond** 0,100 % fällig am 01.03.2029 | € | 8.887 | | 10.947 |
| **Nykredit Realkredit A/S** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 89.800 | | 10.931 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.10.2026 (b) | $ | 10.167 | | 10.827 |
| **Japan Government International Bond** 0,100 % fällig am 10.03.2029 | ¥ | 1.028.695 | | 9.018 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.07.2022 (b) | $ | 7.947 | | 8.105 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b) | | 7.771 | | 8.049 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.01.2031 (b) | | 6.513 | | 6.462 |
| **Spain Government International Bond** 1,400 % fällig am 30.07.2028 | € | 6.200 | | 6.028 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.04.2026 (b) | $ | 5.300 | | 5.616 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.01.2030 (b) | | 5.263 | | 5.384 |

(a) Der Global Low Duration Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 34.751.577 | $ | 345.816 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **United Kingdom Gilt** 0,125 % fällig am 10.08.2031 | £ | 46.677 | | 81.837 |
| **United Kingdom Gilt** 0,750 % fällig am 22.03.2034 | | 36.701 | | 65.288 |
| **United Kingdom Gilt** 1,250 % fällig am 22.11.2027 | | 38.799 | | 65.248 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 0,100 % fällig am 15.05.2033 | € | 53.703 | | 62.306 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.01.2032 (b) | $ | 52.620 | | 55.455 |
| **France Government International Bond** 0,500 % fällig am 25.05.2029 | € | 37.500 | | 36.298 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,625 % fällig am 15.04.2023 (b) | $ | 32.637 | | 33.892 |
| **France Government International Bond** 0,100 % fällig am 25.07.2031 | € | 25.354 | | 33.350 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.01.2023 (b) | $ | 30.621 | | 31.542 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.04.2027 (b) | | 26.914 | | 27.703 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.10.2025 (b) | | 23.423 | | 23.877 |
| **Polaris PLC** 1,740 % fällig am 23.10.2059 | £ | 11.300 | | 15.133 |
| **United Kingdom Gilt** 0,125 % fällig am 22.03.2068 | | 4.442 | | 14.296 |
| **United Kingdom Gilt** 0,500 % fällig am 22.10.2061 | | 16.200 | | 13.448 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,250 % fällig am 15.02.2050 (b) | $ | 14.661 | | 13.111 |
| **Australia Government International Bond** 0,250 % fällig am 21.11.2032 | AUD | 16.900 | | 12.929 |
| **Nykredit Realkredit A/S** 3,500 % fällig am 01.10.2053 | DKK | 87.800 | | 12.166 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b) | $ | 11.563 | | 12.125 |
| **France Government International Bond** 0,100 % fällig am 25.07.2038 | € | 9.981 | | 11.578 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,375 % fällig am 15.07.2027 (b) | $ | 11.338 | | 11.371 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 28.206.680 | $ | 280.700 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b) | $ | 143.743 | | 144.466 |
| **United Kingdom Gilt** 1,250 % fällig am 22.11.2027 | £ | 72.678 | | 118.474 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 0,400 % fällig am 15.05.2030 | € | 100.453 | | 117.494 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.07.2031 (b) | $ | 79.829 | | 85.792 |
| **France Government International Bond** 0,100 % fällig am 01.03.2029 | € | 51.980 | | 57.230 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.01.2031 (b) | $ | 52.729 | | 57.107 |
| **France Government International Bond** 0,700 % fällig am 25.07.2030 | € | 43.364 | | 53.525 |
| **Realkredit Danmark A/S** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 303.000 | | 38.198 |
| **France Government International Bond** 0,250 % fällig am 25.07.2024 | € | 31.352 | | 37.918 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 0,100 % fällig am 15.05.2033 | | 40.126 | | 36.121 |
| **Japan Government International Bond** 0,100 % fällig am 10.03.2029 | ¥ | 3.338.216 | | 29.264 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b) | $ | 27.145 | | 28.114 |
| **Nykredit Realkredit A/S** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 216.732 | | 27.539 |
| **United Kingdom Gilt** 0,125 % fällig am 10.08.2048 | £ | 10.535 | | 26.025 |
| **United Kingdom Gilt** 0,125 % fällig am 22.03.2039 | | 10.707 | | 21.761 |
| **Spain Government International Bond** 0,150 % fällig am 30.11.2023 | € | 17.905 | | 21.132 |
| **France Government International Bond** 0,500 % fällig am 25.05.2029 | | 18.000 | | 17.568 |
| **United Kingdom Gilt** 0,125 % fällig am 22.11.2036 | £ | 8.418 | | 16.587 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.02.2051 (b) | $ | 18.842 | | 16.493 |

(a) Der Global Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **Ripon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,351 % fällig am 28.08.2056 | £ | 610.000 | $ | 832.651 |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | | |
| 1,375 % fällig am 15.08.2050 | $ | 830.000 | | 539.500 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 53.456.632 | | 532.137 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **U.S. Treasury Bonds** 1,250 % fällig am 15.05.2050 | $ | 500.000 | | 314.063 |
| **Freddie Mac** 3,500 % fällig am 01.07.2052 | | 281.019 | | 278.878 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,875 % fällig am 15.05.2032 | | 248.790 | | 248.739 |
| **Fannie Mae** 4,000 % fällig am 01.08.2051 | | 226.482 | | 239.646 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,375 % fällig am 31.03.2029 | | 224.600 | | 222.822 |
| **U.S. Treasury Bonds** 2,250 % fällig am 15.02.2052 | | 260.620 | | 211.794 |
| **Freddie Mac** 3,000 % fällig am 01.06.2052 | | 210.603 | | 205.280 |
| **Carvana Co.** 10,250 % fällig am 01.05.2030 | | 204.910 | | 203.253 |
| **Fannie Mae** 4,000 % fällig am 01.10.2051 | | 177.478 | | 187.794 |
| **Freddie Mac** 3,000 % fällig am 01.07.2052 | | 177.161 | | 172.683 |
| **Fannie Mae** 3,500 % fällig am 01.05.2052 | | 173.400 | | 170.898 |
| **Fannie Mae** 3,000 % fällig am 01.07.2052 | | 156.843 | | 152.879 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** 4,920 % fällig am 01.02.2029 | | 100.154 | | 99.152 |
| **Market Bidco Finco PLC** 4,750 % fällig am 04.11.2027 | € | 103.700 | | 95.016 |
| **PG&E Wildfire Recovery Funding LLC** 4,451 % fällig am 01.12.2049 | $ | 91.730 | | 91.727 |
| **Fannie Mae** 4,000 % fällig am 01.08.2050 | | 79.971 | | 84.619 |
| **Ginnie Mae** 2,500 % fällig am 20.04.2052 | | 66.093 | | 66.127 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 108.138.201 | $ | 1.076.300 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **U.S. Treasury Notes** 1,125 % fällig am 15.02.2031 | $ | 439.881 | | 382.940 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,625 % fällig am 31.01.2026 | | 381.000 | | 378.655 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** 4,000 % fällig am 01.03.2049 | | 321.901 | | 326.629 |
| **China Development Bank** 3,740 % fällig am 10.09.2025 | CNY | 1.530.900 | | 249.049 |
| **U.S. Treasury Bonds** 2,250 % fällig am 15.08.2046 | $ | 250.000 | | 243.906 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,250 % fällig am 15.07.2029 (b) | | 212.266 | | 221.351 |
| **Fannie Mae** 4,000 % fällig am 01.08.2051 | | 213.588 | | 220.212 |
| **U.S. Treasury Bonds** 1,375 % fällig am 15.08.2050 | | 250.000 | | 200.801 |
| **Fannie Mae** 4,000 % fällig am 01.10.2051 | | 169.263 | | 174.512 |
| **China Development Bank** 2,890 % fällig am 22.06.2025 | CNY | 1.048.500 | | 166.075 |
| **China Development Bank** 4,150 % fällig am 26.10.2025 | | 933.800 | | 154.016 |
| **China Development Bank** 3,680 % fällig am 26.02.2026 | | 909.100 | | 147.767 |
| **Turkey Government International Bond** 5,600 % fällig am 14.11.2024 | $ | 111.200 | | 105.651 |
| **Community Health Systems, Inc.** 5,625 % fällig am 15.03.2027 | | 100.400 | | 103.148 |
| **Turkey Government International Bond** 7,250 % fällig am 23.12.2023 | | 92.300 | | 94.917 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,375 % fällig am 31.03.2029 | | 84.900 | | 82.113 |
| **Fannie Mae** 4,000 % fällig am 01.08.2050 | | 75.393 | | 77.731 |
| **Turkey Government International Bond** 6,350 % fällig am 10.08.2024 | | 75.718 | | 73.358 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b) | | 65.529 | | 70.162 |

(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, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 342.023 | $ | 3.404 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **U.S. Treasury Notes** 2,750 % fällig am 15.05.2025 | $ | 2.500 | | 2.508 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** 1,914 % fällig am 25.07.2036 | | 661 | | 664 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** 2,599 % fällig am 25.05.2035 | | 711 | | 663 |
| **Home Equity Asset Trust** 1,666 % fällig am 25.04.2036 | | 737 | | 663 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** 2,164 % fällig am 25.03.2036 | | 731 | | 663 |
| **U.S. Treasury Bonds** 3,250 % fällig am 15.05.2042 | | 600 | | 610 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** 1,741 % fällig am 25.10.2035 | | 700 | | 603 |
| **Newgate Funding PLC** 1,026 % fällig am 01.12.2050 | £ | 419 | | 499 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,375 % fällig am 31.03.2029 | $ | 500 | | 496 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** 3,735 % fällig am 05.01.2031 | | 457 | | 458 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** 5,900 % fällig am 15.06.2032 | | 300 | | 299 |
| **Huarong Finance Co. Ltd.** 3,375 % fällig am 24.02.2030 | | 300 | | 274 |
| **Romania Government International Bond** 3,750 % fällig am 07.02.2034 | € | 220 | | 246 |
| **Prosus NV** 3,257 % fällig am 19.01.2027 | $ | 200 | | 200 |
| **Studio City Co. Ltd.** 7,000 % fällig am 15.02.2027 | | 200 | | 200 |
| **UBS Group AG** 4,875 % fällig am 12.02.2027 | | 200 | | 200 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** 5,250 % fällig am 01.03.2052 | | 200 | | 199 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** 2,700 % fällig am 12.07.2026 | | 200 | | 155 |
| **Magallanes, Inc.** 4,054 % fällig am 15.03.2029 | | 150 | | 150 |
| **NCL Corp. Ltd.** 5,875 % fällig am 15.02.2027 | | 150 | | 150 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 301.330 | $ | 3.000 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Fannie Mae** 4,000 % fällig am 01.03.2051 | $ | 688 | | 709 |
| **Freddie Mac** 4,000 % fällig am 01.05.2049 | | 268 | | 276 |

(a) Der Income Fund II legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 4.395.146 | $ | 43.749 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.01.2032 (b) | $ | 40.733 | | 43.011 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **Invesco Physical Gold ETC** | | 209.881 | | 38.805 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 0,400 % fällig am 15.05.2030 | € | 15.534 | | 17.833 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.10.2026 (b) | $ | 11.797 | | 12.479 |
| **Spain Government International Bond** 0,650 % fällig am 30.11.2027 | € | 9.821 | | 12.268 |
| **United Kingdom Gilt** 0,125 % fällig am 10.08.2031 | £ | 6.709 | | 11.463 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,375 % fällig am 15.07.2027 (b) | $ | 10.023 | | 10.144 |
| **South Africa Government International Bond** 2,000 % fällig am 31.01.2025 | ZAR | 129.236 | | 8.397 |
| **France Government International Bond** 0,100 % fällig am 25.07.2031 | € | 6.070 | | 8.014 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,875 % fällig am 15.02.2047 (b) | $ | 6.802 | | 7.298 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.04.2027 (b) | | 6.628 | | 6.825 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 1,400 % fällig am 26.05.2025 | € | 4.780 | | 5.817 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 0,100 % fällig am 15.05.2033 | | 4.679 | | 5.428 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b) | $ | 5.026 | | 5.326 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.07.2031 (b) | | 3.980 | | 4.317 |
| **United Kingdom Gilt** 0,125 % fällig am 22.03.2046 | £ | 1.616 | | 3.078 |
| **United Kingdom Gilt** 0,500 % fällig am 22.03.2050 | | 1.212 | | 2.891 |
| **United Kingdom Gilt** 0,250 % fällig am 22.03.2052 | | 1.189 | | 2.579 |
| **United Kingdom Gilt** 0,125 % fällig am 10.08.2048 | | 1.421 | | 2.456 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 0,400 % fällig am 15.05.2030 | € | 20.097 | $ | 22.480 |
| **South Africa Government International Bond** 2,000 % fällig am 31.01.2025 | ZAR | 138.240 | | 9.523 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 954.163 | | 9.500 |
| **Invesco Physical Gold ETC** | | 38.700 | | 7.074 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.07.2031 (b) | $ | 5.395 | | 5.514 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b) | | 5.436 | | 5.474 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.04.2027 (b) | | 5.525 | | 5.468 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 0,100 % fällig am 15.05.2033 | € | 3.503 | | 3.152 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.01.2032 (b) | $ | 2.818 | | 3.119 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **Cheniere Energy, Inc.** | | 20.143 | | 2.866 |
| **Williams Cos., Inc.** | | 73.337 | | 2.520 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Mexico Government International Bond** 4,500 % fällig am 22.11.2035 | MXN | 46.318 | | 2.503 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **Targa Resources Corp.** | | 30.899 | | 2.366 |
| **Enbridge, Inc.** | | 39.492 | | 1.830 |
| **ONEOK, Inc.** | | 23.650 | | 1.680 |
| **TC Energy Corp.** | | 27.922 | | 1.603 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **France Government International Bond** 0,700 % fällig am 25.07.2030 | € | 1.259 | | 1.554 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **Hess Midstream LP** | | 41.038 | | 1.252 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **France Government International Bond** 0,100 % fällig am 25.07.2036 | € | 1.015 | | 1.186 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **Ovintiv, Inc.** | | 21.923 | | 1.141 |
| **Diamondback Energy, Inc.** | | 7.949 | | 1.115 |
| **Coterra Energy, Inc.** | | 37.589 | | 1.075 |

(a) Der Inflation Multi-Asset Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 28.353.746 | $ | 282.166 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **U.S. Treasury Notes** 0,875 % fällig am 31.01.2024 | $ | 244.100 | | 240.906 |
| **U.S. Treasury Notes** 1,500 % fällig am 29.02.2024 | | 190.000 | | 190.109 |
| **South Africa Government International Bond** 10,500 % fällig am 21.12.2026 | ZAR | 176.300 | | 12.622 |
| **Toronto-Dominion Bank** 2,350 % fällig am 08.03.2024 | $ | 11.400 | | 11.390 |
| **Morgan Stanley** 2,630 % fällig am 18.02.2026 | | 10.700 | | 10.700 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 3,000 % fällig am 15.03.2024 | | 8.300 | | 8.293 |
| **Fannie Mae** 3,000 % fällig am 01.04.2052 | | 8.200 | | 8.033 |
| **Ripon Mortgages PLC** 1,351 % fällig am 28.08.2056 | £ | 5.800 | | 7.917 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** 3,000 % fällig am 01.02.2052 | $ | 7.789 | | 7.914 |
| **Citigroup, Inc.** 3,290 % fällig am 17.03.2026 | | 7.700 | | 7.700 |
| **South Africa Government International Bond** 10,500 % fällig am 21.12.2026 | ZAR | 110.000 | | 7.681 |
| **Rogers Communications, Inc.** 2,950 % fällig am 15.03.2025 | $ | 7.600 | | 7.595 |
| **Fortress Investment Group LLC** 2,753 % fällig am 23.02.2039 | | 7.200 | | 7.155 |
| **Morgan Stanley** 3,620 % fällig am 17.04.2025 | | 5.000 | | 5.000 |
| **Regatta Funding Ltd.** 2,294 % fällig am 17.10.2030 | | 4.600 | | 4.589 |
| **Commercial Mortgage Trust** 3,147 % fällig am 15.08.2045 | | 4.519 | | 4.523 |
| **Barclays Commercial Mortgage Securities Trust** 2,174 % fällig am 15.08.2036 | | 4.600 | | 4.515 |
| **Wells Fargo & Co.** 3,908 % fällig am 25.04.2026 | | 4.400 | | 4.400 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** 1,361 % fällig am 20.07.2045 | £ | 3.319 | | 4.389 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 24.536.798 | $ | 244.200 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Rogers Communications, Inc.** 2,950 % fällig am 15.03.2025 | $ | 7.600 | | 7.278 |
| **Volkswagen Financial Services NV** 1,625 % fällig am 30.11.2022 | £ | 5.800 | | 6.921 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 3,000 % fällig am 15.03.2024 | $ | 5.000 | | 4.909 |
| **Citigroup, Inc.** 4,140 % fällig am 24.05.2025 | | 4.000 | | 4.035 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** 3,800 % fällig am 07.04.2025 | | 4.000 | | 3.947 |
| **Morgan Stanley** 2,630 % fällig am 18.02.2026 | | 4.000 | | 3.859 |
| **Capital One Financial Corp.** 2,636 % fällig am 03.03.2026 | | 4.100 | | 3.842 |
| **Bank of Nova Scotia** 2,440 % fällig am 11.03.2024 | | 3.800 | | 3.700 |
| **Anthem, Inc.** 0,450 % fällig am 15.03.2023 | | 3.700 | | 3.637 |
| **Citigroup, Inc.** 3,290 % fällig am 17.03.2026 | | 3.700 | | 3.567 |
| **Toyota Motor Corp.** 0,681 % fällig am 25.03.2024 | | 3.700 | | 3.556 |
| **Daimler Finance North America LLC** 2,550 % fällig am 15.08.2022 | | 3.500 | | 3.500 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** 0,849 % fällig am 08.09.2024 | | 3.600 | | 3.481 |
| **Commonwealth Bank of Australia** 2,296 % fällig am 14.03.2025 | | 3.600 | | 3.428 |
| **Verizon Communications, Inc.** 2,355 % fällig am 15.03.2032 | | 3.640 | | 3.221 |
| **American Express Co.** 2,250 % fällig am 04.03.2025 | | 3.300 | | 3.196 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 1,217 % fällig am 06.12.2023 | | 3.200 | | 3.081 |
| **Marsh & McLennan Cos., Inc.** 3,500 % fällig am 03.06.2024 | | 3.100 | | 3.072 |
| **Hyundai Capital America** 0,800 % fällig am 03.04.2023 | | 3.100 | | 3.021 |

(a) Der Low Average 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, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 10.198.118 | $ | 101.495 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **U.S. Treasury Notes** 1,500 % fällig am 29.02.2024 | $ | 20.500 | | 20.495 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,250 % fällig am 31.03.2024 | | 12.100 | | 11.999 |
| **South Africa Government International Bond** 10,500 % fällig am 21.12.2026 | ZAR | 139.500 | | 10.408 |
| **GSK Consumer Healthcare Capital NL BV** 1,250 % fällig am 29.03.2026 | € | 3.700 | | 4.070 |
| **Weir Group PLC** 2,200 % fällig am 13.05.2026 | $ | 3.800 | | 3.626 |
| **Societe Generale S.A.** 4,677 % fällig am 15.06.2027 | | 3.500 | | 3.500 |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** 3,800 % fällig am 15.09.2022 | | 3.300 | | 3.339 |
| **American Medical Systems Europe BV** 0,750 % fällig am 08.03.2025 | € | 3.000 | | 3.318 |
| **Nykredit Realkredit A/S** 1,375 % fällig am 12.07.2027 | | 3.000 | | 3.304 |
| **Protective Life Global Funding** 4,714 % fällig am 06.07.2027 | $ | 3.300 | | 3.300 |
| **Mitsubishi Corp.** 2,625 % fällig am 14.07.2022 | | 3.200 | | 3.215 |
| **Citigroup, Inc.** 3,290 % fällig am 17.03.2026 | | 3.200 | | 3.200 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 3,000 % fällig am 15.03.2024 | | 3.200 | | 3.197 |
| **Southern California Edison Co.** 4,200 % fällig am 01.06.2025 | | 3.200 | | 3.196 |
| **Sempra Energy** 3,300 % fällig am 01.04.2025 | | 3.100 | | 3.095 |
| **IMCD NV** 2,125 % fällig am 31.03.2027 | € | 2.700 | | 2.954 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** 2,439 % fällig am 17.11.2023 | $ | 2.900 | | 2.858 |
| **Southern Power Co.** 0,900 % fällig am 15.01.2026 | | 3.000 | | 2.847 |
| **Studio City Co. Ltd.** 7,000 % fällig am 15.02.2027 | | 2.800 | | 2.800 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 15.535.016 | $ | 154.600 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **U.S. Treasury Notes** 0,625 % fällig am 31.07.2026 | $ | 5.200 | | 4.964 |
| **U.S. Treasury Notes** 0,750 % fällig am 30.04.2026 | | 3.800 | | 3.616 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 3,375 % fällig am 27.03.2025 | € | 3.100 | | 3.575 |
| **U.S. Treasury Notes** 0,750 % fällig am 31.08.2026 | $ | 3.500 | | 3.358 |
| **U.S. Treasury Notes** 0,875 % fällig am 30.09.2026 | | 3.500 | | 3.345 |
| **Morgan Stanley** 0,637 % fällig am 26.07.2024 | € | 2.800 | | 3.079 |
| **U.S. Treasury Notes** 0,750 % fällig am 31.05.2026 | $ | 3.200 | | 3.026 |
| **Contemporary Ruiding Development Ltd.** 1,500 % fällig am 09.09.2026 | | 3.300 | | 2.933 |
| **Industrial & Commercial Bank of China Ltd.** 1,000 % fällig am 20.07.2023 | | 2.500 | | 2.461 |
| **Argan S.A.** 1,011 % fällig am 17.11.2026 | € | 2.000 | | 2.192 |
| **Itau Unibanco Holding S.A.** 2,900 % fällig am 24.01.2023 | $ | 1.950 | | 1.957 |
| **Banco BTG Pactual S.A.** 5,500 % fällig am 31.01.2023 | | 1.700 | | 1.730 |
| **Block Financial LLC** 5,250 % fällig am 01.10.2025 | | 1.600 | | 1.667 |
| **Enact Holdings, Inc.** 6,500 % fällig am 15.08.2025 | | 1.500 | | 1.553 |
| **Banco Santander S.A.** 1,849 % fällig am 25.03.2026 | | 1.600 | | 1.479 |
| **Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.** 4,150 % fällig am 18.04.2023 | | 1.400 | | 1.398 |
| **State Grid Overseas Investment BVI Ltd.** 3,750 % fällig am 02.05.2023 | | 1.300 | | 1.322 |
| **Syngenta Finance NV** 3,375 % fällig am 16.04.2026 | € | 1.000 | | 1.240 |
| **Standard Industries, Inc.** 2,250 % fällig am 21.11.2026 | | 1.100 | | 1.140 |

(a) Der Low Duration Global Investment Grade Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 6.444.480 | $ | 64.129 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **U.S. Treasury Notes** 2,375 % fällig am 31.03.2029 | $ | 25.000 | | 24.802 |
| **Canada Square Funding PLC** 1,379 % fällig am 17.01.2059 | £ | 12.788 | | 15.707 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Trust** 3,224 % fällig am 15.07.2032 | $ | 15.277 | | 15.049 |
| **Dufry One BV** 2,500 % fällig am 15.10.2024 | € | 8.142 | | 9.157 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** 1,764 % fällig am 25.12.2036 | $ | 9.763 | | 8.457 |
| **Magallanes, Inc.** 3,788 % fällig am 15.03.2025 | | 7.700 | | 7.700 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,875 % fällig am 15.05.2032 | | 6.600 | | 6.599 |
| **Harbour Energy PLC** 1,305 % fällig am 28.01.2054 | £ | 5.284 | | 6.506 |
| **Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust** 2,089 % fällig am 25.05.2036 | $ | 6.856 | | 6.350 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** 3,250 % fällig am 16.02.2024 | | 5.800 | | 5.798 |
| **Uber Technologies, Inc.** 7,500 % fällig am 15.05.2025 | | 5.100 | | 5.334 |
| **Harbour Energy PLC** 1,405 % fällig am 28.01.2054 | £ | 3.247 | | 4.196 |
| **Sprint Corp.** 7,875 % fällig am 15.09.2023 | $ | 3.800 | | 4.095 |
| **SLM Student Loan Trust** 0,269 % fällig am 15.12.2033 | € | 4.075 | | 4.014 |
| **Carvana Co.** 10,250 % fällig am 01.05.2030 | $ | 3.700 | | 3.700 |
| **DISH DBS Corp.** 5,875 % fällig am 15.07.2022 | | 3.600 | | 3.650 |
| **Intercontinental Exchange, Inc.** 3,650 % fällig am 23.05.2025 | | 3.650 | | 3.646 |
| **280 Park Avenue Mortgage Trust** 2,071 % fällig am 15.09.2034 | | 3.300 | | 3.255 |
| **Navient Corp.** 5,500 % fällig am 25.01.2023 | | 2.900 | | 2.962 |
| **Freddie Mac** 2,000 % fällig am 01.03.2052 | | 2.900 | | 2.879 |
| **Romania Government International Bond** 3,750 % fällig am 07.02.2034 | € | 2.400 | | 2.683 |
| **Sprint Corp.** 7,125 % fällig am 15.06.2024 | $ | 2.463 | | 2.682 |
| **Societe Generale S.A.** 7,875 % fällig am 18.12.2023 | | 2.500 | | 2.666 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 12.294.343 | $ | 122.320 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Scientific Games International, Inc.** 1,000 % fällig am 14.08.2024 | $ | 10.696 | | 10.696 |
| **U.S. Treasury Notes** 1,125 % fällig am 15.02.2031 | | 11.649 | | 10.142 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,375 % fällig am 31.03.2029 | | 9.400 | | 9.091 |
| **CTP NV** 0,625 % fällig am 27.09.2026 | € | 7.400 | | 8.002 |
| **Magallanes, Inc.** 3,788 % fällig am 15.03.2025 | $ | 7.700 | | 7.588 |
| **Hilton Domestic Operating Co., Inc.** 3,750 % fällig am 01.05.2029 | | 8.800 | | 7.545 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** 3,875 % fällig am 15.05.2027 | | 7.513 | | 7.375 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** 3,250 % fällig am 16.02.2024 | | 5.800 | | 5.727 |
| **Dufry One BV** 2,500 % fällig am 15.10.2024 | € | 4.567 | | 4.803 |
| **Nissan Motor Co. Ltd.** 2,652 % fällig am 17.03.2026 | | 3.993 | | 4.756 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** 4,250 % fällig am 01.08.2023 | $ | 3.699 | | 3.718 |
| **Intercontinental Exchange, Inc.** 3,650 % fällig am 23.05.2025 | | 3.650 | | 3.619 |
| **Cromwell Ereit Lux Finco SARL** 2,125 % fällig am 19.11.2025 | € | 2.667 | | 3.008 |
| **Banco do Brasil S.A.** 3,875 % fällig am 10.10.2022 | $ | 2.766 | | 2.796 |
| **Freddie Mac** 2,000 % fällig am 01.03.2052 | | 2.900 | | 2.768 |
| **Caesars Entertainment, Inc.** 6,250 % fällig am 01.07.2025 | | 2.800 | | 2.702 |
| **Western Digital Corp.** 4,750 % fällig am 15.02.2026 | | 2.500 | | 2.616 |
| **Intercontinental Exchange, Inc.** 4,600 % fällig am 15.03.2033 | | 2.600 | | 2.531 |
| **Lundin Energy Finance BV** 3,100 % fällig am 15.07.2031 | | 2.400 | | 2.396 |

(a) Der Low Duration Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 5.595.392 | $ | 55.699 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Stratton BTL Mortgage Funding** 1,217 % fällig am 20.01.2054 | £ | 11.200 | | 15.181 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** 0,720 % fällig am 15.10.2031 | € | 10.000 | | 11.418 |
| **Boston Scientific Corp.** 2,650 % fällig am 01.06.2030 | $ | 11.600 | | 10.637 |
| **U.S. Treasury Notes** 1,375 % fällig am 15.11.2031 | | 10.200 | | 9.813 |
| **Wells Fargo & Co.** 3,526 % fällig am 24.03.2028 | | 8.500 | | 8.500 |
| **Sasol Financing USA LLC** 5,875 % fällig am 27.03.2024 | | 8.200 | | 8.496 |
| **Harmony French Home Loans** 0,301 % fällig am 27.05.2062 | € | 7.500 | | 8.412 |
| **Madison Park Funding Ltd.** 1,794 % fällig am 15.04.2029 | $ | 8.017 | | 7.956 |
| **JPMorgan Chase & Co.** 2,947 % fällig am 24.02.2028 | | 7.400 | | 7.400 |
| **Sound Point CLO Ltd.** 2,194 % fällig am 18.04.2031 | | 7.400 | | 7.388 |
| **Southern California Edison Co.** 2,750 % fällig am 01.02.2032 | | 7.900 | | 7.265 |
| **Barley Hill PLC** 1,892 % fällig am 27.08.2058 | £ | 5.200 | | 7.082 |
| **Carbone CLO Ltd.** 2,203 % fällig am 20.01.2031 | $ | 6.931 | | 6.909 |
| **Bank of America Corp.** 3,384 % fällig am 02.04.2026 | | 6.800 | | 6.800 |
| **Citigroup, Inc.** 3,785 % fällig am 17.03.2033 | | 6.500 | | 6.500 |
| **TIAA CLO Ltd.** 2,263 % fällig am 20.07.2031 | | 6.500 | | 6.486 |
| **Voya CLO Ltd.** 2,254 % fällig am 15.10.2030 | | 6.473 | | 6.453 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 3,615 % fällig am 15.03.2028 | | 6.200 | | 6.200 |
| **CVC Cordatus Loan Fund DAC** 0,780 % fällig am 15.08.2032 | € | 5.500 | | 6.058 |
| **Octagon Investment Partners Ltd.** 2,004 % fällig am 16.04.2031 | $ | 5.900 | | 5.862 |
| **VICI Properties LP** 4,750 % fällig am 15.02.2028 | | 5.800 | | 5.796 |
| **Georgia Power Co.** 2,100 % fällig am 30.07.2023 | | 5.580 | | 5.529 |
| **Aurium CLO DAC** 1,050 % fällig am 23.03.2032 | € | 5.000 | | 5.483 |
| **Benefit Street Partners CLO Ltd.** 2,163 % fällig am 20.01.2031 | $ | 5.500 | | 5.466 |
| **BNP Paribas S.A.** 2,871 % fällig am 19.04.2032 | | 6.000 | | 5.464 |
| **Dryden Senior Loan Fund** 1,944 % fällig am 15.04.2029 | | 5.274 | | 5.239 |
| **Southern California Gas Co.** 2,950 % fällig am 15.04.2027 | | 5.200 | | 5.175 |
| **ICG U.S. CLO Ltd.** 2,216 % fällig am 22.07.2031 | | 5.200 | | 5.170 |
| **EQT AB** 2,875 % fällig am 06.04.2032 | € | 4.600 | | 5.105 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 6.451.927 | $ | 64.201 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **U.S. Treasury Notes** 0,750 % fällig am 31.03.2026 | $ | 50.600 | | 47.973 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,125 % fällig am 31.05.2026 | | 23.200 | | 23.579 |
| **U.S. Treasury Notes** 1,375 % fällig am 31.10.2028 | | 21.900 | | 21.128 |
| **U.S. Treasury Notes** 1,875 % fällig am 31.07.2026 | | 17.700 | | 17.777 |
| **U.S. Treasury Notes** 0,875 % fällig am 30.06.2026 | | 16.400 | | 15.704 |
| **U.S. Treasury Notes** 1,375 % fällig am 15.11.2031 | | 10.200 | | 9.842 |
| **Lazard Group LLC** 4,375 % fällig am 11.03.2029 | | 6.300 | | 6.891 |
| **Boston Scientific Corp.** 2,650 % fällig am 01.06.2030 | | 6.700 | | 6.625 |
| **Petrobras Global Finance BV** 5,375 % fällig am 01.10.2029 | £ | 3.300 | | 3.917 |
| **Friary PLC** 1,358 % fällig am 21.11.2067 | | 2.534 | | 3.366 |
| **QNB Finance Ltd.** 1,125 % fällig am 17.06.2024 | $ | 3.400 | | 3.222 |
| **Petronas Capital Ltd.** 3,500 % fällig am 21.04.2030 | | 2.400 | | 2.431 |
| **Qatar Government International Bond** 4,500 % fällig am 23.04.2028 | | 1.600 | | 1.646 |
| **Saudi Government International Bond** 3,625 % fällig am 04.03.2028 | | 1.600 | | 1.562 |
| **Lagardere S.A.** 1,750 % fällig am 07.10.2027 | € | 1.500 | | 1.440 |
| **CAB SELAS** 3,375 % fällig am 01.02.2028 | | 1.500 | | 1.296 |
| **Southwest Airlines Co.** 5,250 % fällig am 04.05.2025 | $ | 1.200 | | 1.222 |
| **Darrowby PLC** 1,320 % fällig am 20.12.2057 | £ | 918 | | 1.205 |
| **APA Infrastructure Ltd.** 2,500 % fällig am 15.03.2036 | | 1.300 | | 1.169 |

(a) Der Global Libor Plus Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 1.619.692 | $ | 16.121 |
| Pioneer Natural Resources Co. | 14.400 | | 3.543 |
| Chesapeake Energy Corp. | 41.100 | | 3.411 |
| Pembina Pipeline Corp. | 81.200 | | 3.131 |
| EOG Resources, Inc. | 26.800 | | 3.129 |
| Southwestern Energy Co. | 359.600 | | 2.980 |
| EnLink Midstream LLC | 292.900 | | 2.900 |
| DTE Midstream LLC | 43.500 | | 2.429 |
| EQT Corp. | 54.300 | | 2.392 |
| Range Resources Corp. | 58.800 | | 2.113 |
| Targa Resources Corp. | 28.700 | | 2.061 |
| Equitrans Midstream Corp. | 213.500 | | 1.666 |
| Occidental Petroleum Corp. | 25.800 | | 1.562 |
| Diamondback Energy, Inc. | 11.500 | | 1.538 |
| Antero Resources Corp. | 44.600 | | 1.490 |
| Coterra Energy, Inc. | 55.200 | | 1.279 |
| Ovintiv, Inc. | 27.200 | | 1.190 |
| Marathon Oil Corp. | 51.900 | | 1.060 |
| Hess Midstream LP | 22.000 | | 649 |
| Rattler Midstream LP | 44.000 | | 573 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 1.346.644 | $ | 13.400 |
| Hess Midstream LP | 122.486 | | 3.730 |
| Coterra Energy, Inc. | 107.791 | | 3.599 |
| Marathon Oil Corp. | 111.700 | | 3.193 |
| Rattler Midstream LP | 131.100 | | 1.933 |
| Pioneer Natural Resources Co. | 6.400 | | 1.517 |
| EQT Corp. | 29.800 | | 1.289 |
| ONEOK, Inc. | 19.500 | | 1.243 |
| Ovintiv, Inc. | 23.600 | | 1.236 |
| Southwestern Energy Co. | 135.200 | | 1.224 |
| Cheniere Energy, Inc. | 5.500 | | 723 |
| Diamondback Energy, Inc. | 3.200 | | 475 |
| Chesapeake Energy Corp. | 5.000 | | 469 |
| TC Energy Corp. | 8.500 | | 469 |
| Targa Resources Corp. | 6.900 | | 469 |
| Enbridge, Inc. | 10.600 | | 468 |
| Pembina Pipeline Corp. | 11.900 | | 465 |
| Williams Cos., Inc. | 14.000 | | 465 |
| Occidental Petroleum Corp. | 7.700 | | 464 |

(a) Der PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 82.651.266 | $ | 822.680 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC** 2,540 % fällig am 21.10.2028 | £ | 11.400 | | 15.426 |
| **Fannie Mae** 3,500 % fällig am 01.04.2052 | $ | 15.500 | | 15.367 |
| **U.S. Treasury Notes** 1,875 % fällig am 15.02.2032 | | 15.400 | | 15.122 |
| **Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC** 3,840 % fällig am 21.10.2028 | £ | 8.775 | | 11.874 |
| **KKR CLO Ltd.** 2,444 % fällig am 15.04.2031 | $ | 10.800 | | 10.638 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** 1,764 % fällig am 25.12.2036 | | 9.763 | | 8.457 |
| **PG&E Wildfire Recovery Funding LLC** 4,451 % fällig am 01.12.2049 | | 7.500 | | 7.500 |
| **Chester B1 Issuer PLC** 1,750 % fällig am 17.01.2058 | £ | 5.888 | | 7.337 |
| **Ginnie Mae** 3,500 % fällig am 20.01.2052 | $ | 6.998 | | 7.317 |
| **Barley Hill PLC** 2,372 % fällig am 27.08.2058 | £ | 4.900 | | 6.674 |
| **Ginnie Mae** 3,500 % fällig am 20.03.2052 | $ | 6.764 | | 6.295 |
| **Fannie Mae** 1,624 % fällig am 25.02.2052 | | 109.996 | | 5.706 |
| **225 Liberty Street Trust** 4,803 % fällig am 10.02.2036 | | 5.000 | | 4.766 |
| **Ginnie Mae** 3,500 % fällig am 20.02.2052 | | 4.200 | | 4.372 |
| **Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC** 2,890 % fällig am 21.10.2028 | £ | 3.200 | | 4.330 |
| **Twin Bridges PLC** 2,324 % fällig am 01.12.2055 | | 3.007 | | 4.106 |
| **Stratton BTL Mortgage Funding** 2,137 % fällig am 20.01.2054 | | 3.000 | | 4.066 |
| **Barley Hill PLC** 2,672 % fällig am 27.08.2058 | | 2.953 | | 4.022 |
| **Freddie Mac** 3,500 % fällig am 01.04.2052 | $ | 3.989 | | 3.958 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 91.662.079 | $ | 912.334 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Fannie Mae** 3,000 % fällig am 01.06.2051 | $ | 48.652 | | 50.002 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** 2,000 % fällig am 01.04.2036 | | 19.095 | | 17.585 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** 2,500 % fällig am 01.01.2051 | | 17.777 | | 15.622 |
| **Freddie Mac** 0,000 % fällig am 15.08.2056 | | 21.192 | | 15.251 |
| **Fannie Mae** 3,500 % fällig am 01.04.2052 | | 15.388 | | 14.496 |
| **U.S. Treasury Notes** 1,875 % fällig am 15.02.2032 | | 15.400 | | 13.951 |
| **Fannie Mae** 4,000 % fällig am 01.08.2051 | | 11.229 | | 11.394 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** 2,500 % fällig am 01.01.2051 | | 11.532 | | 10.134 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** 2,500 % fällig am 01.12.2050 | | 11.148 | | 9.796 |
| **Fannie Mae** 2,500 % fällig am 01.02.2051 | | 10.283 | | 8.984 |
| **Fannie Mae** 2,500 % fällig am 01.02.2056 | | 9.435 | | 8.244 |
| **Freddie Mac** 4,000 % fällig am 15.05.2048 | | 8.071 | | 7.844 |
| **Freddie Mac** 0,000 % fällig am 15.08.2057 | | 9.690 | | 6.977 |
| **Uniform Mortgage-Backed Security** 4,000 % fällig am 01.03.2049 | | 6.712 | | 6.811 |
| **TICP CLO Ltd.** 1,903 % fällig am 20.04.2028 | | 6.546 | | 6.465 |
| **Fannie Mae** 3,270 % fällig am 01.12.2027 | | 5.584 | | 5.947 |
| **Freddie Mac** 0,000 % fällig am 15.08.2057 | | 8.045 | | 5.838 |
| **Fannie Mae** 2,500 % fällig am 01.09.2051 | | 6.053 | | 5.288 |
| **OZLM Ltd.** 2,441 % fällig am 16.05.2030 | | 5.300 | | 5.218 |

(a) Der Mortgage Opportunities Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 2.670.068 | $ 26.572 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Shamrock Residential DAC** 0,338 % fällig am 24.01.2061 | € | 23.700 | 25.475 |
| **Ripon Mortgages PLC** 1,351 % fällig am 28.08.2056 | £ | 14.200 | 19.383 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 2,905 % fällig am 24.07.2023 | $ | 16.390 | 16.542 |
| **Verus Securitization Trust** 1,829 % fällig am 25.10.2066 | | 14.102 | 13.167 |
| **245 Park Avenue Trust** 3,508 % fällig am 05.06.2037 | | 12.203 | 12.721 |
| **GS Mortgage Securities Trust** 2,773 % fällig am 10.11.2045 | | 12.622 | 12.645 |
| **Lehman XS Trust** 1,804 % fällig am 25.07.2037 | | 12.122 | 11.309 |
| **Dutch Property Finance BV** 1,750 % fällig am 28.04.2050 | € | 9.579 | 9.989 |
| **Nationstar Home Equity Loan Trust** 1,944 % fällig am 25.04.2037 | $ | 10.004 | 9.828 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.02.2052 (b) | | 10.686 | 9.464 |
| **Dutch Property Finance BV** 1,250 % fällig am 28.04.2050 | € | 8.000 | 8.645 |
| **BX Trust** 2,344 % fällig am 15.05.2035 | $ | 7.010 | 6.975 |
| **GA Global Funding Trust** 2,148 % fällig am 11.04.2025 | | 6.800 | 6.800 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** 1,884 % fällig am 25.08.2036 | | 6.935 | 6.781 |
| **Polaris PLC** 1,740 % fällig am 23.10.2059 | £ | 5.000 | 6.696 |
| **Navient Private Education Loan Trust** 2,774 % fällig am 16.07.2040 | $ | 5.868 | 5.926 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** 2,539 % fällig am 25.09.2035 | | 6.000 | 5.895 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** 2,124 % fällig am 25.01.2046 | | 5.985 | 5.882 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** 1,804 % fällig am 25.09.2036 | | 7.692 | 5.585 |
| **Lloyds Banking Group PLC** 3,511 % fällig am 18.03.2026 | | 5.300 | 5.300 |
| **HSBC Holdings PLC** 2,999 % fällig am 10.03.2026 | | 5.000 | 5.000 |
| **GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates** 2,264 % fällig am 25.12.2035 | | 4.969 | 4.958 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Trust** 3,850 % fällig am 25.09.2057 | | 4.773 | 4.884 |
| **Impac CMB Trust** 2,164 % fällig am 25.05.2035 | | 4.900 | 4.854 |
| **Avoca CLO DAC** 0,820 % fällig am 15.10.2032 | € | 4.200 | 4.750 |
| **Citigroup, Inc.** 2,876 % fällig am 24.07.2023 | $ | 4.500 | 4.538 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** 2,124 % fällig am 25.06.2037 | | 6.132 | 4.365 |
| **Avon Finance PLC** 1,690 % fällig am 20.09.2048 | £ | 2.981 | 4.044 |
| **Nomura Resecuritization Trust** 2,524 % fällig am 25.03.2037 | $ | 4.095 | 4.002 |
| **Broadcom, Inc.** 4,000 % fällig am 15.04.2029 | | 4.000 | 3.998 |
| **Mortimer BTL PLC** 1,862 % fällig am 21.06.2052 | £ | 2.919 | 3.973 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 21.480.477 | $ 213.800 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **U.S. Treasury Notes** 2,875 % fällig am 30.09.2023 | $ | 75.980 | 76.511 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b) | | 25.512 | 26.208 |
| | | **AKTIEN** | |
| **Amazon.com, Inc.** | | 9.000 | 25.676 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Bank of America Corp.** 0,652 % fällig am 24.08.2025 | € | 23.500 | 24.600 |
| **Trinity Square PLC** 1,300 % fällig am 15.07.2059 | £ | 19.177 | 23.897 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** 1,361 % fällig am 20.07.2045 | | 18.354 | 22.999 |
| **U.S. Treasury Bonds** 3,000 % fällig am 15.02.2049 | $ | 13.000 | 12.778 |
| **Marvell Technology, Inc.** 4,200 % fällig am 22.06.2023 | | 11.025 | 11.138 |
| **GS Mortgage Securities Trust** 2,773 % fällig am 10.11.2045 | | 10.854 | 10.853 |
| **U.S. Treasury Notes** 3,000 % fällig am 30.09.2025 | | 9.600 | 9.658 |
| **U.S. Treasury Notes** 3,000 % fällig am 31.10.2025 | | 9.600 | 9.658 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** 1,703 % fällig am 25.05.2053 | £ | 7.572 | 9.459 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 1,000 % fällig am 15.02.2049 (b) | $ | 7.462 | 9.135 |
| **Huntington Ingalls Industries, Inc.** 0,670 % fällig am 16.08.2023 | | 9.000 | 8.697 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b) | | 8.205 | 8.581 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.07.2030 (b) | | 8.479 | 8.500 |
| **Charter Communications Operating LLC** 2,936 % fällig am 01.02.2024 | | 8.331 | 8.436 |
| **Barclays PLC** 2,375 % fällig am 06.10.2023 | £ | 6.700 | 8.356 |
| **Conagra Brands, Inc.** 0,500 % fällig am 11.08.2023 | $ | 8.100 | 7.832 |
| **Southern California Edison Co.** 0,700 % fällig am 01.08.2023 | | 8.000 | 7.772 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** 1,361 % fällig am 20.07.2045 | £ | 5.968 | 7.497 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,875 % fällig am 30.11.2023 | $ | 7.120 | 7.166 |
| **Venture CLO Ltd.** 1,924 % fällig am 15.04.2027 | | 7.210 | 7.161 |
| **Israel Government International Bond** 0,750 % fällig am 31.07.2022 | ILS | 23.800 | 7.052 |

(a) Der StocksPLUS™ Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 20.200 $ | 201 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Nykredit Realkredit A/S** 1,500 % fällig am 01.10.2053 | DKK | 800 | 111 |
| **Dutch Property Finance BV** 1,250 % fällig am 28.04.2050 | € | 100 | 108 |
| **Shamrock Residential DAC** 0,338 % fällig am 24.01.2061 | | 100 | 107 |
| **245 Park Avenue Trust** 3,508 % fällig am 05.06.2037 | $ | 100 | 105 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 3,330 % fällig am 15.03.2028 | | 100 | 100 |
| **Magallanes, Inc.** 4,279 % fällig am 15.03.2032 | | 100 | 100 |
| **LoanCore Issuer Ltd.** 2,624 % fällig am 15.07.2036 | | 100 | 98 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 40.191 $ | 400 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **U.S. Treasury Notes** 1,125 % fällig am 15.02.2031 | $ | 300 | 279 |

(a) Der PIMCO StocksPLUS™ AR Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Strategic Income Fund

30. Juni 2022

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | 13.990.036 | $ 139.259 |
| | **PARI (000S)** | |
| **U.S. Treasury Notes** 2,875 % fällig am 30.04.2029 | $8.700 | 8.587 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** 1,486 % fällig am 25.04.2036 | 8.149 | 7.266 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,375 % fällig am 31.03.2029 | 4.200 | 4.167 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** 1,146 % fällig am 25.01.2037 | 2.668 | 2.119 |
| **Carvana Co.** 10,250 % fällig am 01.05.2030 | 2.120 | 2.070 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** 2,616 % fällig am 25.12.2036 | 2.128 | 1.926 |
| | **AKTIEN** | |
| **Chevron Corp.** | 12.187 | 1.812 |
| **BHP Group Ltd.** | 48.742 | 1.723 |
| **Exxon Mobil Corp.** | 19.681 | 1.642 |
| | **PARI (000S)** | |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** 1,981 % fällig am 25.09.2035 | $1.635 | 1.472 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** 2,656 % fällig am 25.04.2037 | 2.001 | 1.403 |
| | **AKTIEN** | |
| **AT&T, Inc.** | 63.404 | 1.393 |
| **Altria Group, Inc.** | 26.783 | 1.372 |
| | **PARI (000S)** | |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** 2,606 % fällig am 25.04.2037 | $1.933 | 1.354 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** 4,920 % fällig am 01.02.2029 | 1.183 | 1.171 |
| | **AKTIEN** | |
| **Verizon Communications, Inc.** | 22.362 | 1.139 |
| **Assicurazioni Generali SpA** | 51.438 | 1.121 |
| | **PARI (000S)** | |
| **PG&E Wildfire Recovery Funding LLC** 4,451 % fällig am 01.12.2049 | $1.100 | 1.100 |
| | **AKTIEN** | |
| **Rio Tinto PLC** | 13.983 | 1.066 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 11.774.857 | $ 117.200 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **U.S. Treasury Notes** 2,625 % fällig am 31.01.2026 | $ | 5.700 | 5.665 |
| | | **AKTIEN** | |
| **Exxon Mobil Corp.** | | 44.262 | 3.705 |
| **Chevron Corp.** | | 23.336 | 3.657 |
| **TotalEnergies SE** | | 55.573 | 2.902 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **China Development Bank** 3,740 % fällig am 10.09.2025 | CNY | 16.000 | 2.603 |
| | | **AKTIEN** | |
| **Altria Group, Inc.** | | 42.394 | 2.236 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **China Development Bank** 3,680 % fällig am 26.02.2026 | CNY | 12.600 | 2.049 |
| **China Development Bank** 2,890 % fällig am 22.06.2025 | | 10.600 | 1.680 |
| | | **AKTIEN** | |
| **Valero Energy Corp.** | | 16.163 | 1.664 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **U.S. Treasury Notes** 1,125 % fällig am 15.02.2031 | $ | 1.880 | 1.637 |
| | | **AKTIEN** | |
| **AT&T, Inc.** | | 70.558 | 1.557 |
| **Warner Bros Discovery, Inc.** | | 60.407 | 1.498 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **China Development Bank** 4,150 % fällig am 26.10.2025 | CNY | 8.900 | 1.468 |
| **Nationwide Building Society** 5,750 % fällig am 20.06.2027 | £ | 1.000 | 1.330 |
| | | **AKTIEN** | |
| **BHP Group Ltd.** | | 37.948 | 1.297 |
| **AbbVie, Inc.** | | 7.902 | 1.203 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Turkey Government International Bond** 5,600 % fällig am 14.11.2024 | $ | 1.200 | 1.153 |
| | | **AKTIEN** | |
| **Marathon Petroleum Corp.** | | 12.593 | 1.073 |
| **Telefonica S.A.** | | 215.487 | 1.048 |

(a) Der Strategic Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 35.274.355 $ | 351.003 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Canada Government International Bond** 2,250 % fällig am 01.12.2029 | CAD | 38.600 | 30.491 |
| **Ripon Mortgages PLC** 1,351 % fällig am 28.08.2056 | £ | 17.600 | 24.024 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,875 % fällig am 15.05.2032 | $ | 25.000 | 23.973 |
| **U.S. Treasury Notes** 1,875 % fällig am 28.02.2027 | | 16.700 | 16.755 |
| **Israel Treasury Bills** 0,000 % fällig am 03.08.2022 | ILS | 54.380 | 16.526 |
| **Palmer Square European Loan Funding DAC** 0,720 % fällig am 15.10.2031 | € | 11.700 | 13.358 |
| **Enel Finance International NV** 2,875 % fällig am 11.04.2029 | £ | 10.000 | 13.109 |
| **Logicor Financing SARL** 2,000 % fällig am 17.01.2034 | € | 11.600 | 12.966 |
| **Romania Government International Bond** 3,000 % fällig am 27.02.2027 | $ | 12.000 | 11.927 |
| **International Development Association** 1,750 % fällig am 05.05.2037 | € | 11.100 | 11.793 |
| **CTP NV** 0,875 % fällig am 20.01.2026 | | 10.200 | 11.659 |
| **EQT AB** 2,375 % fällig am 06.04.2028 | | 10.000 | 11.112 |
| **Carlyle Euro CLO DAC** 0,630 % fällig am 15.08.2030 | | 9.733 | 11.038 |
| **JPMorgan Chase & Co.** 2,947 % fällig am 24.02.2028 | $ | 11.000 | 11.000 |
| **Citigroup, Inc.** 3,070 % fällig am 24.02.2028 | | 11.000 | 11.000 |
| **Vonovia SE** 1,375 % fällig am 28.01.2026 | € | 9.900 | 10.879 |
| **GS Mortgage Securities Trust** 2,773 % fällig am 10.11.2045 | $ | 10.680 | 10.700 |
| **Prologis International Funding S.A.** 3,125 % fällig am 01.06.2031 | € | 10.000 | 10.488 |
| **Barings CLO Ltd.** 1,863 % fällig am 20.01.2028 | $ | 10.464 | 10.464 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 4,387 % fällig am 15.06.2027 | | 10.000 | 10.000 |
| **ABN AMRO Bank NV** 2,375 % fällig am 01.06.2027 | € | 9.000 | 9.619 |
| **HCA, Inc.** 3,125 % fällig am 15.03.2027 | $ | 9.200 | 9.182 |
| **EQT AB** 2,875 % fällig am 06.04.2032 | € | 7.400 | 8.213 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)** | | 3.260.360 $ | 322.876 |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 15.761.153 | 156.900 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Lloyds Banking Group PLC** 7,625 % fällig am 27.06.2023 | £ | 57.070 | 78.251 |
| **U.S. Treasury Bonds** 3,000 % fällig am 15.11.2044 | $ | 33.200 | 38.005 |
| **U.S. Treasury Bonds** 1,375 % fällig am 15.08.2050 | | 39.400 | 32.806 |
| **Grupo Aval Ltd.** 4,750 % fällig am 26.09.2022 | | 17.000 | 17.107 |
| **Qatar Government International Bond** 3,875 % fällig am 23.04.2023 | | 16.400 | 16.622 |
| **Los Angeles Community College District, California General Obligation Notes, Series 2020** 1,606 % fällig am 01.08.2028 | | 15.800 | 15.315 |
| **Shinhan Bank Co. Ltd.** 0,250 % fällig am 16.10.2024 | € | 14.000 | 14.167 |
| **Sutter Health** 2,294 % fällig am 15.08.2030 | $ | 12.700 | 10.847 |
| **JPMorgan Chase & Co.** 2,947 % fällig am 24.02.2028 | | 11.000 | 10.442 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** 6,000 % fällig am 15.04.2024 | | 10.000 | 10.150 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** 4,250 % fällig am 15.05.2023 | | 10.000 | 10.028 |
| **Qatar Government International Bond** 3,375 % fällig am 14.03.2024 | | 10.000 | 9.960 |
| **ING Groep NV** 1,400 % fällig am 01.07.2026 | | 11.000 | 9.930 |
| **Puget Energy, Inc.** 4,100 % fällig am 15.06.2030 | | 10.400 | 9.882 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 4,387 % fällig am 15.06.2027 | | 10.000 | 9.806 |
| **Nidec Corp.** 0,046 % fällig am 30.03.2026 | € | 10.000 | 9.472 |
| **Chanel Ceres PLC** 1,000 % fällig am 31.07.2031 | | 10.200 | 8.958 |
| **U.S. Treasury Bonds** 1,750 % fällig am 15.08.2041 | $ | 10.000 | 8.093 |

(a) Der Total Return Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 2.884.527 $ | 28.707 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **HSBC Holdings PLC** 3,033 % fällig am 22.11.2023 | $ | 1.500 | 1.500 |
| **Emirate of Abu Dhabi Government International Bond** 0,750 % fällig am 02.09.2023 | | 1.500 | 1.461 |
| **Panasonic Holdings Corp.** 2,536 % fällig am 19.07.2022 | | 1.220 | 1.222 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** 3,250 % fällig am 05.01.2023 | | 1.200 | 1.207 |
| **UBS AG** 1,619 % fällig am 09.08.2024 | | 1.200 | 1.193 |
| **ING Bank Australia Ltd.** 4,000 % fällig am 26.05.2025 | AUD | 1.600 | 1.120 |
| **Huntington National Bank** 2,419 % fällig am 16.05.2025 | $ | 1.100 | 1.100 |
| **Barry Callebaut Services NV** 5,500 % fällig am 15.06.2023 | | 1.000 | 1.022 |
| **Stellantis NV** 5,250 % fällig am 15.04.2023 | | 1.000 | 1.018 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** 5,625 % fällig am 15.04.2023 | | 1.000 | 1.018 |
| **CNH Industrial NV** 4,500 % fällig am 15.08.2023 | | 1.000 | 1.014 |
| **SK Broadband Co. Ltd.** 3,875 % fällig am 13.08.2023 | | 1.000 | 1.009 |
| **American Tower Corp.** 3,500 % fällig am 31.01.2023 | | 1.000 | 1.007 |
| **Nordea Bank Abp** 2,538 % fällig am 30.08.2023 | | 1.000 | 1.005 |
| **Santander Holdings USA, Inc.** 3,400 % fällig am 18.01.2023 | | 1.000 | 1.005 |
| **BNP Paribas S.A.** 3,800 % fällig am 10.01.2024 | | 1.000 | 1.004 |
| **Nationwide Building Society** 3,766 % fällig am 08.03.2024 | | 1.000 | 1.003 |
| **Engie S.A.** 2,875 % fällig am 10.10.2022 | | 1.000 | 1.002 |
| **Discovery Communications LLC** 2,950 % fällig am 20.03.2023 | | 1.000 | 1.002 |
| **UBS Group AG** 3,491 % fällig am 23.05.2023 | | 1.000 | 1.000 |
| **Amazon.com, Inc.** 2,730 % fällig am 13.04.2024 | | 1.000 | 1.000 |
| **CK Hutchison International Ltd.** 3,250 % fällig am 11.04.2024 | | 1.000 | 998 |
| **Lloyds Banking Group PLC** 2,907 % fällig am 07.11.2023 | | 1.000 | 998 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 2,250 % fällig am 02.05.2024 | AUD | 1.300 | 990 |
| **BAT Capital Corp.** 3,222 % fällig am 15.08.2024 | $ | 1.000 | 990 |
| **California Infrastructure & Economic Development Bank Revenue Bonds, Series 2020** 0,850 % fällig am 01.01.2050 | | 1.000 | 990 |
| **Chugoku Electric Power Co., Inc.** 2,401 % fällig am 27.08.2024 | | 1.000 | 982 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** 0,875 % fällig am 18.09.2023 | | 1.000 | 968 |
| **Deutsche Bank AG** 0,898 % fällig am 28.05.2024 | | 1.000 | 954 |
| **Dell International LLC** 5,450 % fällig am 15.06.2023 | | 900 | 922 |
| **Bank of America Corp.** 3,004 % fällig am 20.12.2023 | | 900 | 898 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** 2,436 % fällig am 07.03.2023 | AUD | 1.200 | 874 |
| **Korea National Oil Corp.** 1,919 % fällig am 16.07.2023 | $ | 800 | 804 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** 2,839 % fällig am 15.12.2023 | | 800 | 803 |
| **Citigroup, Inc.** 2,876 % fällig am 24.07.2023 | | 800 | 800 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 2.110.129 $ | 21.000 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Ginnie Mae** 1,603 % fällig am 20.05.2066 | $ | 1.213 | 1.226 |

(a) Der PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | |
| **United Kingdom Gilt** 0,500 % fällig am 22.07.2022 | £ | 66.380 £ | 66.362 |
| **United Kingdom Gilt** 1,750 % fällig am 07.09.2022 | | 11.250 | 11.260 |
| **United Kingdom Gilt** 4,000 % fällig am 07.03.2022 | | 5.750 | 5.774 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF (a)** | | 51.000 | 5.173 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 3,625 % fällig am 29.10.2029 | £ | 3.500 | 3.489 |
| **United Kingdom Treasury Bill** 0,000 % fällig am 04.04.2022 | | 3.300 | 3.300 |
| **Motability Operations Group PLC** 2,125 % fällig am 18.01.2042 | | 3.300 | 3.244 |
| **London & Quadrant Housing Trust** 2,000 % fällig am 31.03.2032 | | 3.200 | 3.173 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** 2,421 % fällig am 17.01.2029 | | 2.600 | 2.600 |
| **Sage Group PLC** 2,875 % fällig am 08.02.2034 | | 2.500 | 2.486 |
| **Volkswagen Financial Services NV** 2,125 % fällig am 18.01.2028 | | 2.300 | 2.288 |
| **BNP Paribas S.A.** 0,875 % fällig am 11.07.2030 | € | 2.700 | 2.233 |
| **Nestle Holdings, Inc.** 2,500 % fällig am 04.04.2032 | £ | 2.000 | 2.000 |
| **BNP Paribas S.A.** 2,875 % fällig am 24.02.2029 | | 2.000 | 1.986 |
| **South Eastern Power Networks PLC** 1,750 % fällig am 30.09.2034 | | 2.100 | 1.834 |
| **AT&T, Inc.** 4,250 % fällig am 01.06.2043 | | 1.400 | 1.683 |
| **Bank of America Corp.** 3,584 % fällig am 27.04.2031 | | 1.500 | 1.500 |
| **Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung** 1,250 % fällig am 13.12.2028 | | 1.500 | 1.497 |
| **Equinor ASA** 4,250 % fällig am 10.04.2041 | | 1.100 | 1.422 |
| **Barley Hill PLC** 1,892 % fällig am 27.08.2058 | | 1.400 | 1.400 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | |
| **United Kingdom Gilt** 4,000 % fällig am 07.03.2022 | £ | 9.200 | £ 9.231 |
| **United Kingdom Gilt** 0,875 % fällig am 31.07.2033 | | 4.000 | 3.817 |
| **Italy Government International Bond** 6,000 % fällig am 04.08.2028 | | 2.500 | 3.032 |
| **BNP Paribas S.A.** 0,875 % fällig am 11.07.2030 | € | 2.700 | 2.145 |
| **Enel Finance International NV** 2,650 % fällig am 10.09.2024 | $ | 2.800 | 2.118 |
| **Bank of America Corp.** 1,667 % fällig am 02.06.2029 | £ | 2.183 | 1.977 |
| **BNP Paribas S.A.** 2,000 % fällig am 24.05.2031 | | 2.000 | 1.886 |
| **United Kingdom Gilt** 1,500 % fällig am 31.07.2053 | | 1.800 | 1.846 |
| **Eastern Power Networks PLC** 1,875 % fällig am 01.06.2035 | | 2.100 | 1.830 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 1,500 % fällig am 07.12.2027 | | 1.800 | 1.615 |
| **Lendlease Europe Finance PLC** 3,500 % fällig am 02.12.2033 | | 1.800 | 1.533 |
| **Telecom Italia SpA** 5,875 % fällig am 19.05.2023 | | 1.400 | 1.418 |
| **Volkswagen Financial Services NV** 3,250 % fällig am 13.04.2027 | | 1.400 | 1.368 |
| **Diageo Finance PLC** 2,750 % fällig am 08.06.2038 | | 1.400 | 1.292 |
| **Trafford Centre Finance Ltd.** 2,033 % fällig am 28.07.2038 | | 1.350 | 1.176 |
| **UBS Group AG** 3,126 % fällig am 13.08.2030 | $ | 1.600 | 1.161 |
| **Syngenta Finance NV** 4,441 % fällig am 24.04.2023 | | 1.400 | 1.133 |
| **Holding d'Infrastructures de Transport SASU** 1,625 % fällig am 18.09.2029 | € | 1.300 | 1.118 |
| **Dallas Area Rapid Transit, Texas Revenue Bonds, Series 2020** 2,578 % fällig am 01.12.2035 | $ | 1.600 | 1.112 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** 2,629 % fällig am 25.07.2035 | | 1.500 | 1.101 |
| **TP ICAP Finance PLC** 2,625 % fällig am 18.11.2028 | £ | 1.250 | 1.091 |
| **Nykredit Realkredit A/S** 0,375 % fällig am 17.01.2028 | € | 1.300 | 1.052 |

(a) Der UK Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** 0,500 % fällig am 22.07.2022 | £ | 17.900 | £ | 17.887 |
| **United Kingdom Gilt** 1,500 % fällig am 31.07.2053 | | 9.800 | | 10.015 |
| **United Kingdom Gilt** 4,000 % fällig am 07.03.2022 | | 9.900 | | 9.937 |
| **London & Quadrant Housing Trust** 2,000 % fällig am 31.03.2032 | | 3.000 | | 2.928 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 3,625 % fällig am 29.10.2029 | | 2.300 | | 2.293 |
| **GlaxoSmithKline Capital PLC** 1,625 % fällig am 12.05.2035 | | 2.500 | | 2.194 |
| **Motability Operations Group PLC** 2,125 % fällig am 18.01.2042 | | 2.100 | | 2.064 |
| **Nestle Holdings, Inc.** 2,500 % fällig am 04.04.2032 | | 1.500 | | 1.500 |
| **Hexagon Housing Association Ltd.** 3,625 % fällig am 22.04.2048 | | 1.500 | | 1.489 |
| **NatWest Group PLC** 3,619 % fällig am 29.03.2029 | | 1.400 | | 1.400 |
| **Sage Group PLC** 2,875 % fällig am 08.02.2034 | | 1.400 | | 1.392 |
| **Verizon Communications, Inc.** 3,375 % fällig am 27.10.2036 | | 1.300 | | 1.367 |
| **AT&T, Inc.** 4,250 % fällig am 01.06.2043 | | 1.000 | | 1.202 |
| **Prologis International Funding S.A.** 3,000 % fällig am 22.02.2042 | | 1.200 | | 1.193 |
| **E.ON International Finance BV** 5,875 % fällig am 30.10.2037 | | 800 | | 1.164 |
| **GSK Consumer Healthcare Capital UK PLC** 3,375 % fällig am 29.03.2038 | | 1.020 | | 1.024 |
| **Equinor ASA** 4,250 % fällig am 10.04.2041 | | 800 | | 1.005 |
| **E.ON International Finance BV** 4,750 % fällig am 31.01.2034 | | 800 | | 950 |
| **Yorkshire Housing Finance PLC** 4,125 % fällig am 31.10.2044 | | 700 | | 895 |
| **Diageo Finance PLC** 2,750 % fällig am 08.06.2038 | | 900 | | 895 |
| **Jigsaw Funding PLC** 3,375 % fällig am 05.05.2052 | | 900 | | 880 |
| **Apple, Inc.** 3,600 % fällig am 31.07.2042 | | 700 | | 848 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** 0,500 % fällig am 22.07.2022 | £ | 17.900 | £ | 17.888 |
| **United Kingdom Gilt** 4,000 % fällig am 07.03.2022 | | 15.500 | | 15.550 |
| **E.ON International Finance BV** 4,750 % fällig am 31.01.2034 | | 2.000 | | 2.045 |
| **Electricite de France S.A.** 2,625 % fällig am 01.12.2027 | € | 3.000 | | 1.951 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** 2,629 % fällig am 25.07.2035 | $ | 2.557 | | 1.877 |
| **GlaxoSmithKline Capital, Inc.** 4,200 % fällig am 18.03.2043 | | 2.000 | | 1.668 |
| **Aroundtown S.A.** 3,625 % fällig am 10.04.2031 | £ | 1.550 | | 1.352 |
| **Mondelez International Holdings Netherlands BV** 1,250 % fällig am 09.09.2041 | € | 1.700 | | 1.291 |
| **United Kingdom Gilt** 1,500 % fällig am 31.07.2053 | £ | 1.700 | | 1.277 |
| **M&G PLC** 6,340 % fällig am 19.12.2063 | | 1.100 | | 1.274 |
| **United Kingdom Gilt** 3,500 % fällig am 22.01.2045 | | 1.100 | | 1.229 |
| **Orange S.A.** 5,500 % fällig am 06.02.2044 | $ | 1.300 | | 1.225 |
| **GE Capital UK Funding Unlimited Co.** 5,875 % fällig am 18.01.2033 | £ | 1.100 | | 1.210 |
| **American Tower Corp.** 1,250 % fällig am 21.05.2033 | € | 1.700 | | 1.151 |
| **MPT Operating Partnership LP** 3,375 % fällig am 24.04.2030 | £ | 1.400 | | 1.127 |
| **Trafford Centre Finance Ltd.** 7,030 % fällig am 28.01.2029 | | 1.013 | | 1.046 |
| **APA Infrastructure Ltd.** 2,500 % fällig am 15.03.2036 | | 1.100 | | 1.036 |
| **Trafford Centre Finance Ltd.** 2,033 % fällig am 28.07.2038 | | 1.050 | | 915 |
| **Fiserv, Inc.** 3,000 % fällig am 01.07.2031 | | 1.000 | | 897 |
| **Wells Fargo & Co.** 4,625 % fällig am 02.11.2035 | | 850 | | 863 |

(a) Der UK Long Term Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 70.880.687 | $ 705.598 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Condor Merger Sub, Inc.** 7,375 % fällig am 15.02.2030 | $ | 15.000 | 14.970 |
| **Minerva Merger Sub, Inc.** 6,500 % fällig am 15.02.2030 | | 10.000 | 9.844 |
| **Clydesdale Acquisition Holdings, Inc.** 8,750 % fällig am 15.04.2030 | | 10.000 | 9.398 |
| **Scientific Games Holdings LP** 6,625 % fällig am 01.03.2030 | | 8.750 | 8.750 |
| **Fertitta Entertainment LLC** 6,750 % fällig am 15.01.2030 | | 7.750 | 7.750 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** 2,900 % fällig am 10.02.2029 | | 8.000 | 7.740 |
| **Ctec GmbH** 5,250 % fällig am 15.02.2030 | € | 5.000 | 5.510 |
| **Diamond Sports Group LLC** 1,000 % fällig am 26.05.2026 | $ | 5.474 | 5.278 |
| **Tenet Healthcare Corp.** 6,125 % fällig am 15.06.2030 | | 5.000 | 5.000 |
| **Olympus Water U.S. Holding Corp.** 6,250 % fällig am 01.10.2029 | | 4.250 | 4.080 |
| **CDI Escrow Issuer, Inc.** 5,750 % fällig am 01.04.2030 | | 3.500 | 3.500 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** 4,920 % fällig am 01.02.2029 | | 3.330 | 3.297 |
| **BellRing Brands, Inc.** 7,000 % fällig am 15.03.2030 | | 3.250 | 3.250 |
| **Community Health Systems, Inc.** 5,250 % fällig am 15.05.2030 | | 3.000 | 3.000 |
| **NCL Corp. Ltd.** 7,750 % fällig am 15.02.2029 | | 3.000 | 3.000 |
| **SRS Distribution, Inc.** 6,000 % fällig am 01.12.2029 | | 3.000 | 3.000 |
| **Callon Petroleum Co.** 7,500 % fällig am 15.06.2030 | | 2.500 | 2.500 |
| **Diamond BC BV** 4,625 % fällig am 01.10.2029 | | 2.500 | 2.359 |
| **Carvana Co.** 4,875 % fällig am 01.09.2029 | | 3.500 | 2.319 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 82.983.563 | $ 826.031 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Kraft Heinz Foods Co.** 5,200 % fällig am 15.07.2045 | $ | 15.000 | 16.247 |
| **Sprint Corp.** 7,875 % fällig am 15.09.2023 | | 10.000 | 10.849 |
| **CNX Resources Corp.** 6,000 % fällig am 15.01.2029 | | 8.500 | 8.827 |
| **Freeport-McMoRan, Inc.** 5,400 % fällig am 14.11.2034 | | 7.400 | 8.456 |
| **Surgery Center Holdings, Inc.** 1,000 % fällig am 31.08.2026 | | 8.393 | 8.424 |
| | | **AKTIEN** | |
| **Noble Corp.** | | 233.685 | 8.261 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Surgery Center Holdings, Inc.** 10,000 % fällig am 15.04.2027 | $ | 7.000 | 7.315 |
| **Caesars Entertainment, Inc.** 8,125 % fällig am 01.07.2027 | | 6.000 | 6.290 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** 5,584 % fällig am 18.03.2024 | | 6.000 | 6.083 |
| **Diamond Sports Group LLC** 1,000 % fällig am 26.05.2026 | | 5.474 | 5.503 |
| **Lloyds Banking Group PLC** 7,500 % fällig am 27.06.2024 | | 5.000 | 5.438 |
| **Victors Merger Corp.** 6,375 % fällig am 15.05.2029 | | 8.000 | 5.429 |
| **Sprint Corp.** 7,125 % fällig am 15.06.2024 | | 5.000 | 5.281 |
| **PDC Energy, Inc.** 5,750 % fällig am 15.05.2026 | | 5.250 | 5.267 |
| **Howmet Aerospace, Inc.** 5,125 % fällig am 01.10.2024 | | 5.000 | 5.255 |
| **CSC Holdings LLC** 5,875 % fällig am 15.09.2022 | | 5.000 | 5.094 |
| **DISH DBS Corp.** 5,000 % fällig am 15.03.2023 | | 5.000 | 5.088 |
| **NGL Energy Operating LLC** 7,500 % fällig am 01.02.2026 | | 5.000 | 5.088 |
| **MGM Resorts International** 6,000 % fällig am 15.03.2023 | | 5.000 | 5.081 |

(a) Der US High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 15.264.017 | $ | 151.908 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **U.S. Treasury Notes** 1,875 % fällig am 15.02.2032 | $ | 25.301 | | 24.864 |
| **U.S. Treasury Bonds** 1,875 % fällig am 15.11.2051 | | 16.494 | | 15.274 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,875 % fällig am 15.05.2032 | | 11.834 | | 11.796 |
| **U.S. Treasury Bonds** 2,000 % fällig am 15.11.2041 | | 8.100 | | 7.961 |
| **South Africa Government International Bond** 10,500 % fällig am 21.12.2026 | ZAR | 65.000 | | 4.840 |
| **U.S. Treasury Bonds** 2,875 % fällig am 15.05.2052 | $ | 3.100 | | 2.954 |
| **U.S. Treasury Bonds** 2,250 % fällig am 15.02.2052 | | 3.200 | | 2.682 |
| **GSK Consumer Healthcare Capital U.S. LLC** 3,375 % fällig am 24.03.2029 | | 2.650 | | 2.623 |
| **American Tower Corp.** 3,650 % fällig am 15.03.2027 | | 2.300 | | 2.289 |
| **Nomura Holdings, Inc.** 5,386 % fällig am 06.07.2027 | | 2.100 | | 2.100 |
| **Wells Fargo & Co.** 3,350 % fällig am 02.03.2033 | | 2.100 | | 2.100 |
| **Georgia Power Co.** 4,700 % fällig am 15.05.2032 | | 1.800 | | 1.794 |
| **Citigroup, Inc.** 3,785 % fällig am 17.03.2033 | | 1.600 | | 1.600 |
| **Targa Resources Corp.** 5,200 % fällig am 01.07.2027 | | 1.600 | | 1.598 |
| **MPLX LP** 4,950 % fällig am 14.03.2052 | | 1.600 | | 1.584 |
| **Brookfield Finance, Inc.** 3,900 % fällig am 25.01.2028 | | 1.400 | | 1.500 |
| **Intercontinental Exchange, Inc.** 4,350 % fällig am 15.06.2029 | | 1.400 | | 1.399 |
| **Weyerhaeuser Co.** 3,375 % fällig am 09.03.2033 | | 1.300 | | 1.293 |
| **Magallanes, Inc.** 5,050 % fällig am 15.03.2042 | | 1.200 | | 1.200 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 12.177.811 | $ | 121.200 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **U.S. Treasury Notes** 2,375 % fällig am 15.05.2051 | $ | 29.949 | | 27.085 |
| **U.S. Treasury Bonds** 1,875 % fällig am 15.02.2041 | | 30.700 | | 25.230 |
| **U.S. Treasury Notes** 1,875 % fällig am 15.02.2032 | | 16.454 | | 15.416 |
| **U.S. Treasury Bonds** 1,875 % fällig am 15.11.2051 | | 16.494 | | 13.667 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,875 % fällig am 15.05.2032 | | 8.328 | | 8.307 |
| **Atlantia SpA** 1,875 % fällig am 12.02.2028 | € | 7.900 | | 7.557 |
| **U.S. Treasury Bonds** 2,000 % fällig am 15.11.2041 | $ | 8.100 | | 6.728 |
| **Dell International LLC** 6,020 % fällig am 15.06.2026 | | 6.100 | | 6.461 |
| **U.S. Treasury Bonds** 1,750 % fällig am 15.08.2041 | | 8.100 | | 6.446 |
| **JPMorgan Chase & Co.** 3,960 % fällig am 29.01.2027 | | 6.100 | | 6.112 |
| **U.S. Treasury Bonds** 2,250 % fällig am 15.05.2041 | | 6.000 | | 5.224 |
| **Boeing Co.** 5,150 % fällig am 01.05.2030 | | 4.300 | | 4.574 |
| **HSBC Holdings PLC** 3,973 % fällig am 22.05.2030 | | 4.600 | | 4.329 |
| **U.S. Treasury Bonds** 1,375 % fällig am 15.08.2050 | | 5.700 | | 4.168 |
| **Sempra Energy** 3,250 % fällig am 15.06.2027 | | 3.889 | | 3.994 |
| **VMware, Inc.** 3,900 % fällig am 21.08.2027 | | 3.695 | | 3.895 |
| **Enel Finance International NV** 1,875 % fällig am 12.07.2028 | | 4.000 | | 3.742 |
| **Barclays PLC** 6,125 % fällig am 15.12.2025 | | 3.500 | | 3.500 |
| **AT&T, Inc.** 2,550 % fällig am 01.12.2033 | | 3.589 | | 3.328 |

a) Der US Investment Grade Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2022** | | | | |
| **U.S. Treasury Notes** 1,500 % fällig am 29.02.2024 | $ | 243.200 | $ | 240.232 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 13.069.525 | | 130.103 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **U.S. Treasury Notes** 2,500 % fällig am 31.05.2024 | $ | 117.700 | | 117.364 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,750 % fällig am 15.05.2025 | | 72.200 | | 72.034 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,500 % fällig am 30.04.2024 | | 51.000 | | 51.000 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,250 % fällig am 31.03.2024 | | 40.400 | | 40.310 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** 5,625 % fällig am 15.04.2023 | | 23.945 | | 24.351 |
| **Stellantis NV** 5,250 % fällig am 15.04.2023 | | 18.137 | | 18.457 |
| **Wells Fargo & Co.** 2,295 % fällig am 25.04.2026 | | 18.400 | | 18.400 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** 3,950 % fällig am 06.06.2025 | | 15.700 | | 15.693 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** 2,066 % fällig am 21.03.2024 | | 15.600 | | 15.600 |
| **UBS Group AG** 2,789 % fällig am 12.05.2026 | | 15.000 | | 15.000 |
| **U.S. Treasury Notes** 0,875 % fällig am 31.01.2024 | | 14.900 | | 14.707 |
| **ING Groep NV** 3,151 % fällig am 28.03.2026 | | 13.100 | | 13.100 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** 3,250 % fällig am 05.01.2023 | | 12.335 | | 12.391 |
| **Standard Chartered PLC** 3,253 % fällig am 30.03.2026 | | 12.000 | | 12.000 |
| **Societe Generale S.A.** 2,625 % fällig am 22.01.2025 | | 11.600 | | 11.490 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** 5,100 % fällig am 17.01.2024 | | 10.520 | | 10.793 |
| **HCA, Inc.** 5,000 % fällig am 15.03.2024 | | 10.235 | | 10.773 |
| **Deutsche Bank AG** 3,950 % fällig am 27.02.2023 | | 10.461 | | 10.630 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2022** | | | | |
| **U.S. Treasury Notes** 0,125 % fällig am 31.03.2023 | $ | 182.300 | $ | 180.142 |
| **U.S. Treasury Notes** 0,750 % fällig am 15.11.2024 | | 172.800 | | 164.548 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 13.069.057 | | 130.100 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Freddie Mac** 0,650 % fällig am 22.10.2025 | $ | 57.000 | | 55.310 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,250 % fällig am 31.03.2024 | | 52.800 | | 52.586 |
| **U.S. Treasury Notes** 1,500 % fällig am 29.02.2024 | | 50.500 | | 49.726 |
| **Freddie Mac** 0,800 % fällig am 27.10.2026 | | 50.000 | | 46.089 |
| **U.S. Treasury Notes** 1,000 % fällig am 15.12.2024 | | 43.100 | | 42.329 |
| **Federal Home Loan Bank** 0,850 % fällig am 17.02.2027 | | 33.500 | | 29.952 |
| **Federal Home Loan Bank** 0,750 % fällig am 24.02.2026 | | 28.000 | | 25.592 |
| **Fannie Mae** 0,700 % fällig am 30.07.2025 | | 22.000 | | 20.379 |
| **Fannie Mae** 0,875 % fällig am 18.12.2026 | | 21.000 | | 19.524 |
| **Federal Home Loan Bank** 1,020 % fällig am 24.02.2027 | | 18.000 | | 17.468 |
| **Federal Home Loan Bank** 1,100 % fällig am 15.11.2024 | | 16.700 | | 15.925 |
| **U.S. Treasury Notes** 0,875 % fällig am 31.01.2024 | | 14.900 | | 14.502 |
| **ReadyCap Commercial Mortgage Trust** 2,824 % fällig am 25.11.2036 | | 13.999 | | 13.891 |
| **Freddie Mac** 0,850 % fällig am 23.12.2026 | | 15.000 | | 13.472 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)** | | 129.800 | | 13.109 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Freddie Mac** 0,800 % fällig am 28.10.2026 | $ | 10.000 | | 9.034 |
| **Federal Home Loan Bank** 0,960 % fällig am 05.03.2026 | | 9.000 | | 8.795 |

(a) Der US Short-Term Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

## Glossar: (möglicherweise im vorstehenden Abschluss verwendete Abkürzungen) (Ungeprüft)

**Abkürzungen der Kontrahenten:**

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **AZD** | Australia and New Zealand Banking Group | **FBF** | Credit Suisse International | **MYI** | Morgan Stanley & Co. International PLC |
| **BOA** | Bank of America N.A. | **FICC** | Fixed Income Clearing Corporation | **NAB** | National Australia Bank Ltd. |
| **BOS** | BofA Securities, Inc. | **GLM** | Goldman Sachs Bank USA | **NOM** | Nomura Securities International Inc. |
| **BPG** | BNP Paribas Securities Corp. | **GRE** | NatWest Markets Securities Inc. | **NXN** | Natixis New York |
| **BPS** | BNP Paribas S.A. | **GSC** | Goldman Sachs & Co. LLC | **RBC** | Royal Bank of Canada |
| **BRC** | Barclays Bank PLC | **GST** | Goldman Sachs International | **RCY** | Royal Bank of Canada |
| **BSH** | Banco Santander S.A. - New York Branch | **HUS** | HSBC Bank USA N.A. | **RDR** | RBC Capital Markets LLC |
| **BSN** | The Bank of Nova Scotia - Toronto | **IND** | Crédit Agricole Corporate and Investment Bank S.A. | **RVM** | Barclays Capital, Inc. |
| **BSS** | Banco Santander S.A. | | | **RYL** | NatWest Markets Plc |
| **BYL** | Barclays Bank PLC London Branch | **JLN** | JP Morgan Chase Bank N.A. London | **SAL** | Citigroup Global Markets, Inc. |
| **CBK** | Citibank N.A. | **JML** | JP Morgan Securities Plc | **SCX** | Standard Chartered Bank, London |
| **CEW** | Canadian Imperial Bank of Commerce | **JPM** | JP Morgan Chase Bank N.A. | **SGY** | Societe Generale, NY |
| **CIB** | Canadian Imperial Bank of Commerce | **JPS** | J.P. Morgan Securities LLC | **SOG** | Societe Generale Paris |
| **CKL** | Citibank N.A. London | **MAC** | Macquarie Bank Limited | **SSB** | State Street Bank and Trust Co. |
| **COM** | Commerz Bank AG | **MBC** | HSBC Bank Plc | **STR** | State Street FICC Repo |
| **CSN** | Credit Suisse AG (New York) | **MEI** | Merrill Lynch International | **TDM** | TD Securities (USA) LLC |
| **DBL** | Deutsche Bank AG London | **MFK** | Barclays Capital, Inc. | **TOR** | The Toronto-Dominion Bank |
| **DUB** | Deutsche Bank AG | **MSC** | Morgan Stanley & Co. LLC. | **UAG** | UBS AG Stamford |
| **FAR** | Wells Fargo Bank National Association | **MYC** | Morgan Stanley Capital Services LLC | **UBS** | UBS Securities LLC |

**Währungskürzel:**

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **AED** | Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate | **HKD** | Hongkong-Dollar | **PLN** | Polnischer Zloty |
| | | **HUF** | Ungarischer Forint | **RON** | Rumänischer neuer Leu |
| **ARS** | Argentinischer Peso | **IDR** | Indonesische Rupie | **RSD** | Serbischer Dinar |
| **AUD** | Australischer Dollar | **ILS** | Israelischer Shekel | **RUB** | Russischer Rubel |
| **BRL** | Brasilianischer Real | **INR** | Indische Rupie | **SEK** | Schwedische Krone |
| **CAD** | Kanadischer Dollar | **JPY (oder ¥)** | Japanischer Yen | **SGD** | Singapur-Dollar |
| **CHF** | Schweizer Franken | **KES** | Kenia-Schilling | **THB** | Thailändischer Baht |
| **CLP** | Chilenischer Peso | **KRW** | Südkoreanischer Won | **TRY** | Türkische neue Lira |
| **CNH** | Chinese Renminbi (Offshore) | **KZT** | Kasachischer Tenge | **TWD** | Taiwanesischer Dollar |
| **CNY** | Chinese Renminbi (Mainland) | **MXN** | Mexikanischer Peso | **UAH** | Ukrainische Hrywnja |
| **COP** | Kolumbianischer Peso | **MYR** | Malaysischer Ringgit | **UGX** | Uganda-Schilling |
| **CZK** | Tschechische Krone | **NGN** | Nigerianische Naira | **USD (oder $)** | US-Dollar |
| **DKK** | Dänische Krone | **NOK** | Norwegische Krone | **UYU** | Uruguayischer Peso |
| **DOP** | Dominikanischer Peso | **NZD** | Neuseeländischer Dollar | **VND** | Vietnamesischer Dong |
| **EGP** | Ägyptisches Pfund | **PEN** | Peruanischer neuer Sol | **ZAR** | Südafrikanischer Rand |
| **EUR (oder €)** | Euro | **PHP** | Philippinischer Peso | **ZMW** | Sambischer Kwacha |
| **GBP (oder £)** | Britisches Pfund | **PKR** | Pakistanische Rupie | | |
| **GHS** | Ghanaischer Cedi | | | | |

**Börsenkürzel:**

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **BIST** | Borsa Instanbul Exchange | **CME** | Chicago Mercantile Exchange | **OTC** | Over the Counter |
| **CBOE** | Chicago Board Options Exchange | **FTSE** | Financial Times Stock Exchange | | |

**Index-/Spread-Kürzel:**

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **ABX.HE** | Asset-Backed Securities Index - Home Equity | **CPURNSA** | Consumer Price All Urban Non-Seasonally Adjusted Index | **PrimeX.ARM** | Prime Mortgage-Backed Securities Index - Adjustable Rate Mortgage |
| **ACS** | Algonquin Cityfates Natural Gas Basis Futures Index | **DAX** | Deutscher Aktien Index 30 | **S&P 500** | Standard & Poor's 500 Index |
| **BCOMF1TC** | Bloomberg Commodity Index 1-Month Forward Total Return | **DWRTFT** | Dow Jones Wilshire REIT Total Return Index | **S&P CNX Nifty** | Standard & Poor's Nifty 50 Index |
| | | **EUR-ESTRON** | Euro Short-Term Rate | **SET50** | Stock Exchange of Thailand Index |
| **BCOMTR** | Bloomberg Commodity Index Total Return | **FRCPXTOB** | Französischer Verbraucherpreisindex ohne Tabak | **SIBCSORA** | Singapore Overnight Rate Average |
| | | **FTSE/JSE** | South African Performance Index | **SOFR** | Secured Overnight Financing Rate |
| **BCOMTR2** | Bloomberg Custom Commodity Index | **FTSE/MIB** | Index der 40 italienischen Aktien mit der höchsten Liquidität/Marktkapitalisierung der Borsa Italiana | **SONIO** | Sterling Overnight Interbank Average Rate |
| **BOVESPA** | Brazil Bovespa Index | | | **SPI 200** | Australian Equity Futures Index |
| **CAC** | Cotation Assistée en Continu | | | **SRFXON3** | Swiss Overnight Rate Average (6PM) |
| **CDX.EM** | Credit Derivatives Index — Emerging Markets | **IBEX 35** | Spanish Continuous Exchange Index | **SX4T** | STOXX Chemicals Index |
| **CDX.HY** | Credit Derivatives Index - High Yield | **IBR** | Indicador Bancario de Referencia | **THB-THORON** | Thai Overnight Repurchase Rate |
| | | | | **TOPIX** | Tokyo Price Index |
| **CDX.IG** | Credit Derivatives Index – Investment Grade | **JMABDEWU/ JPPMGSHP** | J.P. Morgan Custom Commodity Index | **TRNGLU** | FTSE EPRA/NAREIT Developed Index Net TRI USD |
| **CIXBSTR3** | Individuell zusammengestellter Rohstoffindex | **KOSPI** | Korea Composite Stock Price Index | **UKRPI** | United Kingdom Retail Prices Index |
| | | **MUTKCALM** | Tokyo Overnight Average Rate | **VSTOXX** | Euro Stoxx 50 Volatility Index |
| **CMBX** | Commercial Mortgage-Backed Index | **NASDAQ** | National Asscociation of Securities Dealers Automated Quotations | **WIG20** | Kapitalisierungsgewichteter Börsenindex der 20 größten Unternehmen an der Warsaw Stock Exchange |
| **CNREPOFIX** | China Fixing Repo Rates 7-Day | | | | |
| **CPALEMU** | Euro Area All Items Non-Seasonally Adjusted Index | **NDUEACWF** | MSCI ACWI Index Future | | |
| | | **NDUEEGF** | iShares MSCI Emerging Markets ETF | | |
| **CPTFEMU** | Eurozone HICP ex-Tobacco Index | **OMX** | Stockholm 30 Index | | |

**Kommunalanleihen- oder Behördenkürzel:**

| | |
|---|---|
| **AGM** | Assured Guaranty Municipal |

**Sonstige Kürzel:**

| | |
|---|---|
| **ABS** | Asset-Backed Security (forderungsbesichertes Wertpapier) |
| **ALT** | Alternate Loan Trust |
| **BABs** | Build America Bonds |
| **BBR** | Bank Bill Rate |
| **BBSW** | Bank Bill Swap Reference Rate |
| **BTP** | Buoni del Tesoro Poliennali "Long-term Treasury Bond" |
| **CBO** | Collateralized Bond Obligation |
| **CDI** | Brazil Interbank Deposit Rate |
| **CDO** | Collateralised Debt Obligation (besicherte Schuldverschreibungen) |
| **CHILIBOR** | Chile Interbank Offered Rate |
| **CLO** | Collateralised Loan Obligation (durch Kreditportfolio besicherte Wertpapiere) |
| **CMBS** | Collateralised Mortgage-Backed Security |
| **DAC** | Designated Activity Company |
| **ESTRON** | Euro Short-Term Rate |
| **EURIBOR** | Euro Interbank Offered Rate |
| **HIBOR** | Hong Kong Interbank Offered Rate |
| **JIBAR** | Johannesburg Interbank Agreed Rate |
| **JSC** | Joint Stock Company |
| **KLIBOR** | Kuala Lumpur Interbank Offered Rate |
| **KORIBOR** | Korea Interbank Offered Rate |
| **LIBOR** | London Interbank Offered Rate |
| **MIBOR** | Mumbai Interbank Offered Rate |
| **MSCI** | Morgan Stanley Capital International |
| **NIBOR** | Norwegian Interbank Offered Rate |
| **OAT** | Obligations Assimilables du Trésor |
| **OIS** | Overnight Index Swap |
| **PIK** | Payment-in-Kind (Sachausschüttung) |
| **PRIBOR** | Prague Interbank Offered Rate |
| **REITs** | Real Estate Investment Trust |
| **REMIC** | Real Estate Mortgage Investment Conduit |
| **RMBS** | Residential Mortgage-Backed Security |
| **STIBOR** | Stockholm Interbank Offered Rate |
| **TBA** | To-Be-Announced |
| **TBD** | To-Be-Determined |
| **TBD%** | Bei Abrechnung des Darlehens oder zum Zeitpunkt der Finanzierung zu ermittelnder Zinssatz |
| **TELBOR** | Tel Aviv Inter-Bank Offered Rate |
| **THBFIX** | Thai Baht Floating-Rate Fix |
| **THORON** | Thai Overnight Repurchase Rate |
| **TIIE** | Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio „Gleichgewichtszinssatz im Interbankengeschäft" |
| **WIBOR** | Warsaw Interbank Offered Rate |

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

**ANLAGEBERATUNGSGESELLSCHAFT**
Pacific Investment Management Company LLC,
650 Newport Center Drive,
Newport Beach, California 92660,
USA.

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

PIMCO Asia Pte Ltd.,
8 Marina View, #30-01,
Asia Square Tower 1,
Singapur 018960.

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

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

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

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

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

PIMCO Asia Pte Ltd.,
8 Marina View, #30-01,
Asia Square Tower 1,
Singapur 018960.

PIMCO Asia Limited,
22nd Floor, Suite 2201,
Two International Finance Centre,
8 Finance Street, Central,
Hongkong.

PIMCO Australia Pty Ltd.,
Level 19, 5 Martin Place,
363 George Street,
Sydney, New South Wales 2000,
Australien.

**ÖSTERREICHISCHE ZAHLSTELLE**
UniCredit Bank Austria,
Attn: GSS/8398,
Rothschildplatz 1,
1020 Wien,
Österreich.

**REPRÄSENTANT IN SINGAPUR**
PIMCO Asia Pte Ltd.,
8 Marina View, #30-01,
Asia Square Tower 1,
Singapur 018960.

**ITALIENISCHE KORRESPONDENZBANKEN**
Allianz Bank Financial Advisors S.p.A.,
Piazza Velasca, 7/9,
20122 Mailand,
Italien.

State Street Bank International GmbH – Succursale Italia,
Via Ferrante Aporti, 10,
Mailand,
Italien.

Société Générale Securities Services S.p.A. („SGSS"),
Via Santa Chiara, 19,
Turin,
Italien.

AllFunds Bank S.A.U.,
Succursale di Milano,
Via Bocchetto, 6,
20123 Mailand,
Italien.

Banca Sella Holding S.p.A.,
Piazza Gaudenzio Sella, 1,
13900 Biella,
Italien.

Monte dei Paschi di Siena S.p.A.,
Via Verii, 14,
Mantova,
Italien.

RBC Investor Services Bank S.A., Milan Branch,
Via Vittor Pisani, 26,
20124 Mailand,
Italien.

CACEIS Bank, Italy Branch,
Piazza Cavour 2,
20121 Mailand,
Italien.

**REPRÄSENTANT IN HONGKONG**
PIMCO Asia Limited,
22nd Floor, Suite 2201,
Two International Finance Centre,
8 Finance Street,
Hongkong.

**LUXEMBURGER ZAHLSTELLE UND VERTRETUNGSSTELLE**
Société Générale Luxembourg,
(Centre opérationel / FED),
28-32, Place de la Gare,
L-1616, 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**
ABN AMRO Private Banking S.A.,
Borsbeeksebrug 30,
2600 Antwerpen,
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,
29, Boulevard Haussmann,
75009 Paris,
Frankreich.

**ZAHLSTELLE IN LIECHTENSTEIN**
LGT Bank Ltd.,
Herrengasse 12,
FL-9490 Vaduz,
Liechtenstein.

**RECHTSBERATER FÜR IRISCHES RECHT**
Dillon Eustace LLP,
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 LLP,
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 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum kann von den Anteilinhabern kostenlos bei der Verwahrstelle oder den Zahlstellen sowie bei der Zahl- und Informationsstelle in Deutschland und der Vertretungsstelle in der Schweiz bezogen werden.

[1] Mitarbeiter von PIMCO.

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

**PIMCO Europe GmbH (Registernummer 192083, Seidlstr. 24-24a, 80335 München, Deutschland), PIMCO Europe GmbH, italienische Niederlassung (Registernummer 10005170963), PIMCO Europe GmbH, irische Niederlassung (Registernummer 909462), PIMCO Europe GmbH, britische Niederlassung (Registernummer 2604517) und PIMCO Europe GmbH, spanische Niederlassung (Registernummer W2765338E)** sind von der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) (Marie- Curie-Str. 24-28, 60439 Frankfurt am Main) in Deutschland zugelassen und werden von dieser gemäß § 15 des Gesetzes zur Beaufsichtigung von Wertpapierinstituten (WpIG) reguliert. Die italienische, irische, britische und spanische Niederlassung werden zusätzlich von folgenden Behörden beaufsichtigt: (1) Italienische Niederlassung: die Commissione Nazionale per le Società e la Borsa (CONSOB) gemäß Artikel 27 des Testo unico delle disposizioni in materia di intermediazione finanziaria (Einheitsgesetz über die Finanzvermittlung); (2) Irische Niederlassung: die Zentralbank von Irland gemäß Regulation 43 der European Union (Markets in Financial Instruments) Regulations 2017 in der jeweils gültigen Fassung; (3) Britische Niederlassung: die Financial Conduct Authority; und (4) Spanische Niederlassung: die Comisión Nacional del Mercado de Valores (CNMV) gemäß den Verpflichtungen in Artikel 168 und 203 bis 224 sowie den Verpflichtungen in Titel V, Artikel I des Ley del Mercado de Valores (Gesetz über den Wertpapiermarkt) und in Artikel 111, 114 und 117 des Real Decreto 217/2008. Die von PIMCO Europe GmbH erbrachten Dienstleistungen stehen nur professionellen Kunden im Sinne von § 67 Abs. 2 WpHG (Wertpapierhandelsgesetz) zur Verfügung. Sie sind nicht für Privatanleger verfügbar, die sich nicht auf diese Unterlagen verlassen sollten.

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