

Allspring (Lux) Worldwide Fund

- 2 Degree Global Equity Fund
- Alternative Risk Premia Fund
- China A Focus Fund
- Climate Focused Emerging Markets Equity Fund
- Climate Focused Global Equity Fund
- Climate Focused U.S. Equity Fund
- Climate Transition Global Investment Grade Credit Fund
- Emerging Markets Equity Fund
- Emerging Markets Equity Income Fund
- EUR Investment Grade Credit Fund
- EUR Short Duration Credit Fund
- Global Equity Enhanced Income Fund
- Global Factor Enhanced Equity Fund
- Global Long/ Short Equity Fund
- Global Small Cap Equity Fund
- Small Cap Innovation Fund
- U.S. All Cap Growth Fund
- U.S. Large Cap Growth Fund
- U.S. Select Equity Fund
- U.S. Short-Term High Yield Bond Fund
- USD Investment Grade Credit Fund

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Allspring (Lux) Worldwide Fund wurde als Société d'Investissement à Capital Variable mit beschränkter Haftung im Großherzogtum Luxemburg gegründet und unter der Nummer B 137.479 im Luxemburger Handels- und Gesellschaftsregister eingetragen.

Eingetragener Geschäftssitz von Allspring (Lux) Worldwide Fund: 80, route d'Esch, L-1470 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg.

Inhalt

Bericht des Verwaltungsrats an die Anteilinhaber	1
Anlagenspiegel	
2 Degree Global Equity Fund	5
Alternative Risk Premia Fund.....	9
China A Focus Fund	11
Climate Focused Emerging Markets Equity Fund.....	13
Climate Focused Global Equity Fund	20
Climate Focused U.S. Equity Fund.....	25
Climate Transition Global Investment Grade Credit Fund	29
Emerging Markets Equity Fund.....	37
Emerging Markets Equity Income Fund	41
EUR Investment Grade Credit Fund	46
EUR Short Duration Credit Fund.....	53
Global Equity Enhanced Income Fund	59
Global Factor Enhanced Equity Fund	63
Global Long/ Short Equity Fund	76
Global Small Cap Equity Fund	81
Small Cap Innovation Fund.....	85
U.S. All Cap Growth Fund.....	88
U.S. Large Cap Growth Fund.....	91
U.S. Select Equity Fund	93
U.S. Short-Term High Yield Bond Fund.....	95
USD Investment Grade Credit Fund	98
Vermögensbilanz	102
Aufwands- und Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens ...	111
Daten	116
Erläuterungen zum Halbjahresbericht	125
Verwaltungsrat, Verwaltung und Management	164
Bericht des Réviseur D'Entreprises Agréé	166
Allgemeine Informationen (ungeprüft)	169
Anhang I (ungeprüft):Gesamtkostenquoten	171
Anhang II (ungeprüft): Wertentwicklung	175
Anhang III (ungeprüft): Risikomanagement	180
Anhang IV (ungeprüft): Wertpapierfinanzierungsgeschäfte	182
Anhang V (ungeprüft): Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor	184

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Zeichnungen sind nur gültig, wenn sie auf der Grundlage des aktuellen Prospekts und des Basisinformationsblatts, zusammen mit dem letzten Jahresbericht, einschließlich des geprüften Abschlusses oder des letzten ungeprüften Halbjahresberichts, falls dieser aktueller ist, getätigt werden.

[DIESE SEITE WURDE ABSICHTLICH FREIGELASSEN]

Sehr geehrte Anteilinhaberin, sehr geehrter Anteilinhaber,

wir freuen uns, Ihnen hiermit diesen Jahresbericht von Allspring (Lux) Worldwide Fund für den am 31. März 2023 zu Ende gegangenen 12-monatigen Berichtszeitraum vorlegen zu dürfen. Weltweit verzeichneten Aktien und Anleihen während des schwierigen Berichtszeitraums erhöhte Volatilität und schwache Performance. Vorheriger Rückenwind durch globale Konjunkturprogramme, Impfprogramme und eine Erholung der Verbraucher- und Unternehmensstimmung wurde von der höchsten Inflationsrate seit vier Jahrzehnten, den Auswirkungen der anhaltend aggressiven Zinsanhebungen durch die Zentralbanken und der Aussicht auf ein noch höheres Zinsniveau zunichte gemacht. Verstärkt wurden diese Sorgen durch die globalen Auswirkungen des Krieges zwischen Russland und der Ukraine und die strikten COVID-19-Lockdowns in China, die im Dezember beendet wurden.

Über den 12-Monats-Zeitraum mussten globale Aktien und Anleihen auf breiter Front Verluste hinnehmen. Die steigende Inflation belastete die Renditen festverzinslicher Wertpapiere, woraus weitere Problemen entstanden. Während des Berichtszeitraums erzielten Nicht-US-Aktien aus Industrieländern laut dem MSCI ACWI ex USA Index (Net)¹ eine Rendite von -5,07 %, der MSCI Emerging Markets Index (Net)² entwickelte sich mit einem Verlust von 10,70 % noch schwächer. Die US-Aktien im S&P 500 Index³ erzielten -7,73 %. Bei den Anleihenindizes erzielte der Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index⁴ eine Rendite von -10,72 %, während der Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index⁵ mit -4,78 % rentierte.

Die hohe Inflation und Zinserhöhungen durch die Zentralbanken sorgten für Turbulenzen auf den Märkten.

Im April 2022 hielt der durch die Invasion Russlands der Ukraine im Februar 2022 verursachte Gegenwind auf den Märkten an und führte auf breiter Ebene zu erheblichen Verlusten. Sowohl der S&P 500 Index als auch der MSCI All Country World Index⁶ büßten im Monatsverlauf 8 % oder mehr ein, zudem erhöhten Rohstoffengpässe die globale Inflation. Die chinesische Wirtschaft litt unter einem strikten Lockdown, mit dem die Regierung versuchte, einen größeren Ausbruch von COVID-19 einzudämmen. Der daraus resultierende globale Dominoeffekt verstärkte die bestehenden Lieferengpässe. Unterdessen stieg die jährliche US-Inflation mit 8,5 % auf den höchsten Stand seit 1981, und die Anleger stellten sich auf aggressive geldpolitische Strafungsmaßnahmen der US-Notenbank (Fed) ein.

Die Marktvolatilität hielt im Mai an, wobei sich die Aktien gegen Monatsende wieder erholten. Substanzwerte übertrafen Wachstumswerte. Die seit Monaten vorherrschende Besorgnis des Marktes hielt aufgrund hoher Inflation und geopolitischer Spannungen sowie hoher Rohöl-, Kraftstoff- und Lebensmittelpreise an. Als Reaktion darauf hob die Fed den Leitzins um 0,50 % an. Unterdessen breiteten sich die hochansteckenden COVID-19-Varianten weiter aus. Die Arbeitsmärkte in den USA, Großbritannien und Europa blieben jedoch stabil. Die Einzelhandelsumsätze in den USA stiegen im April zum vierten Mal in Folge – ein Zeichen für Verbraucherresilienz.

Im Juni verzeichneten Aktien weitere Verluste und waren auf dem Weg zu schlechtesten ersten Aktienhalbjahr seit 50 Jahren. Und auch die Anleihen entwickelten sich kaum besser. Verlusttreiber waren die bekannten Faktoren weltweit steigende Inflation und Rezessionsangst, und die Zentralbanken bemühten sich mit Zinserhöhungen um die Eindämmung der sprunghaft ansteigenden Inflation. Die Fed hob ihren kurzfristigen Zinssatz im Juni um weitere 0,75 % an. Derweil blieb die US-Arbeitslosenquote stabil bei 3,6 %, und der Immobilienmarkt war nur geringfügig von deutlich höheren Hypothekenzinsen betroffen.

Die Märkte erholten sich im Juli, angeführt von US-Aktien. Während sich die US-Wirtschaftsaktivität abschwächte, blieb der Arbeitsmarkt des Landes überraschend stark: Im Juli stiegen die Beschäftigtenzahlen außerhalb der Landwirtschaft um mehr als 500.000, und die Arbeitslosigkeit in den USA ging auf 3,5 % zurück. Gleichzeitig sanken die Rohölpreise und die Verbraucherpreise für Kraftstoffe, die wesentlich zur hohen Gesamtinflation beigetragen hatten, deutlich gegenüber den vorherigen Höchstständen. Die US-Eigenheimpreise stiegen und die Verkaufsumsätze sanken, da Häuser weniger erschwinglich wurden und die Hypothekenzinsen auf ein 13-Jahres-Hoch stiegen. Die Fed hob den Leitzins im Juli um weitere 0,75 % auf eine Spanne von 2,25 % bis 2,50 % an und deutete weitere Zinserhöhungen an.

Der August war ein weiterer allgemein schwieriger Monat für die Finanzmärkte und brachte weitere Verluste. Die hohe Inflation hielt an, erreichte in der Eurozone auf das Gesamtjahr bezogen 9 % und blieb in den USA trotz der aggressiven Geldpolitik der Fed und eines starken Rückgangs der globalen Rohöl- und Benzinpreise gegenüber ihrem Höchststand im Juni bei über 8 %. Ein positiver Faktor war der robuste US-Arbeitsmarkt. Dennoch war klar, dass für die Fed noch viel zu tun bleibt. Ein Hoffnungsschimmer für die längerfristige Zukunft war die Verabschiedung des Inflation Reduction Act durch den US-Kongress. Zu den wichtigsten erklärten Zielen des Gesetzes gehören die (längerfristige) Senkung der Inflation durch die Begrenzung des Defizits, die Begrenzung der finanziellen Belastung von Senioren durch Gesundheitsausgaben und die Investition in inländische Quellen sauberer Energie.

Im September setzte sich die Abwärtstendenz des Marktes fort, da alle Anlageklassen deutliche Verluste erlitten. Die Zentralbanken reagierten mit weiteren Zinserhöhungen auf die schnell steigenden Preise. Die Stärke des US-Dollar belastete die Erträge von Anlegern, die nicht auf US-Dollar lautende Vermögenswerte hielten. Die US-Hypothekenzinsen schnellten bei 30-jährigen festverzinslichen Hypotheken auf fast 7 %, und die Verteuerung von Wohnimmobilien drückte die Nachfrage, allerdings in begrenztem Ausmaß. Großbritannien erlebte im September eine Flucht aus Staatsanleihen und dem britischen Pfund, als die Anleger aufgrund des als finanziell unsolid angesehenen neuen Staatshaushalts nervös wurden. Die Bank of England (BoE) sprang daraufhin in die Bresche und kaufte Staatsanleihen mit langer Laufzeit.

Aktien erlebten im Oktober eine Erholung. Substanzwerte und Small Caps schnitten dabei am besten ab. Weltweit übertrafen die Industrieländer die Schwellenmarktaktien, die unter der Schwäche chinesischer Werte litten. Die Zentralbanken versuchten weiterhin, die hohe Inflation durch aggressive Zinserhöhungen in den Griff zu bekommen. Geopolitische Risiken wie der Krieg zwischen Russland und der Ukraine sowie wirtschaftliche, finanzielle und politische Turbulenzen in Großbritannien hielten an. Die Furcht vor einer europäischen Energiekrise ließ aufgrund des für die Jahreszeit ungewöhnlich warmen Wetters und der unproblematischen Gasversorgung nach. Der US-Arbeitsmarkt zeigte sich weiter unbeeindruckt von den steigenden Preisen und die Arbeitslosigkeit blieb nahe einem Rekordtief.

Aktien und Anleihen erholten sich im November. Aus der Wirtschaft kamen positive Signale, was hauptsächlich auf die Robustheit des US-Arbeitsmarktes zurückzuführen war. Die Zentralbanken hoben zwar die Zinsen weiter an, es gab jedoch Hoffnung auf ein zukünftig geringeres Tempo der Zinserhöhungen und ein mögliches Ende der geldpolitischen Straffung noch im Jahr 2023. Obwohl die Preissteigerung in der Eurozone auf Rekordniveau blieb, wurden Anzeichen für einen möglichen Rückgang des Inflationsdrucks erkennbar, als sich die US-Inflation im November auf 7,1 % im Jahresvergleich und nur 0,1 % gegenüber dem Vormonat abschwächte. Chinas Wirtschaftsdaten blieben aufgrund der Null-COVID-Politik des Landes schwach.

Die Finanzmärkte kühlten sich im Dezember ab, wobei US-Aktien als Reaktion auf den schwächer werdenden US-Dollar insgesamt negative Ergebnisse verzeichneten. Festverzinsliche Wertpapiere beendeten eines ihrer historisch schlechtesten Jahre mit gleichbleibenden monatlichen Gesamterträgen, da die Märkte einerseits auf ein Ende des geldpolitischen Straffungszyklus hofften, sich andererseits aber auch im Klaren waren, dass die Zentralbanken ihre Ziele noch nicht erreicht hatten und weitere geldpolitische Schritte zu erwarten sind. Die Daten des U.S. Verbraucherpreisindex (VPI)⁷ zeigten einen starken, konstanten Abwärtstrend, der den 12-Monats-VPI von 9,1 % im Juni auf 6,5 % im Dezember sinken ließ. Andere Länder und Regionen meldeten gegen Jahresende nach wie vor hohe, immerhin aber rückläufige Inflationsraten.

Das Jahr 2023 begann mit einer Rally bei globalen Aktien und festverzinslichen Wertpapieren. Der Optimismus der Anleger stieg als Reaktion auf Meldungen zu sinkenden Inflationsraten und der Wiedereröffnung der chinesischen Wirtschaft nach dem abrupten Ende der Null-COVID-Politik. Die USA meldeten überraschend starke Arbeitsmarktzahlen, da mehr als 500.000 neue Arbeitsplätze geschaffen wurden und die Arbeitslosigkeit auf 3,4 % und damit den niedrigsten Stand seit 1969 fiel. Gleichzeitig fielen die Lohnsteigerungen als potenzieller Faktor für die anhaltend hohe Inflation weiterhin moderat aus. Im Blickpunkt standen weiterhin die Fed und die Frage, wie viele weitere Zinserhöhungen in diesem Straffungszyklus noch folgen. Die im Januar angekündigte Zinserhöhung der Fed um 0,25 % war die geringste seit März 2022.

Die Finanzmärkte gaben im Februar nach, da die Anleger negativ auf robuste Wirtschaftsdaten reagierten. Es zeigte sich, dass die Zentralbanken ihren geldpolitischen Straffungszyklus voraussichtlich länger fortsetzen werden, als die Märkte eingepreist hatten. In diesem Umfeld, in dem starke Wirtschaftsdaten schlechte Nachrichten bedeuten, wurde der robuste US-Arbeitsmarkt negativ bewertet, während die Inflationsrate für die Fed nicht schnell genug fiel und diese deshalb Anfang Februar die Zinsen um 0,25 % anhob. Unterdessen erhöhten die BoE und die Europäische Zentralbank die Zinsen jeweils um 0,50 %.

Der Zusammenbruch der Silicon Valley Bank im März war der zweitgrößte Bankenkollaps in der Geschichte der USA und führte zu einem klassischen Bank Run mit Auswirkungen bis nach Europa, wo die Schweizer Bank Credit Suisse von ihrem Konkurrenten UBS übernommen wurde. Die plötzliche Unsicherheit im Bankensektor veranlasste einen Teil der Kunden regionaler Banken dazu, ihre Einlagen zu einigen wenigen US-Großbanken zu transferieren, während gleichzeitig Bankaktien abgestoßen wurden. Die Turbulenzen im Bankensektor könnten die Aufgabe der Zentralbanken erschweren, da sie Inflations Sorgen gegen einen möglichen Konjunkturrückgang abwägen müssen. Derweil wiesen jüngste Daten auf eine gute Wirtschaftslage in den USA, Europa und China hin. Der US-Arbeitsmarkt zeigte sich weiterhin robust. Der zusammengesetzte Einkaufsmanagerindex für die Eurozone⁸ stieg im März auf 53,70 und zeigte damit Wachstum an. Die chinesische Wirtschaft erholte sich nach Ende der COVID-19-Lockdowns weiter. In den USA, im Vereinigten Königreich und in Europa blieben die Inflationsraten über dem Ziel der Zentralbanken, die im März mit weiteren Zinserhöhungen reagierten.

Aktivitäten während des Geschäftsjahres

Spezifische Teilfondsaktivitäten während des Geschäftsjahres werden in Erläuterung 1 der Erläuterungen zum Abschluss in diesem Bericht beschrieben.

Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor

Gemäß der Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (EU-Verordnung 2019/2088 / „SFDR“) enthält Anhang V (ungeprüft) dieses Berichts: „Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor“ detaillierte Informationen über die Teilfonds gemäß Artikel 6 und Artikel 8 der SFDR und zum Erreichen von deren Anlagezielen in Verbindung mit der Bewerbung ökologischer und/ oder sozialer Merkmale.

Erklärung zur Unternehmensführung

Der Verwaltungsrat orientiert sich am Verhaltenskodex der Association of the Luxembourg Fund Industry („ALFI“) für luxemburgische Investmentfonds und ist der Auffassung, dass der Fonds in allen wesentlichen Belangen mit dessen Grundsätzen konform ist. Dieser Verhaltenskodex bietet einen Rahmen mit strengen Prinzipien und Empfehlungen für beste Vorgehensweisen bezogen auf die Governance von Luxemburger Investmentfonds.

Verwaltungsrat

Verwaltungsratsmitglieder

Andrew Owen

Verwaltungsratsvorsitzende
525 Market Street,
12th Floor
San Francisco, CA 94105
Vereinigte Staaten

Head of Global Fund Governance
Allspring Global Investments

Seit 12. Januar 2022

Richard Goddard

21st Century Building 19, rue de Bitbourg
L-1273 Luxemburg-Hamm
Luxemburg

The Directors' Office S.A.

Seit 20. März 2008

Mattheus Wijnand (Martijn) de Vree

Bow Bell House, Sixth Floor
1 Bread Street
London EC4M 98E
Vereinigtes Königreich

Head of Fixed Income Solutions,
Global Fixed Income
Allspring Global Investments

Seit 11. Dezember 2018

Jürgen Meisch

Kölner Weg 15
D-50858 Köln
Deutschland

Achalm Capital GmbH

Seit 10. März 2015

Yves Wagner

21st Century Building 19, rue de Bitbourg
L-1273 Luxemburg-Hamm
Luxemburg

The Directors' Office S.A.

Seit 10. Juni 2015

Funktion der Verwaltungsratsmitglieder

Die Verwaltungsratsmitglieder sind für die gesamte Leitung und Kontrolle des Fonds verantwortlich. Die Verwaltungsratsmitglieder erhalten regelmäßig Berichte von der Verwaltungsgesellschaft, vom Anlageverwalter und/oder den Unter-Anlageverwaltern, in denen die Wertentwicklung des Fonds und eine Analyse seines Anlageportfolios dargelegt sind. Die Verwaltungsgesellschaft, der Anlageverwalter und/oder die Unter-Anlageverwalter stellen alle anderen Informationen zur Verfügung, die bisweilen von den Verwaltungsratsmitgliedern angemessenerweise verlangt werden können.

Unser Ziel ist es, den Finanzbedürfnissen unserer Anteilinhaber gerecht zu werden.

Wir bieten unseren Anteilhabern langfristige Anlagestrategien, mit denen wir uns auf angemessene Risiken konzentrieren und zugleich versuchen, beständige Renditen zu erzielen. Wir wissen, dass Ihre Fähigkeit, Ihre langfristigen Anlageziele zu verwirklichen, von den Anlageentscheidungen abhängen, die Sie heute treffen. Trotz der wirtschaftlichen Unwägbarkeiten und Herausforderungen an den Anlagemärkten werden Ihnen fortdauernde Investments und die Anpassung an neue Anlagechancen und Bedrohungen dabei helfen, etwaige Anlagerisiken erfolgreich zu meistern.

Wir möchten uns bedanken, dass Sie sich für den Allspring (Lux) Worldwide Fund entschieden haben, Ihr Vertrauen wissen wir zu schätzen und wir werden Ihnen auch künftig helfen, Ihre Anlageziele zu erreichen.

Mit freundlichen Grüßen

Andrew Owen
Vorsitzende des Verwaltungsrats des Fonds
Head of Global Fund Governance
Allspring Global Investments
21.06.2023

- ¹ Der Morgan Stanley Capital International (MSCI) All Country World Index (ACWI) ex USA Index (Net) ist ein um den Streubesitz angepasster, nach Marktkapitalisierung gewichteter Index, der die Aktienmarktentwicklung in Industrieländern ohne USA misst. Quelle: MSCI. MSCI gibt keine direkten oder indirekten Gewährleistungen oder Zusicherungen ab und übernimmt für hierin enthaltene MSCI-Daten keinerlei Haftung. Die Daten von MSCI dürfen nicht weitergegeben oder als Grundlage für andere Indizes oder Wertpapiere oder Finanzprodukte verwendet werden. Dieser Bericht wurde von MSCI weder genehmigt noch geprüft oder erstellt. In einen Index kann nicht direkt investiert werden.
- ² Der MSCI Emerging Markets (EM) Index (Net) ist ein um den Streubesitz angepasster, nach Marktkapitalisierung gewichteter Index, der die Aktienmarktentwicklung von Schwellenländern misst. In einen Index kann nicht direkt investiert werden.
- ³ Der S&P 500 Index besteht aus 500 Titeln, die nach Marktgröße, Liquidität und ihrem für die Branche repräsentativen Charakter ausgewählt werden. Es handelt sich um einen marktwertgewichteten Index, d. h., die Gewichtung jedes Titels im Index entspricht seinem Marktwert. In einen Index kann nicht direkt investiert werden.
- ⁴ Der Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index ist ein nicht verwalteter Index, der die globalen Märkte für festverzinsliche Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating ohne auf US-Dollar lautende Schuldtitel breit abbildet. In einen Index kann nicht direkt investiert werden.
- ⁵ Der Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index ist ein breitgefächerter Vergleichsindex, der den Markt für auf US-Dollar lautende, festverzinsliche, steuerpflichtige Investment-Grade-Anleihen misst, darunter Treasuries, regierungsnah und Unternehmenstitel, hypothekenbesicherte Wertpapiere (festverzinsliche Agency-Anleihen und hybride, variabel verzinsliche Hypotheken-Pass-Through-Papiere), forderungsbesicherte Wertpapiere und Commercial Mortgage-Backed Securities. In einen Index kann nicht direkt investiert werden.
- ⁶ Der MSCI ACWI ist ein um den Streubesitz angepasster, nach Marktkapitalisierung gewichteter Index, der die Aktienmarktentwicklung von Industrieländern misst. In einen Index kann nicht direkt investiert werden.
- ⁷ Der US-Verbraucherpreisindex (Consumer Price Index, CPI) misst die durchschnittliche Veränderung der Preise, die Verbraucher im urbanen Raum für einen Korb von Konsumgütern und Dienstleistungen zahlen. In einen Index kann nicht direkt investiert werden.
- ⁸ Der Einkaufsmanagerindex (Purchasing Managers' Index / PMI) ist ein Index für die wirtschaftliche Entwicklung im Fertigungs- und Dienstleistungssektor. In einen Index kann nicht direkt investiert werden.

2 DEGREE GLOBAL EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Marktwert USD	% des Nettovermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien				
Australien				
Metcash Limited	Lebensmittel	299.697	774.792	0,80
Österreich				
ANDRITZ AG	Maschinen – Diversifiziert	27.729	1.876.260	1,95
Brasilien				
BB Seguridade Participacoes SA	Versicherung	265.057	1.700.126	1,76
Kanada				
Open Text Corporation	Software	36.299	1.400.123	1,45
China				
37 Interactive Entertainment Network Technology Group Company Limited	Software	341.949	1.414.755	1,47
JD.com Incorporated	Internet	37.850	826.500	0,86
Yadea Group Holdings Limited	Automobilhersteller	220.000	566.703	0,59
			2.807.958	2,92
Frankreich				
AXA SA	Versicherung	29.580	902.710	0,94
Capgemini SE	Computer	4.960	921.744	0,96
Engie SA	Strom	31.348	496.073	0,52
Ipsen SA	Pharmazie	9.023	993.541	1,03
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	Bekleidung	2.113	1.939.541	2,01
Publicis Groupe SA	Werbung	22.228	1.735.113	1,80
			6.988.722	7,26
Deutschland				
Siemens AG	Sonstige Hersteller	11.353	1.839.230	1,91
Japan				
Daito Trust Construction Company Limited	Immobilien	13.500	1.345.003	1,40
Japan Post Insurance Company Limited	Versicherung	24.100	375.619	0,39
NEC Corporation	Computer	15.500	598.381	0,62
SCREEN Holdings Company Limited	Elektronik	17.600	1.561.193	1,62
Toyota Tsusho Corporation	Vertrieb/Großhandel	18.500	788.789	0,82
Yamaha Motor Company Limited	Freizeit	26.500	693.526	0,72
			5.362.511	5,57
Niederlande				
ASML Holding NV	Halbleiter	1.336	910.415	0,95
Südafrika				
Absa Group Limited	Banken	120.334	1.229.969	1,28
Südkorea				
DB Insurance Company Limited	Versicherung	24.578	1.414.032	1,47
Hyundai Marine & Fire Insurance Company Limited	Versicherung	47.166	1.224.573	1,27
KB Financial Group Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	19.704	719.633	0,75
LG Innotek Company Limited	Elektroteile & -ausrüstung	5.608	1.176.067	1,22
Woori Financial Group Incorporated	Banken	182.067	1.601.585	1,66
			6.135.890	6,37

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

2 DEGREE GLOBAL EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Schweden				
Swedbank AB	Banken	70.360	1.157.044	1,20
Schweiz				
Roche Holding AG	Pharmazie	2.082	625.622	0,65
Taiwan				
Wiwynn Corporation	Computer	52.000	1.929.274	2,00
Thailand				
Delta Electronics Thailand PCL	Elektronik	18.000	601.141	0,62
Vereinigtes Königreich				
Ferguson plc	Vertrieb/Großhandel	4.805	635.278	0,66
HSBC Holdings plc	Banken	120.704	820.365	0,85
Man Group plc	Diversifizierte Finanzdienstleister	185.107	539.258	0,56
Rio Tinto plc	Bergbau	23.610	1.602.599	1,67
Safestore Holdings plc	REITs	44.526	522.631	0,54
			4.120.131	4,28
Vereinigte Staaten				
Adobe Incorporated	Software	1.740	670.544	0,70
Advanced Micro Devices Incorporated	Halbleiter	6.698	656.471	0,68
Alphabet Incorporated	Internet	26.198	2.724.592	2,83
Amazon.com Incorporated	Internet	10.732	1.108.508	1,15
Analog Devices Incorporated	Halbleiter	4.226	833.452	0,87
AT&T Incorporated	Telekommunikation	37.505	721.971	0,75
Berkshire Hathaway Incorporated	Versicherung	4.222	1.303.627	1,35
Bristol-Myers Squibb Company	Pharmazie	15.382	1.066.126	1,11
Builders FirstSource Incorporated	Baustoffe	19.211	1.705.553	1,77
Centene Corporation	Gesundheitsdienstleistungen	11.925	753.779	0,78
Clearway Energy Incorporated	Strom	31.250	979.062	1,02
Coca-Cola Company	Getränke	19.600	1.215.788	1,26
Comcast Corporation	Medien	23.080	874.963	0,91
CSX Corporation	Transport	29.068	870.296	0,90
CVS Health Corporation	Pharmazie	14.280	1.061.147	1,10
Dropbox Incorporated	Software	25.725	556.174	0,58
Elevance Health Incorporated	Gesundheitsdienstleistungen	2.860	1.315.057	1,37
Expeditors International of Washington Incorporated	Transport	8.160	898.579	0,93
FleetCor Technologies Incorporated	Gewerbliche Dienste	2.734	576.464	0,60
Flex Limited	Elektronik	76.387	1.757.665	1,82
Fortive Corporation	Elektronik	7.899	538.475	0,56
Gilead Sciences Incorporated	Biotechnologie	22.803	1.891.965	1,96
Goldman Sachs Group Incorporated	Banken	2.753	900.534	0,94
Hewlett Packard Enterprise Company	Computer	73.878	1.176.876	1,22
Hologic Incorporated	Gesundheitsprodukte	11.163	900.854	0,94
Ingevity Corporation	Chemie	12.441	889.780	0,92
Interactive Brokers Group Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	9.374	773.917	0,80
JPMorgan Chase & Company	Banken	10.531	1.372.295	1,42
Kroger Company	Lebensmittel	28.438	1.403.984	1,46
Lowe's Companies Incorporated	Einzelhandel	3.589	717.692	0,75
M/I Homes Incorporated	Hausbau	8.609	543.142	0,56

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

2 DEGREE GLOBAL EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
McDonald's Corporation	Einzelhandel	5.865	1.639.913	1,70
Merck & Company Incorporated	Pharmazie	11.262	1.198.164	1,24
Microchip Technology Incorporated	Halbleiter	19.050	1.596.009	1,66
Molina Healthcare Incorporated	Gesundheitsdienstleistungen	4.436	1.186.586	1,23
NVIDIA Corporation	Halbleiter	7.238	2.010.499	2,09
Paychex Incorporated	Software	7.124	816.339	0,85
Prologis Incorporated	REITs	10.666	1.330.797	1,38
Regeneron Pharmaceuticals Incorporated	Biotechnologie	2.384	1.958.861	2,03
Sempra Energy	Strom	5.079	767.742	0,80
Synopsys Incorporated	Software	3.381	1.305.911	1,36
Texas Instruments Incorporated	Halbleiter	4.166	774.918	0,80
UnitedHealth Group Incorporated	Gesundheitsdienstleistungen	4.157	1.964.557	2,04
Visa Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	9.560	2.155.398	2,24
VMware Incorporated	Software	10.617	1.325.532	1,38
Walt Disney Company	Medien	3.974	397.917	0,41
WESCO International Incorporated	Vertrieb/Großhandel	7.986	1.234.156	1,28
			54.422.631	56,50
Summe Stammaktien			93.881.839	97,47
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			93.881.839	97,47

Sonstige Wertpapiere

Stammaktien

Kanada

Loblaw Companies Limited	Lebensmittel	18.865	1.719.276	1,78
--------------------------	--------------	--------	-----------	------

Summe Stammaktien

1.719.276 1,78

Summe Wertpapieranlagen

1.719.276 1,78

Summe Wertpapieranlagen

95.601.115 99,25

	Verzinsung in %	Nennwert @		
Bankguthaben				
Termineinlagen				
Kanada				
Bank of Nova Scotia (o)	3,33	9.003 CAD	6.662	0,01
Frankreich				
HSBC Bank plc (o)	1,93	238 EUR	258	0,00
Niederlande				
ING Bank NV (o)	(0,35)	1.514.803 JPY	11.409	0,01
Schweden				
Skandinaviska Enskilda Banken AB (o)	0,36	12.856 CHF	14.051	0,01

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

2 DEGREE GLOBAL EQUITY FUND

	Verzinsung in %	Nennwert @	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
Bankguthaben (Fortsetzung)				
Termineinlagen (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten				
JPMorgan Chase (o)	4,18	817.015 USD	817.015	0,85
Summe Termineinlagen			849.395	0,88
Summe Bankguthaben			849.395	0,88
<i>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, netto</i>			<i>(129.234)</i>	<i>(0,13)</i>
Gesamtes Fondsvermögen			96.321.276	100,00

@ Nennwert lautet auf angegebene Währung.
(o) Tagesgelder.

Abkürzung:	CAD	Kanadischer Dollar
	CHF	Schweizer Franken
	EUR	Euro
	JPY	Japanischer Yen
	REITs	Real Estate Investment Trust (REITs)
	USD	US-Dollar

Die Wertpapiere wurden auf Grundlage des Landes der Unternehmensgründung/-ansässigkeit aufgelistet.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Nennwert USD	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<i>Amflich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</i>					
Staatsanleihen					
Frankreich					
France Treasury Bill BTF *	2,01	14.06.2023	3.400.000	3.667.409	9,96
France Treasury Bill BTF *	2,09	12.07.2023	3.400.000	3.658.389	9,93
France Treasury Bill BTF *	2,33	09.08.2023	3.400.000	3.649.959	9,91
France Treasury Bill BTF *	2,80	29.11.2023	3.100.000	3.294.711	8,95
				14.270.468	38,75
Vereinigte Staaten					
United States Treasury Bill *+	2,75	15.06.2023	1.535.000	1.520.584	4,13
United States Treasury Bill *	3,97	06.04.2023	500.000	499.730	1,36
United States Treasury Bill *	4,13	13.04.2023	600.000	599.191	1,63
United States Treasury Bill *	4,52	18.05.2023	1.300.000	1.292.507	3,51
United States Treasury Bill *	4,60	14.09.2023	2.400.000	2.348.604	6,38
United States Treasury Bill *	4,64	08.06.2023	1.100.000	1.090.806	2,96
United States Treasury Bill *+	4,72	28.12.2023	1.535.000	1.485.751	4,03
United States Treasury Bill *	4,75	21.09.2023	500.000	488.873	1,33
United States Treasury Bill *	5,02	24.08.2023	1.300.000	1.275.549	3,46
United States Treasury Bill *	5,20	07.09.2023	500.000	489.830	1,33
				11.091.425	30,12
Summe Staatsanleihen				25.361.893	68,87
Summe Wertpapieranlagen				25.361.893	68,87
			Nennwert @		
Bankguthaben					
Termineinlagen					
Kanada					
Bank of Nova Scotia (o)	4,18		127.857 USD	127.857	0,35
Japan					
Sumitomo Mitsui Banking Corporation (o)	1,93		818.236 EUR	887.377	2,41
Sumitomo Mitsui Banking Corporation (o)	4,18		750.000 USD	750.000	2,04
				1.637.377	4,45
Vereinigtes Königreich					
Sumitomo Mitsui Banking Corporation (o)	3,17		4 GBP	5	0,00
Vereinigte Staaten					
Citibank (o)	4,18		750.000 USD	750.000	2,03
JPMorgan Chase (o)	4,18		4.145.950 USD	4.145.950	11,26
				4.895.950	13,29
Summe Termineinlagen				6.661.189	18,09
Kontokorrentkonten				14.363	0,04
Summe Bankguthaben				6.675.552	18,13
<i>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, netto</i>				4.788.263	13,00
Gesamtes Fondsvermögen				36.825.708	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND

* Der Zinssatz entspricht Effektivverzinsung zum Kaufzeitpunkt.

+ Die Wertpapiere werden vollständig oder teilweise als Sicherheit für Anlagen in Differenzkontrakten abgesondert.

@ Nennwert lautet auf angegebene Währung.

(o) Tagesgelder.

Abkürzung:	EUR	Euro
	GBP	Britisches Pfund
	USD	US-Dollar

Die Wertpapiere wurden auf Grundlage des Landes der Unternehmensgründung/-ansässigkeit aufgelistet.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.
Anlagenspiegel

CHINA A FOCUS FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien				
China				
37 Interactive Entertainment Network Technology Group Company Limited	Software	33.500	138.600	1,00
Aier Eye Hospital Group Company Limited	Gesundheitsdienstleistungen	29.500	133.307	0,97
Baoshan Iron & Steel Company Limited	Eisen/Stahl	280.100	254.291	1,84
Beijing-Shanghai High Speed Railway Company Limited	Gewerbliche Dienste	326.400	247.753	1,80
B-Soft Company Limited	Computer	233.560	374.359	2,71
BTG Hotels Group Company Limited	Hotels	89.815	305.285	2,21
BYD Company Limited	Automobilhersteller	6.200	230.946	1,67
Chacha Food Company Limited	Lebensmittel	23.100	142.513	1,03
China International Capital Corporation Limited	Diversifizierte Finanzdienstleister	121.200	243.168	1,76
China Merchants Bank Company Limited	Banken	51.000	253.944	1,84
China Tourism Group Duty Free Corporation Limited	Einzelhandel	4.800	128.157	0,93
China Vanke Company Limited	Immobilien	114.800	181.148	1,31
CITIC Securities Company Limited	Diversifizierte Finanzdienstleister	68.500	204.403	1,48
Contemporary Amperex Technology Company Limited	Automobilteile & -zubehör	4.800	284.070	2,06
CSPC Pharmaceutical Group Limited	Pharmazie	152.000	149.008	1,08
Estun Automation Company Limited	Maschinen – Diversifiziert	57.300	233.845	1,70
Ganfeng Lithium Group Company Limited	Chemie	19.264	186.593	1,35
Glodon Company Limited	Software	27.500	297.296	2,16
Han's Laser Technology Industry Group Company Limited	Elektronik	53.300	235.232	1,71
Hengli Petrochemical Company Limited	Chemie	107.100	252.653	1,83
Huatai Securities Company Limited	Diversifizierte Finanzdienstleister	137.400	255.563	1,85
Iflytek Company Limited	Software	70.200	650.360	4,71
Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited	Lebensmittel	84.800	358.655	2,60
JCET Group Company Limited	Halbleiter	36.500	172.684	1,25
Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals Company Limited	Pharmazie	44.208	275.380	2,00
Jiangsu Yangnong Chemical Company Limited	Chemie	9.400	132.872	0,96
Jiangxi Copper Company Limited	Bergbau	253.000	428.332	3,11
Kweichow Moutai Company Limited	Getränke	1.720	454.275	3,29
LONGi Green Energy Technology Company Limited	Energie – Alternative Quellen	24.800	145.905	1,06
Midea Group Company Limited	Möbel & Innenausstattung	54.504	426.406	3,09
Ping An Bank Company Limited	Banken	68.800	125.349	0,91
Ping An Insurance Group Co. of China Limited	Versicherung	48.700	322.563	2,34
Poly Developments & Holdings Group Company Limited	Immobilien	65.300	134.041	0,97
Pony Testing International Group Company Limited	Gewerbliche Dienste	53.220	289.245	2,10
Postal Savings Bank of China Company Limited	Banken	254.700	172.430	1,25
Proya Cosmetics Company Limited	Kosmetik/Körperpflege	5.090	134.761	0,98
Riyue Heavy Industry Company Limited	Energie – Alternative Quellen	61.600	199.489	1,45
SF Holding Company Limited	Transport	44.094	354.921	2,57
SG Micro Corporation	Halbleiter	13.500	305.414	2,21
Shanghai Baosight Software Company Limited	Software	16.900	143.210	1,04
Shenzhen Inovance Technology Company Limited	Elektronik	36.590	374.785	2,72

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

CHINA A FOCUS FUND

	Sektor	Aktien	Marktwert USD	% des Nettovermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
China (Fortsetzung)				
Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Company Limited	Gesundheitsprodukte	6.400	290.331	2,10
Songcheng Performance Development Company Limited	Unterhaltung	83.100	197.091	1,43
StarPower Semiconductor Limited	Halbleiter	6.700	268.093	1,94
Sungrow Power Supply Company Limited	Energie – Alternative Quellen	15.000	229.345	1,66
Tsingtao Brewery Company Limited	Getränke	28.000	306.046	2,22
Unisplendour Corporation Limited	Computer	39.600	169.063	1,23
Venustech Group Incorporated	Computer	95.600	462.870	3,36
Will Semiconductor Company Limited Shanghai	Halbleiter	16.045	213.296	1,55
Wuliangye Yibin Company Limited	Getränke	6.200	177.106	1,28
WuXi AppTec Company Limited	Gesundheitsdienstleistungen	13.900	160.706	1,17
Yantai Jereh Oilfield Services Group Company Limited	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	53.200	219.172	1,59
Yonyou Network Technology Company Limited	Software	83.249	305.189	2,21
Zhejiang NHU Company Limited	Pharmazie	92.716	242.123	1,76
Summe Stammaktien			13.573.642	98,40
Summe Wertpapieranlagen			13.573.642	98,40
	Verzinsung in %	Nennwert USD		
Bankguthaben				
Termineinlage				
Vereinigte Staaten				
China Construction Bank Corporation (o)	4,18	309.556	309.556	2,24
Summe Bankguthaben			309.556	2,24
<i>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, netto</i>			<i>(87.753)</i>	<i>(0,64)</i>
Gesamtes Fondsvermögen			13.795.445	100,00

(o) Tagesgelder.

Abkürzung: USD US-Dollar

Die Wertpapiere wurden auf Grundlage des Landes der Unternehmensgründung/-ansässigkeit aufgelistet.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

CLIMATE FOCUSED EMERGING MARKETS EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien				
Brasilien				
Ambev SA	Getränke	4.378	12.378	0,72
B3 SA – Brasil Bolsa Balcao	Diversifizierte Finanzdienstleister	726	1.483	0,09
Banco Bradesco SA	Banken	2.290	5.354	0,31
Banco do Brasil SA	Banken	1.289	9.946	0,58
BB Seguridade Participacoes SA	Versicherung	1.448	9.288	0,54
Compania de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo SABESP	Wasser	74	739	0,04
Cosan SA	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	1.259	3.748	0,22
Lojas Renner SA	Einzelhandel	1.283	4.194	0,24
Petro Rio SA	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	723	4.449	0,26
Telefonica Brasil SA	Telekommunikation	747	5.698	0,33
WEG SA	Maschinen – Diversifiziert	1.456	11.649	0,68
			68.926	4,01
Chile				
Cencosud SA	Lebensmittel	1.632	3.154	0,18
Compania Cervecerias Unidas SA	Getränke	961	7.391	0,43
			10.545	0,61
China				
37 Interactive Entertainment Network Technology Group Company Limited	Software	1.900	7.861	0,46
Agricultural Bank of China Limited	Banken	23.000	8.517	0,50
Alibaba Group Holding Limited	Internet	4.200	53.195	3,10
Bank of China Limited	Banken	22.000	8.434	0,49
Bilibili Incorporated	Software	220	5.177	0,30
BYD Company Limited	Automobilhersteller	500	14.708	0,86
CETC Cyberspace Security Technology Company Limited	Computer	300	1.701	0,10
China CITIC Bank Corporation Limited	Banken	19.000	9.558	0,56
China Construction Bank Corporation	Banken	42.000	27.182	1,58
China Everbright Bank Company Limited	Banken	26.000	7.887	0,46
China Galaxy Securities Company Limited	Diversifizierte Finanzdienstleister	9.000	4.531	0,26
China Longyuan Power Group Corporation Limited	Strom	3.000	3.422	0,20
China Merchants Bank Company Limited	Banken	1.000	5.078	0,30
China Resources Mixc Lifestyle Services Limited	Immobilien	400	2.103	0,12
China Resources Sanjiu Medical & Pharmaceutical Company Limited	Pharmazie	1.200	10.030	0,58
China Vanke Company Limited	Immobilien	1.000	1.578	0,09
China Yangtze Power Company Limited	Strom	2.400	7.416	0,43
Chongqing Brewery Company Limited	Getränke	200	3.641	0,21
CMOC Group Limited	Bergbau	9.000	5.448	0,32
Contemporary Amperex Technology Company Limited	Automobilteile & -zubehör	100	5.918	0,34
Country Garden Services Holdings Company Limited	Immobilien	1.000	1.724	0,10
CSPC Pharmaceutical Group Limited	Pharmazie	8.000	7.843	0,46
Dongfeng Motor Group Company Limited	Automobilhersteller	2.000	940	0,05
ENN Energy Holdings Limited	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	700	9.585	0,56
Focus Media Information Technology Company Limited	Werbung	2.500	2.497	0,15

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

CLIMATE FOCUSED EMERGING MARKETS EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
China (Fortsetzung)				
Ganfeng Lithium Group Company Limited	Chemie	760	7.361	0,43
G-bits Network Technology Xiamen Company Limited	Software	100	6.929	0,40
Great Wall Motor Company Limited	Automobilhersteller	2.500	3.093	0,18
Greentown China Holdings Limited	Immobilien	2.000	2.589	0,15
Guangzhou Automobile Group Company Limited	Automobilhersteller	4.000	2.528	0,15
Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Company Limited	Gesundheitsdienstleistungen	500	6.412	0,37
Haidilao International Holding Limited	Einzelhandel	1.000	2.710	0,16
Haier Smart Home Company Limited	Möbel & Innenausstattung	3.600	11.273	0,66
Hangzhou Tigermed Consulting Company Limited	Gewerbliche Dienste	400	3.769	0,22
Hansoh Pharmaceutical Group Company Limited	Pharmazie	2.000	3.467	0,20
Industrial & Commercial Bank of China Limited	Banken	35.000	18.600	1,08
Innovent Biologics Incorporated	Biotechnologie	1.000	4.486	0,26
JD Health International Incorporated	Einzelhandel	1.100	8.156	0,47
JD.com Incorporated	Internet	600	13.102	0,76
Joinn Laboratories China Company Limited	Biotechnologie	240	1.829	0,11
KE Holdings Incorporated ADR	Immobilien	256	4.823	0,28
Kingsoft Corporation Limited	Software	1.200	5.899	0,34
Kuaishou Technology	Internet	900	6.920	0,40
Lenovo Group Limited	Computer	8.000	8.667	0,50
Li Ning Company Limited	Einzelhandel	1.000	7.864	0,46
Livzon Pharmaceutical Group Incorporated	Pharmazie	300	1.631	0,10
LONGi Green Energy Technology Company Limited	Energie – Alternative Quellen	920	5.413	0,32
Mango Excellent Media Company Limited	Einzelhandel	400	2.168	0,13
Meituan	Internet	1.200	21.771	1,27
NetEase Incorporated	Software	1.100	19.418	1,13
NIO Incorporated ADR	Automobilhersteller	375	3.941	0,23
Pharmaron Beijing Company Limited	Gesundheitsdienstleistungen	100	713	0,04
Ping An Healthcare & Technology Company Limited	Einzelhandel	600	1.511	0,09
Ping An Insurance Group Company of China Limited	Versicherung	2.000	12.938	0,75
Porton Pharma Solutions Limited	Gesundheitsdienstleistungen	200	1.079	0,06
Postal Savings Bank of China Company Limited	Banken	11.000	6.524	0,38
SF Holding Company Limited	Transport	300	2.415	0,14
Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Company Limited	Pharmazie	1.500	4.265	0,25
Shanghai Junshi Biosciences Company Limited	Biotechnologie	200	1.396	0,08
Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Company Limited	Gesundheitsprodukte	100	4.536	0,26
Sichuan Yahua Industrial Group Company Limited	Sonstige Hersteller	300	926	0,05
Sungrow Power Supply Company Limited	Energie – Alternative Quellen	100	1.529	0,09
TCL Technology Group Corporation	Möbel & Innenausstattung	4.600	2.964	0,17
Tianqi Lithium Corporation	Chemie	200	2.201	0,13
Tingyi Cayman Islands Holding Corporation	Lebensmittel	2.000	3.347	0,20
Trip.com Group Limited ADR	Internet	78	2.938	0,17
Tsingtao Brewery Company Limited	Getränke	100	1.755	0,10
Uni-President China Holdings Limited	Getränke	5.000	5.043	0,29
Vipshop Holdings Limited ADR	Internet	103	1.564	0,09
Western Mining Company Limited	Bergbau	1.800	3.314	0,19
WuXi AppTec Company Limited	Gesundheitsdienstleistungen	500	5.236	0,30

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

CLIMATE FOCUSED EMERGING MARKETS EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
China (Fortsetzung)				
WuXi Biologics Cayman Incorporated	Gesundheitsdienstleistungen	1.500	9.243	0,54
Yum China Holdings Incorporated	Einzelhandel	96	6.085	0,35
Zhejiang Expressway Company Limited	Gewerbliche Dienste	6.000	4.774	0,28
Zhejiang Jiuzhou Pharmaceutical Company Limited	Pharmazie	400	1.936	0,11
ZTE Corporation	Telekommunikation	2.000	5.862	0,34
ZTO Express Cayman Incorporated ADR	Transport	46	1.318	0,08
			496.205	28,87
Griechenland				
Hellenic Telecommunications Organization SA	Telekommunikation	257	3.764	0,22
JUMBO SA	Einzelhandel	620	13.156	0,76
OPAP SA	Unterhaltung	759	12.174	0,71
			29.094	1,69
Hongkong				
Alibaba Health Information Technology Limited	Einzelhandel	4.000	2.885	0,17
Beijing Enterprises Holdings Limited	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	3.000	10.799	0,63
China Education Group Holdings Limited	Gewerbliche Dienste	3.000	2.888	0,17
China Medical System Holdings Limited	Gesundheitsprodukte	3.000	4.733	0,28
China Overseas Land & Investment Limited	Immobilien	500	1.206	0,07
China Resources Gas Group Limited	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	2.000	7.357	0,43
Chow Tai Fook Jewellery Group Limited	Einzelhandel	600	1.192	0,07
Geely Automobile Holdings Limited	Automobilhersteller	7.000	9.020	0,52
Kunlun Energy Company Limited	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	8.000	6.246	0,36
Want Want China Holdings Limited	Lebensmittel	14.000	9.007	0,52
			55.333	3,22
Ungarn				
MOL Hungarian Oil & Gas plc	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	1.282	9.389	0,55
Indien				
Axis Bank Limited GDR	Banken	242	12.543	0,73
ICICI Bank Limited ADR	Banken	1.041	22.465	1,31
Infosys Limited ADR	Computer	1.665	29.038	1,69
Mahindra & Mahindra Limited GDR	Automobilhersteller	1.287	18.027	1,05
Reliance Industries Limited GDR	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	210	11.848	0,69
Wipro Limited ADR	Computer	1.041	4.674	0,27
			98.595	5,74
Indonesien				
PT Bank Central Asia Tbk	Banken	14.000	8.191	0,48
PT Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk	Banken	15.500	4.911	0,28
PT Telkom Indonesia Persero Tbk	Telekommunikation	21.500	5.838	0,34
			18.940	1,10
Malaysia				
Axiata Group Bhd	Telekommunikation	7.400	5.061	0,29
CELCOMDIGI Bhd	Telekommunikation	8.800	8.667	0,50
CIMB Group Holdings Bhd	Banken	4.400	5.303	0,31
Hong Leong Bank Bhd	Banken	400	1.835	0,11
Kuala Lumpur Kepong Bhd	Landwirtschaft	800	3.776	0,22

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

CLIMATE FOCUSED EMERGING MARKETS EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Malaysia (Fortsetzung)				
Nestle Malaysia Bhd	Lebensmittel	200	6.214	0,36
Public Bank Bhd	Banken	3.300	2.995	0,17
Telekom Malaysia Bhd	Telekommunikation	3.500	3.890	0,23
			<u>37.741</u>	<u>2,19</u>
Mexiko				
Arca Continental SAB de CV	Getränke	1.324	12.004	0,70
Fomento Economico Mexicano SAB de CV	Getränke	1.484	14.128	0,82
Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV	Bau- & Ingenieurwesen	155	4.741	0,28
Grupo Bimbo SAB de CV	Lebensmittel	1.748	8.787	0,51
Wal-Mart de Mexico SAB de CV	Einzelhandel	2.818	11.259	0,65
			<u>50.919</u>	<u>2,96</u>
Peru				
Credicorp Limited	Banken	93	12.312	0,72
Philippinen				
Bank of the Philippine Islands	Banken	2.937	5.553	0,32
Globe Telecom Incorporated	Telekommunikation	99	3.408	0,20
PLDT Incorporated	Telekommunikation	146	3.824	0,22
SM Investments Corporation	Lebensmittel	510	8.371	0,49
			<u>21.156</u>	<u>1,23</u>
Polen				
KGHM Polska Miedz SA	Bergbau	247	7.015	0,41
Polski Koncern Naftowy ORLEN SA	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	363	4.900	0,28
			<u>11.915</u>	<u>0,69</u>
Russland				
Mobile TeleSystems PJSC * ▲ >	Telekommunikation	2.200	0	0,00
Polyus PJSC * ▲ >	Bergbau	48	0	0,00
			<u>0</u>	<u>0,00</u>
Südafrika				
Anglo American Platinum Limited	Bergbau	12	644	0,04
FirstRand Limited	Banken	1.733	5.874	0,34
Gold Fields Limited	Bergbau	1.198	16.048	0,93
Growthpoint Properties Limited	REITs	2.613	1.917	0,11
Kumba Iron Ore Limited	Eisen/Stahl	253	6.397	0,37
Naspers Limited	Internet	53	9.821	0,57
Old Mutual Limited	Diversifizierte Finanzdienstleister	11.858	7.860	0,46
Standard Bank Group Limited	Banken	1.320	12.798	0,75
Woolworths Holdings Limited	Lebensmittel	2.194	7.878	0,46
			<u>69.237</u>	<u>4,03</u>
Südkorea				
BGF retail Company Limited	Einzelhandel	18	2.508	0,15
DB Insurance Company Limited	Versicherung	146	8.400	0,49
Doosan Bobcat Incorporated	Maschinen – Bau- und Bergbau	102	3.431	0,20
GS Holdings Corporation	Lebensmittel	292	9.058	0,53
Hana Financial Group Incorporated	Banken	122	3.821	0,22
Hankook Tire & Technology Company Limited	Automobilteile & -zubehör	177	4.735	0,28
HMM Company Limited	Transport	115	1.808	0,10

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

CLIMATE FOCUSED EMERGING MARKETS EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Südkorea (Fortsetzung)				
Hyundai Engineering & Construction Company Limited	Bau- & Ingenieurwesen	148	4.162	0,24
Hyundai Glovis Company Limited	Transport	41	5.007	0,29
Kakao Corporation	Internet	120	5.683	0,33
KB Financial Group Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	216	7.889	0,46
Korean Air Lines Company Limited	Fluggesellschaften	156	2.785	0,16
LG Chem Limited	Chemie	22	12.082	0,70
LG Electronics Incorporated	Möbel & Innenausstattung	104	9.281	0,54
LG Innotek Company Limited	Elektroteile & -ausrüstung	44	9.227	0,54
Naver Corporation	Internet	53	8.305	0,48
Samsung Electro-Mechanics Company Limited	Elektronik	17	2.007	0,12
Samsung Electronics Company Limited	Halbleiter	1.355	67.006	3,90
Samsung Fire & Marine Insurance Company Limited	Versicherung	32	5.058	0,29
Samsung SDS Company Limited	Computer	98	8.764	0,51
SK Hynix Incorporated	Halbleiter	176	12.045	0,70
SK Incorporated	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	49	6.529	0,38
Woori Financial Group Incorporated	Banken	1.105	9.720	0,57
			209.311	12,18
Taiwan				
Acer Incorporated	Computer	8.000	7.415	0,43
ASE Technology Holding Company Limited	Halbleiter	2.000	7.422	0,43
Asustek Computer Incorporated	Computer	1.000	8.972	0,52
AUO Corporation	Elektronik	5.600	3.402	0,20
China Development Financial Holding Corporation	Diversifizierte Finanzdienstleister	15.000	6.207	0,36
China Steel Corporation	Eisen/Stahl	12.000	12.191	0,71
CTBC Financial Holding Company Limited	Diversifizierte Finanzdienstleister	11.000	7.921	0,46
Evergreen Marine Corporation Taiwan Limited	Transport	800	4.190	0,24
Far EasTone Telecommunications Company Limited	Telekommunikation	3.000	7.414	0,43
Fubon Financial Holding Company Limited	Diversifizierte Finanzdienstleister	5.250	9.771	0,57
Hua Nan Financial Holdings Company Limited	Diversifizierte Finanzdienstleister	7.238	5.325	0,31
Lite-On Technology Corporation	Möbel & Innenausstattung	4.000	9.629	0,56
Micro-Star International Company Limited	Elektronik	1.000	4.753	0,28
Nan Ya Plastics Corporation	Chemie	5.000	12.737	0,74
Nan Ya Printed Circuit Board Corporation	Elektronik	1.000	9.374	0,55
President Chain Store Corporation	Einzelhandel	1.000	8.862	0,52
Taishin Financial Holding Company Limited	Diversifizierte Finanzdienstleister	7.346	4.020	0,23
Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	Halbleiter	6.000	105.148	6,12
Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited ADR	Halbleiter	75	6.976	0,41
Unimicon Technology Corporation	Elektronik	1.000	4.877	0,28
United Microelectronics Corporation	Halbleiter	6.000	10.500	0,61
Vanguard International Semiconductor Corporation	Halbleiter	1.000	3.199	0,19
Wan Hai Lines Limited	Transport	1.150	2.603	0,15
Yang Ming Marine Transport Corporation	Transport	1.000	2.123	0,12
			265.031	15,42

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

CLIMATE FOCUSED EMERGING MARKETS EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Thailand				
Delta Electronics Thailand PCL	<i>Elektronik</i>	100	3.340	0,19
Türkei				
Turk Hava Yollari AO	<i>Fluggesellschaften</i>	447	2.768	0,16
Turkcell Iletisim Hizmetleri AS	<i>Telekommunikation</i>	5.698	9.535	0,56
			<u>12.303</u>	<u>0,72</u>
Vereinigte Staaten				
BeiGene Limited ADR	<i>Biotechnologie</i>	40	8.621	0,50
Summe Stammaktien			1.488.913	86,62
Börsennotierte Fonds				
Frankreich				
Lyxor MSCI India UCITS ETF		1.909	43.857	2,55
Irland				
iShares MSCI India UCITS ETF		10.830	72.815	4,24
Summe Börsennotierte Fonds			116.672	6,79
	Dividenden- rendite %			
Vorzugsaktien				
Brasilien				
Gerdau SA	<i>14,02 Eisen/Stahl</i>	1.629	8.128	0,48
Itau Unibanco Holding SA	<i>4,88 Banken</i>	2.706	13.209	0,77
Petroleo Brasileiro SA	<i>39,40 Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen</i>	4.059	18.780	1,09
			<u>40.117</u>	<u>2,34</u>
Chile				
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA	<i>10,30 Chemie</i>	94	7.553	0,44
Südkorea				
Samsung Electronics Company Limited	<i>1,95 Halbleiter</i>	430	17.894	1,04
Summe Vorzugsaktien			65.564	3,82
Summe Wertpapieranlagen			1.671.149	97,23

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

CLIMATE FOCUSED EMERGING MARKETS EQUITY FUND

	Verzinsung in %	Nennwert @	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
Bankguthaben				
Termineinlagen				
Frankreich				
BNP Paribas (o)	0,60	1.099 HKD	140	0,01
BNP Paribas (o)	5,75	10.346 ZAR	581	0,03
			<u>721</u>	<u>0,04</u>
Japan				
Sumitomo Mitsui Banking Corporation (o)	1,93	716 EUR	776	0,05
Vereinigte Staaten				
Citibank (o)	4,18	114.386 USD	114.386	6,65
Summe Termineinlagen			115.883	6,74
Kontokorrentkonten			659	0,04
Summe Bankguthaben			116.542	6,78
<i>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, netto</i>			<i>(68.835)</i>	<i>(4,01)</i>
Gesamtes Fondsvermögen			1.718.856	100,00

* Das Wertpapier wurde nach dem vom Verwaltungsrat genehmigten Verfahren zum beizulegenden Zeitwert bewertet.

▲ Wertpapier ohne Ertrag.

> Wertpapier mit beschränkter Handelbarkeit. Der Teilfonds hielt beschränkt handelbare Wertpapiere mit einem aktuellen Gesamtwert von 0 USD (ursprüngliche Gesamtkosten von 13.711 USD), was 0 % seines Nettovermögens zum Ende des Berichtszeitraums entspricht.

@ Nennwert lautet auf angegebene Währung.

(o) Tagesgelder.

Abkürzung:	ADR	American Depository Receipt
	EUR	Euro
	GDR	Global Depository Receipt
	HKD	Hongkong-Dollar
	REITs	Real Estate Investment Trust (REITs)
	USD	US-Dollar
	ZAR	Südafrikanischer Rand

Die Wertpapiere wurden auf Grundlage des Landes der Unternehmensgründung/-ansässigkeit aufgelistet.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

CLIMATE FOCUSED GLOBAL EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien				
Australien				
Macquarie Group Limited	Banken	21	2.486	0,27
Sonic Healthcare Limited	Gesundheitsdienstleistungen	157	3.681	0,41
Westpac Banking Corporation	Banken	446	6.494	0,72
			<u>12.661</u>	<u>1,40</u>
Belgien				
KBC Group NV	Banken	35	2.405	0,27
Kanada				
Canadian Imperial Bank of Commerce	Banken	41	1.739	0,19
Gildan Activewear Incorporated	Bekleidung	74	2.458	0,27
Manulife Financial Corporation	Versicherung	185	3.395	0,38
Northland Power Incorporated	Strom	69	1.730	0,19
			<u>9.322</u>	<u>1,03</u>
Dänemark				
Demant AS	Gesundheitsprodukte	57	2.001	0,22
Novo Nordisk AS	Pharmazie	57	9.053	1,00
			<u>11.054</u>	<u>1,22</u>
Frankreich				
Edenred	Commercial Services	129	7.635	0,84
Eiffage SA	Bau- & Ingenieurwesen	28	3.030	0,33
Hermes International	Bekleidung	2	4.050	0,45
Ipsen SA	Pharmazie	51	5.616	0,62
Pernod Ricard SA	Getränke	27	6.114	0,68
Publicis Groupe SA	Werbung	113	8.821	0,98
			<u>35.266</u>	<u>3,90</u>
Deutschland				
Bayerische Motoren Werke AG	Automobilhersteller	69	7.562	0,83
Deutsche Post AG	Transport	125	5.854	0,65
Mercedes-Benz Group AG	Automobilhersteller	87	6.691	0,74
			<u>20.107</u>	<u>2,22</u>
Hongkong				
Budweiser Brewing Company APAC Limited	Getränke	500	1.522	0,17
Sino Land Company Limited	Immobilien	2.000	2.704	0,30
			<u>4.226</u>	<u>0,47</u>
Irland				
Accenture plc	Computer	27	7.717	0,85
Israel				
Check Point Software Technologies Limited	Computer	48	6.240	0,69
Mizrahi Tefahot Bank Limited	Banken	81	2.539	0,28
			<u>8.779</u>	<u>0,97</u>
Italien				
Assicurazioni Generali SpA	Versicherung	362	7.213	0,80
DiaSorin SpA	Gesundheitsprodukte	28	2.950	0,33
			<u>10.163</u>	<u>1,13</u>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

CLIMATE FOCUSED GLOBAL EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Japan				
Chugai Pharmaceutical Company Limited	Pharmazie	200	4.938	0,55
Japan Post Holdings Company Limited	Versicherung	500	4.058	0,45
Kajima Corporation	Bau- & Ingenieurwesen	600	7.240	0,80
Konami Group Corporation	Software	100	4.590	0,51
Mazda Motor Corporation	Automobilhersteller	500	4.612	0,51
Mitsubishi Corporation	Vertrieb/Großhandel	200	7.187	0,79
Mitsubishi HC Capital Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	700	3.615	0,40
Nexon Company Limited	Software	300	7.164	0,79
Nippon Telegraph & Telephone Corporation	Telekommunikation	200	5.977	0,66
Ono Pharmaceutical Company Limited	Pharmazie	200	4.168	0,46
Sekisui House Limited	Hausbau	200	4.076	0,45
Square Enix Holdings Company Limited	Software	100	4.806	0,53
Tokio Marine Holdings Incorporated	Versicherung	300	5.773	0,64
Yamaha Motor Company Limited	Freizeit	200	5.234	0,58
			<u>73.438</u>	<u>8,12</u>
Luxemburg				
Eurofins Scientific SE	Gesundheitsdienstleistungen	30	2.009	0,22
Niederlande				
ASML Holding NV	Halbleiter	10	6.815	0,76
Stellantis NV	Automobilhersteller	469	8.529	0,94
			<u>15.344</u>	<u>1,70</u>
Norwegen				
Equinor ASA	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	232	6.595	0,73
Singapur				
Capitaland Investment Limited	Private Equity	1.800	4.994	0,55
Spanien				
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Banken	1.058	7.564	0,84
CaixaBank SA	Banken	1.716	6.696	0,74
Red Electrica Corporation SA	Strom	43	756	0,08
			<u>15.016</u>	<u>1,66</u>
Schweden				
Boliden AB	Bergbau	77	3.025	0,34
Skandinaviska Enskilda Banken AB	Banken	576	6.358	0,70
			<u>9.383</u>	<u>1,04</u>
Schweiz				
Kuehne + Nagel International AG	Transport	29	8.637	0,96
Straumann Holding AG	Gesundheitsprodukte	29	4.350	0,48
Swatch Group AG	Einzelhandel	16	5.510	0,61
			<u>18.497</u>	<u>2,05</u>
Vereinigtes Königreich				
Diageo plc	Getränke	92	4.106	0,46
Ferguson plc	Vertrieb/Großhandel	16	2.115	0,23
Rio Tinto plc	Bergbau	100	6.788	0,75
WPP plc	Werbung	441	5.240	0,58
			<u>18.249</u>	<u>2,02</u>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

CLIMATE FOCUSED GLOBAL EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten				
Abbott Laboratories	Gesundheitsprodukte	90	9.113	1,01
Alphabet Incorporated Class A	Internet	117	12.136	1,34
Alphabet Incorporated Class C	Internet	98	10.192	1,13
Amazon.com Incorporated	Internet	118	12.188	1,35
American Express Company	Diversifizierte Finanzdienstleister	46	7.588	0,84
American Tower Corporation	REITs	20	4.087	0,45
Apollo Global Management Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	74	4.674	0,52
Apple Incorporated	Computer	230	37.927	4,19
Archer-Daniels-Midland Company	Landwirtschaft	60	4.780	0,53
Arista Networks Incorporated	Telekommunikation	56	9.400	1,04
AT&T Incorporated	Telekommunikation	407	7.835	0,87
Berkshire Hathaway Incorporated	Versicherung	7	2.161	0,24
Best Buy Company Incorporated	Einzelhandel	76	5.948	0,66
Bristol-Myers Squibb Company	Pharmazie	116	8.040	0,89
Cadence Design Systems Incorporated	Software	41	8.614	0,95
Capital One Financial Corporation	Diversifizierte Finanzdienstleister	56	5.385	0,60
Celanese Corporation	Chemie	39	4.247	0,47
Cheniere Energy Incorporated	Pipelines	40	6.304	0,70
Cisco Systems Incorporated	Telekommunikation	139	7.266	0,80
Citigroup Incorporated	Banken	113	5.298	0,59
Coca-Cola Company	Getränke	119	7.382	0,82
Copart Incorporated	Vertrieb/Großhandel	104	7.822	0,86
Costco Wholesale Corporation	Einzelhandel	18	8.944	0,99
CSX Corporation	Transport	230	6.886	0,76
Cummins Incorporated	Automobilhersteller	24	5.733	0,63
CVS Health Corporation	Pharmazie	86	6.391	0,71
Dell Technologies Incorporated	Computer	42	1.689	0,19
Devon Energy Corporation	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	89	4.504	0,50
Dropbox Incorporated	Software	286	6.183	0,68
EPAM Systems Incorporated	Computer	11	3.289	0,36
EQT Corporation	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	133	4.244	0,47
Expeditors International of Washington Incorporated	Transport	57	6.277	0,69
FleetCor Technologies Incorporated	Gewerbliche Dienste	21	4.428	0,49
Fortinet Incorporated	Computer	108	7.178	0,79
Gilead Sciences Incorporated	Biotechnologie	107	8.878	0,98
Goldman Sachs Group Incorporated	Banken	21	6.869	0,76
Home Depot Incorporated	Einzelhandel	32	9.444	1,04
Host Hotels & Resorts Incorporated	REITs	276	4.551	0,50
HP Incorporated	Computer	87	2.553	0,28
Incyte Corporation	Biotechnologie	85	6.143	0,68
Intuit Incorporated	Software	8	3.567	0,39
Johnson & Johnson	Pharmazie	12	1.860	0,21
JPMorgan Chase & Company	Banken	50	6.515	0,72
KLA Corporation	Halbleiter	12	4.790	0,53
Kroger Company	Lebensmittel	126	6.221	0,69
Lam Research Corporation	Halbleiter	12	6.361	0,70
Lowe's Companies Incorporated	Einzelhandel	12	2.400	0,27
McDonald's Corporation	Einzelhandel	37	10.346	1,14
McKesson Corporation	Pharmazie	18	6.409	0,71
Merck & Company Incorporated	Pharmazie	103	10.958	1,21
MetLife Incorporated	Versicherung	97	5.620	0,62
Microsoft Corporation	Software	129	37.191	4,11

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

CLIMATE FOCUSED GLOBAL EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
Moderna Incorporated	Biotechnologie	21	3.225	0,36
Molina Healthcare Incorporated	Gesundheitsdienstleistungen	17	4.547	0,50
NextEra Energy Incorporated	Strom	50	3.854	0,43
Nucor Corporation	Eisen/Stahl	31	4.789	0,53
NVIDIA Corporation	Halbleiter	26	7.222	0,80
PACCAR Incorporated	Automobilhersteller	60	4.392	0,49
Parker-Hannifin Corporation	Sonstige Hersteller	14	4.705	0,52
Pfizer Incorporated	Pharmazie	160	6.528	0,72
Pioneer Natural Resources Company	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	21	4.289	0,47
Prologis Incorporated	REITs	12	1.497	0,17
Prudential Financial Incorporated	Versicherung	63	5.213	0,58
Qualcomm Incorporated	Halbleiter	47	5.996	0,66
Regency Centers Corporation	REITs	20	1.224	0,14
Regeneron Pharmaceuticals Incorporated	Biotechnologie	7	5.752	0,64
Regions Financial Corporation	Banken	299	5.549	0,61
Robert Half International Incorporated	Gewerbliche Dienste	34	2.739	0,30
Salesforce Incorporated	Software	33	6.593	0,73
Snap-on Incorporated	Werkzeug/Werkzeugmaschinen	29	7.160	0,79
Steel Dynamics Incorporated	Eisen/Stahl	54	6.105	0,68
Synchrony Financial	Diversifizierte Finanzdienstleister	180	5.234	0,58
Synopsys Incorporated	Software	21	8.111	0,90
Target Corporation	Einzelhandel	18	2.981	0,33
Tesla Incorporated	Automobilhersteller	41	8.506	0,94
Texas Instruments Incorporated	Halbleiter	16	2.976	0,33
U-Haul Holding Company	Gewerbliche Dienste	90	4.666	0,52
Ulta Beauty Incorporated	Einzelhandel	16	8.731	0,97
Union Pacific Corporation	Transport	17	3.421	0,38
United Parcel Service Incorporated	Transport	13	2.522	0,28
United Rentals Incorporated	Gewerbliche Dienste	14	5.541	0,61
UnitedHealth Group Incorporated	Gesundheitsdienstleistungen	10	4.726	0,52
Vertex Pharmaceuticals Incorporated	Biotechnologie	24	7.562	0,84
VICI Properties Incorporated	REITs	151	4.926	0,54
Visa Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	45	10.146	1,12
VMware Incorporated	Software	58	7.241	0,80
Walmart Incorporated	Einzelhandel	66	9.732	1,08
WR Berkley Corporation	Versicherung	76	4.732	0,52
			587.942	65,03
Summe Stammaktien			873.167	96,58
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			873.167	96,58
<u>Sonstige Wertpapiere</u>				
Stammaktien				
Kanada				
Loblaw Companies Limited	Lebensmittel	40	3.645	0,40
National Bank of Canada	Banken	75	5.365	0,59
Power Corporation of Canada	Versicherung	122	3.118	0,35
Summe Stammaktien			12.128	1,34
Summe Wertpapieranlagen			12.128	1,34
Summe Wertpapieranlagen			885.295	97,92

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

CLIMATE FOCUSED GLOBAL EQUITY FUND

	Verzinsung in %	Nennwert @	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
Bankguthaben				
Termineinlagen				
Kanada				
Royal Bank of Canada (o)	3,33	56 CAD	41	0,00
Frankreich				
BNP Paribas (o)	1,54	339 DKK	49	0,00
Japan				
Sumitomo Mitsui Banking Corporation (o)	1,93	5 EUR	6	0,00
Niederlande				
ING Bank NV (o)	(0,35)	12.704 JPY	96	0,01
ING Bank NV (o)	2,32	66 AUD	44	0,01
			140	0,02
Schweden				
Skandinaviska Enskilda Banken AB (o)	0,36	57 CHF	62	0,01
Vereinigtes Königreich				
Sumitomo Mitsui Banking Corporation (o)	3,17	72 GBP	89	0,01
Vereinigte Staaten				
Citibank (o)	4,18	112.019 USD	112.019	12,39
Summe Termineinlagen			112.406	12,43
Kontokorrentkonten			44	0,01
Summe Bankguthaben			112.450	12,44
<i>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, netto</i>			<i>(93.634)</i>	<i>(10,36)</i>
Gesamtes Fondsvermögen			904.111	100,00

@ Nennwert lautet auf angegebene Währung.

(o) Tagesgelder.

Abkürzung:	AUD	Australischer Dollar
	CAD	Kanadischer Dollar
	CHF	Schweizer Franken
	DKK	Dänische Krone
	EUR	Euro
	GBP	Britisches Pfund
	JPY	Japanischer Yen
	REITs	Real Estate Investment Trust (REITs)
	USD	US-Dollar

Die Wertpapiere wurden auf Grundlage des Landes der Unternehmensgründung/-ansässigkeit aufgelistet.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

CLIMATE FOCUSED U.S. EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien				
Irland				
Accenture plc	Computer	31	8.860	1,02
Medtronic plc	Gesundheitsprodukte	94	7.578	0,88
			<u>16.438</u>	<u>1,90</u>
Schweiz				
Chubb Limited	Versicherung	37	7.185	0,83
Vereinigte Staaten				
Abbott Laboratories	Gesundheitsprodukte	76	7.696	0,89
AbbVie Incorporated	Pharmazie	29	4.622	0,53
Activision Blizzard Incorporated	Software	37	3.167	0,37
Acuity Brands Incorporated	Elektroteile & -ausrüstung	29	5.299	0,61
Adobe Incorporated	Software	22	8.478	0,98
Advanced Micro Devices Incorporated	Halbleiter	60	5.881	0,68
Allison Transmission Holdings Incorporated	Automobilteile & -zubehör	143	6.469	0,75
Alphabet Incorporated Class A	Internet	180	18.671	2,16
Alphabet Incorporated Class C	Internet	140	14.560	1,68
Amazon.com Incorporated	Internet	160	16.526	1,91
American Tower Corporation	REITs	35	7.152	0,83
Amgen Incorporated	Biotechnologie	20	4.835	0,56
Apple Incorporated	Computer	312	51.449	5,95
Archer-Daniels-Midland Company	Landwirtschaft	15	1.195	0,14
AT&T Incorporated	Telekommunikation	363	6.988	0,81
Axis Capital Holdings Limited	Versicherung	107	5.834	0,67
Baker Hughes Company	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	47	1.356	0,16
Bank of America Corporation	Banken	163	4.662	0,54
Berkshire Hathaway Incorporated	Versicherung	28	8.645	1,00
Best Buy Company Incorporated	Einzelhandel	49	3.835	0,44
Biogen Incorporated	Biotechnologie	8	2.224	0,26
Bio-Rad Laboratories Incorporated	Biotechnologie	8	3.832	0,44
Boyd Gaming Corporation	Hotels	72	4.617	0,53
Bristol-Myers Squibb Company	Pharmazie	126	8.733	1,01
Brixmor Property Group Incorporated	REITs	281	6.047	0,70
Broadcom Incorporated	Halbleiter	19	12.189	1,41
Builders FirstSource Incorporated	Baustoffe	92	8.168	0,94
Capital One Financial Corporation	Diversifizierte Finanzdienstleister	58	5.577	0,65
Charles Schwab Corporation	Diversifizierte Finanzdienstleister	29	1.519	0,18
Cheniere Energy Incorporated	Pipelines	35	5.516	0,64
Cisco Systems Incorporated	Telekommunikation	208	10.873	1,26
Citigroup Incorporated	Banken	113	5.299	0,61
CME Group Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	11	2.107	0,24
Coca-Cola Company	Getränke	162	10.049	1,16
Comcast Corporation	Medien	150	5.686	0,66
Consolidated Edison Incorporated	Strom	72	6.888	0,80
Copart Incorporated	Vertrieb/Großhandel	77	5.791	0,67
Costco Wholesale Corporation	Einzelhandel	21	10.434	1,21
Crane Holdings Company	Maschinen – Diversifiziert	50	5.675	0,66
CSX Corporation	Transport	198	5.928	0,69
CVS Health Corporation	Pharmazie	93	6.911	0,80
Dell Technologies Incorporated	Computer	43	1.729	0,20
Devon Energy Corporation	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	55	2.783	0,32
Dick's Sporting Goods Incorporated	Einzelhandel	26	3.689	0,43
Elevance Health Incorporated	Gesundheitsdienstleistungen	18	8.277	0,96

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

CLIMATE FOCUSED U.S. EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
Evercore Incorporated	<i>Diversifizierte Finanzdienstleister</i>	55	6.346	0,73
Exelon Corporation	<i>Strom</i>	153	6.409	0,74
Expeditors International of Washington Incorporated	<i>Transport</i>	59	6.497	0,75
Fortinet Incorporated	<i>Computer</i>	38	2.525	0,29
Fortive Corporation	<i>Elektronik</i>	53	3.613	0,42
Halliburton Company	<i>Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen</i>	144	4.556	0,53
Hershey Company	<i>Lebensmittel</i>	9	2.290	0,26
Hess Corporation	<i>Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen</i>	34	4.499	0,52
Hologic Incorporated	<i>Gesundheitsprodukte</i>	88	7.102	0,82
Home Depot Incorporated	<i>Einzelhandel</i>	41	12.100	1,40
HP Incorporated	<i>Computer</i>	183	5.371	0,62
Interactive Brokers Group Incorporated	<i>Diversifizierte Finanzdienstleister</i>	63	5.201	0,60
International Business Machines Corporation	<i>Computer</i>	18	2.360	0,27
Interpublic Group of Companies Incorporated	<i>Werbung</i>	146	5.437	0,63
Intuit Incorporated	<i>Software</i>	17	7.579	0,88
Intuitive Surgical Incorporated	<i>Gesundheitsprodukte</i>	13	3.321	0,38
Jefferies Financial Group Incorporated	<i>Diversifizierte Finanzdienstleister</i>	165	5.237	0,61
Johnson & Johnson	<i>Pharmazie</i>	25	3.875	0,45
JPMorgan Chase & Company	<i>Banken</i>	110	14.334	1,66
Kinder Morgan Incorporated	<i>Pipelines</i>	196	3.432	0,40
KLA Corporation	<i>Halbleiter</i>	11	4.391	0,51
Kroger Company	<i>Lebensmittel</i>	133	6.566	0,76
Louisiana-Pacific Corporation	<i>Baustoffe</i>	36	1.952	0,23
Lowe's Companies Incorporated	<i>Einzelhandel</i>	17	3.399	0,39
Mastercard Incorporated	<i>Diversifizierte Finanzdienstleister</i>	20	7.268	0,84
McDonald's Corporation	<i>Einzelhandel</i>	32	8.947	1,03
McKesson Corporation	<i>Pharmazie</i>	19	6.765	0,78
Merck & Company Incorporated	<i>Pharmazie</i>	113	12.022	1,39
MetLife Incorporated	<i>Versicherung</i>	51	2.955	0,34
MGIC Investment Corporation	<i>Versicherung</i>	304	4.080	0,47
Microsoft Corporation	<i>Software</i>	186	53.624	6,20
Moderna Incorporated	<i>Biotechnologie</i>	15	2.304	0,27
Molina Healthcare Incorporated	<i>Gesundheitsdienstleistungen</i>	20	5.350	0,62
Morgan Stanley	<i>Banken</i>	30	2.634	0,30
Netflix Incorporated	<i>Internet</i>	18	6.219	0,72
NextEra Energy Incorporated	<i>Strom</i>	27	2.081	0,24
Nucor Corporation	<i>Eisen/Stahl</i>	24	3.707	0,43
NVIDIA Corporation	<i>Halbleiter</i>	49	13.611	1,57
ONEOK Incorporated	<i>Pipelines</i>	87	5.528	0,64
Oracle Corporation	<i>Software</i>	28	2.602	0,30
Owens Corning	<i>Baustoffe</i>	10	958	0,11
Parker-Hannifin Corporation	<i>Sonstige Hersteller</i>	11	3.697	0,43
PayPal Holdings Incorporated	<i>Gewerbliche Dienste</i>	22	1.671	0,19
PepsiCo Incorporated	<i>Getränke</i>	28	5.104	0,59
Pfizer Incorporated	<i>Pharmazie</i>	42	1.714	0,20
Procter & Gamble Company	<i>Kosmetik/Körperpflege</i>	15	2.230	0,26
Prologis Incorporated	<i>REITs</i>	19	2.371	0,27
Prudential Financial Incorporated	<i>Versicherung</i>	68	5.626	0,65
Public Storage	<i>REITs</i>	8	2.417	0,28
Qualcomm Incorporated	<i>Halbleiter</i>	64	8.165	0,94
QuidelOrtho Corporation	<i>Gesundheitsprodukte</i>	41	3.653	0,42
Regeneron Pharmaceuticals Incorporated	<i>Biotechnologie</i>	7	5.752	0,67
Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.				

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

CLIMATE FOCUSED U.S. EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
Regions Financial Corporation	Banken	296	5.494	0,64
Reinsurance Group of America Incorporated	Versicherung	43	5.709	0,66
Reliance Steel & Aluminum Company	Eisen/Stahl	31	7.959	0,92
Robert Half International Incorporated	Gewerbliche Dienste	69	5.559	0,64
Salesforce Incorporated	Software	50	9.989	1,16
Schneider National Incorporated	Transport	246	6.581	0,76
Sempra Energy	Strom	19	2.872	0,33
Service Corporation International	Gewerbliche Dienste	38	2.614	0,30
ServiceNow Incorporated	Software	12	5.577	0,64
Sherwin-Williams Company	Chemie	9	2.023	0,23
Simon Property Group Incorporated	REITs	54	6.046	0,70
Snap-on Incorporated	Werkzeug/Werkzeugmaschinen	27	6.666	0,77
Starbucks Corporation	Einzelhandel	38	3.957	0,46
Steel Dynamics Incorporated	Eisen/Stahl	20	2.261	0,26
Synchrony Financial	Diversifizierte Finanzdienstleister	121	3.519	0,41
Target Corporation	Einzelhandel	16	2.650	0,31
Tesla Incorporated	Automobilhersteller	61	12.655	1,46
Texas Instruments Incorporated	Halbleiter	38	7.068	0,82
UGI Corporation	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	158	5.492	0,64
Union Pacific Corporation	Transport	13	2.616	0,30
United Parcel Service Incorporated	Transport	33	6.402	0,74
UnitedHealth Group Incorporated	Gesundheitsdienstleistungen	19	8.979	1,04
Verizon Communications Incorporated	Telekommunikation	93	3.617	0,42
Vertex Pharmaceuticals Incorporated	Biotechnologie	25	7.877	0,91
VICI Properties Incorporated	REITs	85	2.773	0,32
Visa Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	65	14.655	1,69
Vitesse Energy Incorporated	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	19	362	0,04
VMware Incorporated	Software	12	1.498	0,17
Voya Financial Incorporated	Versicherung	51	3.644	0,42
Walmart Incorporated	Einzelhandel	73	10.764	1,24
Walt Disney Company	Medien	20	2.003	0,23
Williams-Sonoma Incorporated	Einzelhandel	45	5.475	0,63
Zoom Video Communications Incorporated	Software	21	1.551	0,18
			826.215	95,53
Summe Stammaktien			849.838	98,26
Summe Wertpapieranlagen			849.838	98,26

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

CLIMATE FOCUSED U.S. EQUITY FUND

	Verzinsung in %	Nennwert in USD	Markt- wert USD	% des Netto- vermögen
Bankguthaben				
Termineinlagen				
Japan				
Sumitomo Mitsui Banking Corporation (o)	4,18	7.719	7.719	0,89
Vereinigte Staaten				
China Construction Bank Corporation (o)	4,18	92.220	92.220	10,67
Summe Termineinlagen			99.939	11,56
Summe Bankguthaben			99.939	11,56
<i>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, netto</i>			<i>(84.930)</i>	<i>(9,82)</i>
Gesamtes Fondsvermögen			864.847	100,00

(o) Tagesgelder.

Abkürzung: REITs Real Estate Investment Trust (REITs)
USD US-Dollar

Die Wertpapiere wurden auf Grundlage des Landes der Unternehmensgründung/-ansässigkeit aufgelistet.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

CLIMATE TRANSITION GLOBAL INVESTMENT GRADE CREDIT FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Sektor	Nennwert @	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>						
Unternehmensanleihen und Schuldtitel						
Australien						
Australia & New Zealand Banking Group Limited ±	0,67	05.05.2031	Banken	400.000 EUR	377.276	0,25
Macquarie Group Limited ±	4,10	21.06.2028	Banken	845.000 USD	806.619	0,54
Scentre Group Trust 2 ±	5,13	24.09.2080	REITs	885.000 USD	746.978	0,50
Transurban Finance Company Proprietary Limited	1,75	29.03.2028	Gewerbliche Dienste	400.000 EUR	393.044	0,26
					<u>2.323.917</u>	<u>1,55</u>
Österreich						
BAWAG Group AG ±	2,38	26.03.2029	Banken	700.000 EUR	711.985	0,47
Raiffeisen Bank International AG ±	2,88	18.06.2032	Banken	500.000 EUR	419.550	0,28
Raiffeisen Bank International AG ±	7,38	20.12.2032	Banken	500.000 EUR	523.757	0,35
					<u>1.655.292</u>	<u>1,10</u>
Belgien						
Aliaxis Finance SA	0,88	08.11.2028	Baustoffe	400.000 EUR	333.630	0,22
Argenta Spaarbank NV ±	1,38	08.02.2029	Banken	800.000 EUR	703.639	0,47
Belfius Bank SA ±	1,25	06.04.2034	Banken	700.000 EUR	595.356	0,39
KBC Group NV ±	0,25	01.03.2027	Banken	500.000 EUR	485.211	0,32
Lonza Finance International NV	1,63	21.04.2027	Gesundheitsdienstleistungen	400.000 EUR	400.420	0,27
					<u>2.518.256</u>	<u>1,67</u>
Kanada						
Toronto-Dominion Bank	3,23	24.07.2024	Banken	600.000 CAD	435.152	0,29
China						
NXP BV	3,88	18.06.2026	Halbleiter	845.000 USD	816.039	0,54
Dänemark						
Nykredit Realkredit AS ±	0,88	28.07.2031	Banken	100.000 EUR	93.707	0,06
Pandora AS	4,50	10.04.2028	Einzelhandel	300.000 EUR	329.348	0,22
TDC Net AS	5,62	06.02.2030	Telekommunikation	200.000 EUR	214.339	0,14
					<u>637.394</u>	<u>0,42</u>
Finnland						
Balder Finland OYJ	1,38	24.05.2030	Immobilien	500.000 EUR	339.966	0,23
Castellum Helsinki Finance Holding Abp	0,88	17.09.2029	Immobilien	400.000 EUR	284.005	0,19
Citycon OYJ ^±	3,63	10.06.2026	Immobilien	200.000 EUR	110.564	0,07
Mandatum Life Insurance Company Limited ±	1,88	04.10.2049	Versicherung	400.000 EUR	396.678	0,26
Neste OYJ	3,88	16.03.2029	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	400.000 EUR	438.315	0,29
Nokia OYJ	4,38	21.08.2031	Telekommunikation	300.000 EUR	321.885	0,22
OP Corporate Bank plc	2,88	15.12.2025	Banken	300.000 EUR	317.749	0,21
Sampo OYJ ±	3,38	23.05.2049	Versicherung	400.000 EUR	384.958	0,26
					<u>2.594.120</u>	<u>1,73</u>
Frankreich						
Banque Federative du Credit Mutuel SA	3,13	14.09.2027	Banken	500.000 EUR	528.582	0,35
BNP Paribas SA ±	0,50	30.05.2028	Banken	400.000 EUR	374.044	0,25
BNP Paribas SA ±	2,00	24.05.2031	Banken	600.000 GBP	636.523	0,42
BNP Paribas SA ±	2,75	25.07.2028	Banken	400.000 EUR	406.440	0,27

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

CLIMATE TRANSITION GLOBAL INVESTMENT GRADE CREDIT FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Sektor	Nennwert @	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>						
Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Fortsetzung)						
Frankreich (Fortsetzung)						
BNP Paribas SA	3,38	09.01.2025	Banken	455.000 USD	436.417	0,29
Credit Agricole Assurances SA	2,00	17.07.2030	Versicherung	600.000 EUR	524.382	0,35
Credit Agricole SA ±	1,87	09.12.2031	Banken	500.000 GBP	514.494	0,34
Credit Agricole SA	4,13	07.03.2030	Banken	400.000 EUR	445.382	0,30
Electricite de France SA	5,50	17.10.2041	Strom	100.000 GBP	113.103	0,07
Engie SA	1,00	26.10.2036	Strom	300.000 EUR	223.548	0,15
Suez SACA	1,88	24.05.2027	Wasser	600.000 EUR	606.424	0,40
TotalEnergies Capital International SA	2,83	10.01.2030	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	1.015.000 USD	925.679	0,62
TotalEnergies SE ^±	2,71	05.05.2023	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	300.000 EUR	324.101	0,22
Veolia Environnement SA ^±	2,00	15.11.2027	Wasser	500.000 EUR	448.528	0,30
					6.507.647	4,33
Deutschland						
Amprion GmbH	3,45	22.09.2027	Strom	500.000 EUR	537.473	0,36
Bayer AG ±	2,38	12.11.2079	Pharmazie	200.000 EUR	201.055	0,13
Deutsche Bank AG ±	3,25	24.05.2028	Banken	600.000 EUR	588.214	0,39
E.ON SE	1,63	29.03.2031	Strom	500.000 EUR	468.002	0,31
Hamburg Commercial Bank AG ±	0,50	22.09.2026	Banken	500.000 EUR	472.609	0,32
Hannover Rueck SE ±	1,13	09.10.2039	Versicherung	700.000 EUR	585.183	0,39
LANXESS AG	0,63	01.12.2029	Chemie	300.000 EUR	256.518	0,17
LEG Immobilien SE	0,75	30.06.2031	Immobilien	500.000 EUR	385.480	0,26
Vonovia SE	0,63	14.12.2029	Immobilien	500.000 EUR	395.750	0,26
Vonovia SE	0,75	01.09.2032	Immobilien	500.000 EUR	347.322	0,23
					4.237.606	2,82
Irland						
Avolon Holdings Funding Limited	4,38	01.05.2026	Diversifizierte Finanzdienstleister	860.000 USD	806.935	0,54
Italien						
BPER Banca ±	6,13	01.02.2028	Banken	400.000 EUR	434.368	0,29
FinecoBank Banca Fineco SpA ±	0,50	21.10.2027	Banken	400.000 EUR	372.279	0,25
Hera SpA	1,00	25.04.2034	Strom	400.000 EUR	313.510	0,21
Intesa Sanpaolo SpA ±	5,00	08.03.2028	Banken	600.000 EUR	650.450	0,43
UniCredit SpA	4,63	12.04.2027	Banken	650.000 USD	613.864	0,41
					2.384.471	1,59
Japan						
Mizuho Financial Group Incorporated	3,66	28.02.2027	Banken	935.000 USD	892.499	0,59
Luxemburg						
Grand City Properties SA ^±	1,50	11.03.2026	Immobilien	500.000 EUR	187.374	0,12
Holcim Finance Luxembourg SA	0,50	23.04.2031	Baustoffe	200.000 EUR	161.553	0,11
Prologis International Funding II SA	4,63	21.02.2035	Immobilien	700.000 EUR	706.843	0,47
SELP Finance Sarl	1,50	20.11.2025	REITs	700.000 EUR	684.444	0,46
SES SA ^±	2,88	27.05.2026	Telekommunikation	400.000 EUR	351.378	0,23
Swiss Re Finance Luxembourg SA ±	2,53	30.04.2050	Versicherung	600.000 EUR	537.745	0,36
					2.629.337	1,75
Niederlande						
ABN AMRO Bank NV	0,50	23.09.2029	Banken	1.000.000 EUR	867.320	0,58
Alcon Finance BV	2,38	31.05.2028	Gesundheitsprodukte	700.000 EUR	705.486	0,47
Coloplast Finance BV	2,25	19.05.2027	Gesundheitsprodukte	600.000 EUR	614.345	0,41

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

CLIMATE TRANSITION GLOBAL INVESTMENT GRADE CREDIT FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Sektor	Nennwert @	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>						
Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Fortsetzung)						
Niederlande (Fortsetzung)						
Cooperatieve Rabobank UA ±	0,38	01.12.2027	Banken	700.000 EUR	662.700	0,44
de Volksbank NV	4,88	07.03.2030	Banken	400.000 EUR	440.741	0,29
Deutsche Telekom International Finance BV	2,25	13.04.2029	Telekommunikation	300.000 GBP	320.214	0,21
Digital Intrepid Holding BV	0,63	15.07.2031	REITs	400.000 EUR	298.113	0,20
EnBW International Finance BV	1,88	31.10.2033	Strom	500.000 EUR	451.560	0,30
Enel Finance International NV	3,88	09.03.2029	Strom	500.000 EUR	543.493	0,36
ING Groep NV ±	1,13	07.12.2028	Banken	600.000 GBP	605.721	0,40
ING Groep NV ±	4,25	28.03.2033	Banken	850.000 USD	776.279	0,52
Koninklijke Philips NV	2,13	05.11.2029	Gesundheitsprodukte	500.000 EUR	487.433	0,33
NN Group NV ±	5,25	01.03.2043	Versicherung	600.000 EUR	614.962	0,41
PACCAR Financial Europe BV	3,25	29.11.2025	Automobilhersteller	300.000 EUR	323.658	0,22
Prosus NV	3,83	08.02.2051	Internet	125.000 USD	80.136	0,05
Shell International Finance BV	1,00	10.12.2030	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	400.000 GBP	378.285	0,25
Stellantis NV	1,25	20.06.2033	Automobilhersteller	500.000 EUR	406.151	0,27
Syngenta Finance NV	3,38	16.04.2026	Chemie	500.000 EUR	525.060	0,35
					9.101.657	6,06
Neuseeland						
Chorus Limited	3,63	07.09.2029	Telekommunikation	400.000 EUR	422.944	0,28
Norwegen						
Aker BP ASA	1,13	12.05.2029	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	700.000 EUR	628.546	0,42
DNB Bank ASA ±	1,38	02.12.2025	Banken	600.000 GBP	690.199	0,46
Equinor ASA	3,63	10.09.2028	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	840.000 USD	817.636	0,54
					2.136.381	1,42
Portugal						
Caixa Geral de Depositos SA ±	0,38	21.09.2027	Banken	500.000 EUR	469.639	0,31
Spanien						
Acciona Energia Financiacion Filiales SA	1,38	26.01.2032	Energie – Alternative Quellen	300.000 EUR	266.420	0,18
Banco Santander SA	3,49	28.05.2030	Banken	600.000 USD	523.893	0,35
Banco Santander SA ±	4,18	24.03.2028	Banken	600.000 USD	562.968	0,37
Bankinter SA	0,63	06.10.2027	Banken	600.000 EUR	556.682	0,37
CaixaBank SA	1,13	12.11.2026	Banken	400.000 EUR	390.771	0,26
CaixaBank SA ±	1,50	03.12.2026	Banken	500.000 GBP	542.013	0,36
Cellnex Finance Company SA	2,00	15.02.2033	Bau- & Ingenieurwesen	300.000 EUR	249.043	0,17
Iberdrola Finanzas SA ^±	4,88	25.04.2028	Strom	400.000 EUR	418.604	0,28
Telefonica Emisiones SA	4,10	08.03.2027	Telekommunikation	980.000 USD	948.157	0,63
					4.458.551	2,97
Schweden						
Akelius Residential Property AB ±	2,25	17.05.2081	Immobilien	300.000 EUR	261.408	0,17
Akelius Residential Property AB ±	3,88	05.10.2078	Immobilien	251.000 EUR	261.150	0,17
Essity AB	0,25	08.02.2031	Kosmetik/Körperpflege	400.000 EUR	326.453	0,22
Heimstaden Bostad AB	1,13	21.01.2026	Immobilien	500.000 EUR	455.858	0,30
Heimstaden Bostad AB ^±	3,63	13.10.2026	Immobilien	400.000 EUR	217.503	0,15
Molnlycke Holding AB	0,63	15.01.2031	Gesundheitsprodukte	300.000 EUR	248.921	0,17
Tele2 AB	2,13	15.05.2028	Telekommunikation	400.000 EUR	396.194	0,26
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	1,13	08.02.2027	Telekommunikation	500.000 EUR	473.615	0,32
					2.641.102	1,76

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

CLIMATE TRANSITION GLOBAL INVESTMENT GRADE CREDIT FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Sektor	Nennwert @	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>						
Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Fortsetzung)						
Schweiz						
Credit Suisse AG	3,63	09.09.2024	Banken	1.070.000 USD	1.018.126	0,68
Credit Suisse Group AG ±	9,02	15.11.2033	Banken	410.000 USD	485.809	0,32
UBS Group AG ±	2,75	11.02.2033	Banken	625.000 USD	500.798	0,33
UBS Group AG	4,13	24.09.2025	Banken	870.000 USD	831.954	0,56
Zuercher Kantonalbank ±	2,02	13.04.2028	Banken	900.000 EUR	887.913	0,59
					3.724.600	2,48
Vereinigtes Königreich						
Anglo American Capital plc	4,75	21.09.2032	Bergbau	500.000 EUR	544.762	0,36
AstraZeneca plc	1,38	06.08.2030	Pharmazie	60.000 USD	48.911	0,03
AstraZeneca plc	3,75	03.03.2032	Pharmazie	500.000 EUR	552.275	0,37
AXIS Specialty Finance plc	4,00	06.12.2027	Versicherung Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	830.000 USD	808.227	0,54
BP Capital Markets plc ^±	4,25	22.03.2027	Dienstleistungen	400.000 GBP	440.951	0,29
GlaxoSmithKline Capital plc	1,63	12.05.2035	Pharmazie	400.000 GBP	353.441	0,23
HSBC Holdings plc	4,30	08.03.2026	Banken	1.470.000 USD	1.421.782	0,95
Investec plc ±	9,13	06.03.2033	Banken	600.000 GBP	738.425	0,49
Lloyds Banking Group plc	2,25	16.10.2024	Banken	400.000 GBP	468.878	0,31
Motability Operations Group plc	2,38	03.07.2039	Gewerbliche Dienste	300.000 GBP	265.521	0,18
Nationwide Building Society	3,25	05.09.2029	Sparkassen & Kreditbanken	300.000 EUR	305.896	0,20
NatWest Group plc ±	2,88	19.09.2026	Banken	400.000 GBP	459.216	0,31
Reckitt Benckiser Treasury Services plc	2,75	26.06.2024	Haushaltsprodukte und -waren	1.215.000 USD	1.183.378	0,79
Rentokil Initial plc	0,50	14.10.2028	Gewerbliche Dienste	300.000 EUR	269.595	0,18
Santander UK Group Holdings plc ±	6,83	21.11.2026	Banken	900.000 USD	911.591	0,61
Tesco Corporate Treasury Services plc	0,88	29.05.2026	Diversifizierte Finanzdienstleister	400.000 EUR	394.024	0,26
Thames Water Utilities Finance plc	0,88	31.01.2028	Wasser	400.000 EUR	374.308	0,25
Tritax Big Box REIT plc	1,50	27.11.2033	REITs	400.000 GBP	330.565	0,22
Tritax EuroBox plc	0,95	02.06.2026	Immobilien	100.000 EUR	90.456	0,06
WPP Finance 2010	3,75	19.09.2024	Werbung	615.000 USD	600.265	0,40
					10.562.467	7,03
Vereinigte Staaten						
AbbVie Incorporated	2,60	21.11.2024	Pharmazie	1.120.000 USD	1.080.922	0,72
AbbVie Incorporated	4,25	21.11.2049	Pharmazie	815.000 USD	719.218	0,48
Air Products and Chemicals Incorporated	4,00	03.03.2035	Chemie	300.000 EUR	326.619	0,22
Alexandria Real Estate Equities Incorporated	2,00	18.05.2032	REITs	980.000 USD	754.025	0,50
American International Group Incorporated	4,38	30.06.2050	Versicherung	800.000 USD	683.191	0,45
American International Group Incorporated	4,75	01.04.2048	Versicherung	1.110.000 USD	996.258	0,66
American Water Capital Corporation	3,45	01.05.2050	Wasser	610.000 USD	463.911	0,31
Amgen Incorporated	5,15	02.03.2028	Biotechnologie	400.000 USD	408.408	0,27
Amgen Incorporated	5,65	02.03.2053	Biotechnologie	420.000 USD	437.094	0,29
Amgen Incorporated	5,75	02.03.2063	Biotechnologie	420.000 USD	435.807	0,29
Apple Incorporated	3,60	31.07.2042	Computer	100.000 GBP	109.049	0,07
AT&T Incorporated	3,65	01.06.2051	Telekommunikation	785.000 USD	594.586	0,40
AT&T Incorporated	4,25	01.03.2027	Telekommunikation	735.000 USD	729.130	0,49
Athene Holding Limited	3,50	15.01.2031	Versicherung	895.000 USD	743.853	0,50
Avangrid Incorporated	3,80	01.06.2029	Strom	840.000 USD	788.376	0,52
Bank of America Corporation ±	2,83	24.10.2051	Banken	1.055.000 USD	687.898	0,46
Bank of America Corporation ±	2,97	04.02.2033	Banken	1.865.000 USD	1.570.407	1,05
Belrose Funding Trust	2,33	15.08.2030	Versicherung	850.000 USD	660.718	0,44

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

CLIMATE TRANSITION GLOBAL INVESTMENT GRADE CREDIT FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Sektor	Nennwert @	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>						
Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Fortsetzung)						
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)						
Best Buy Company Incorporated	1,95	01.10.2030	Einzelhandel	495.000 USD	402.629	0,27
BP Capital Markets America Incorporated	2,94	04.06.2051	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	1.005.000 USD	696.858	0,46
Bristol-Myers Squibb Company	2,55	13.11.2050	Pharmazie	660.000 USD	441.574	0,29
Centene Corporation	2,45	15.07.2028	Gesundheitsdienstleistungen	625.000 USD	543.750	0,36
Charter Communications Operating LLC	3,75	15.02.2028	Medien	860.000 USD	798.580	0,53
Charter Communications Operating LLC	3,90	01.06.2052	Medien	960.000 USD	634.585	0,42
Cigna Corporation	2,38	15.03.2031	Pharmazie	940.000 USD	793.013	0,53
Citigroup Incorporated ±	1,68	15.05.2024	Banken	495.000 USD	492.966	0,33
Citigroup Incorporated ±	2,56	01.05.2032	Banken	200.000 USD	165.931	0,11
Citigroup Incorporated	3,30	27.04.2025	Banken	1.325.000 USD	1.278.550	0,85
Comcast Corporation	2,94	01.11.2056	Medien	415.000 USD	276.246	0,18
Comcast Corporation	3,38	15.08.2025	Medien	340.000 USD	332.109	0,22
Comcast Corporation	3,40	01.04.2030	Medien Diversifizierte	320.000 USD	299.179	0,20
Computershare US Incorporated	1,13	07.10.2031	Finanzdienstleister	600.000 EUR	497.651	0,33
Consolidated Edison Company of New York, Inc.	3,95	01.04.2050	Strom	625.000 USD	517.134	0,34
CVS Health Corporation	4,25	01.04.2050	Pharmazie	790.000 USD	660.111	0,44
CVS Health Corporation	4,30	25.03.2028	Pharmazie	138.000 USD	135.522	0,09
Dell International LLC	5,45	15.06.2023	Computer	263.000 USD	262.897	0,18
Dell International LLC	6,20	15.07.2030	Computer	740.000 USD	771.718	0,51
Empower Finance 2020 LP	1,78	17.03.2031	Versicherung	995.000 USD	798.422	0,53
Equifax Incorporated	2,35	15.09.2031	Gewerbliche Dienste	615.000 USD	494.995	0,33
Equifax Incorporated	2,60	01.12.2024	Gewerbliche Dienste	720.000 USD	687.728	0,46
Equifax Incorporated	3,10	15.05.2030	Gewerbliche Dienste	890.000 USD	773.786	0,51
Equinix Incorporated	2,15	15.07.2030	REITs	965.000 USD	789.037	0,53
ERP Operating LP	1,85	01.08.2031	REITs	795.000 USD	637.333	0,42
Fiserv Incorporated	3,50	01.07.2029	Software	1.035.000 USD	960.672	0,64
FS KKR Capital Corporation	3,40	15.01.2026	Anlagegesellschaften	905.000 USD	812.122	0,54
General Motors Company	6,13	01.10.2025	Automobilhersteller	775.000 USD	789.633	0,53
Goldman Sachs Group Incorporated ±	3,10	24.02.2033	Banken	915.000 USD	785.775	0,52
HCA Incorporated	3,63	15.03.2032	Gesundheitsdienstleistungen	585.000 USD	515.695	0,34
HCA Incorporated	4,38	15.03.2042	Gesundheitsdienstleistungen	585.000 USD	491.694	0,33
Hershey Company	2,65	01.06.2050	Lebensmittel	1.000.000 USD	703.309	0,47
Home Depot Incorporated	3,35	15.04.2050	Einzelhandel	345.000 USD	266.988	0,18
Hyatt Hotels Corporation	1,80	01.10.2024	Hotels	1.220.000 USD	1.155.028	0,77
Hyundai Capital America	1,80	15.10.2025	Automobilhersteller	980.000 USD	898.993	0,60
Hyundai Capital America	1,80	10.01.2028	Automobilhersteller	945.000 USD	801.448	0,53
Intel Corporation	2,80	12.08.2041	Halbleiter Diversifizierte	1.060.000 USD	768.727	0,51
Intercontinental Exchange Incorporated	2,10	15.06.2030	Finanzdienstleister Diversifizierte	695.000 USD	584.428	0,39
Intercontinental Exchange Incorporated	3,75	01.12.2025	Finanzdienstleister	1.845.000 USD	1.789.384	1,19
International Flavors & Fragrances Incorporated	2,30	01.11.2030	Chemie	990.000 USD	794.470	0,53
ITC Holdings Corporation	2,95	14.05.2030	Strom	905.000 USD	797.048	0,53
Jabil Incorporated	3,60	15.01.2030	Elektronik	875.000 USD	790.060	0,53
JPMorgan Chase & Company ±	2,58	22.04.2032	Banken	920.000 USD	774.320	0,52
JPMorgan Chase & Company ±	3,78	01.02.2028	Banken	605.000 USD	578.473	0,39
Kinder Morgan Energy Partners LP	5,40	01.09.2044	Pipelines	585.000 USD	541.813	0,36

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

CLIMATE TRANSITION GLOBAL INVESTMENT GRADE CREDIT FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Sektor	Nennwert @	Markt- wert USD	% des Netto- vermöger
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>						
Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Fortsetzung)						
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)						
Kinder Morgan Incorporated	2,00	15.02.2031	Pipelines	745.000 USD	601.387	0,40
Lowe's Companies Incorporated	4,25	01.04.2052	Einzelhandel	320.000 USD	262.590	0,17
Marvell Technology Incorporated	4,88	22.06.2028	Halbleiter	85.000 USD	83.471	0,06
McDonald's Corporation	1,45	01.09.2025	Einzelhandel	870.000 USD	810.066	0,54
McDonald's Corporation	2,38	31.05.2029	Einzelhandel	300.000 EUR	301.886	0,20
Merck & Company Incorporated	2,15	10.12.2031	Pharmazie	880.000 USD	744.998	0,50
Microchip Technology Incorporated	2,67	01.09.2023	Halbleiter	535.000 USD	527.495	0,35
MidAmerican Energy Company	3,15	15.04.2050	Strom	685.000 USD	502.170	0,33
Morgan Stanley	3,13	27.07.2026	Banken	1.190.000 USD	1.126.974	0,75
Morgan Stanley	3,70	23.10.2024	Banken	2.145.000 USD	2.100.315	1,40
Motorola Solutions Incorporated	4,60	23.02.2028	Telekommunikation	1.315.000 USD	1.297.657	0,86
Nordstrom Incorporated	5,00	15.01.2044	Einzelhandel	730.000 USD	459.075	0,31
			Diversifizierte			
Nuveen LLC	4,00	01.11.2028	Finanzdienstleister	760.000 USD	730.144	0,49
ONEOK Incorporated	6,10	15.11.2032	Pipelines	355.000 USD	367.512	0,24
Oracle Corporation	2,88	25.03.2031	Software	565.000 USD	483.472	0,32
Oracle Corporation	3,95	25.03.2051	Software	555.000 USD	417.625	0,28
Oracle Corporation	5,55	06.02.2053	Software	205.000 USD	195.168	0,13
Owl Rock Capital Corporation	5,25	15.04.2024	Anlagegesellschaften	830.000 USD	807.595	0,54
Public Service Company of Colorado	3,70	15.06.2028	Strom	270.000 USD	260.952	0,17
S&P Global Incorporated	2,30	15.08.2060	Gewerbliche Dienste	660.000 USD	381.852	0,25
S&P Global Incorporated	2,70	01.03.2029	Gewerbliche Dienste	850.000 USD	773.297	0,51
Sabine Pass Liquefaction LLC	4,50	15.05.2030	Pipelines	620.000 USD	598.067	0,40
Sabine Pass Liquefaction LLC	5,75	15.05.2024	Pipelines	635.000 USD	636.508	0,42
Sabra Health Care LP	3,20	01.12.2031	REITs	310.000 USD	227.374	0,15
Santander Holdings USA Incorporated	4,40	13.07.2027	Banken	830.000 USD	777.055	0,52
Simon Property Group LP	1,75	01.02.2028	REITs	570.000 USD	490.305	0,33
Simon Property Group LP	3,25	13.09.2049	REITs	960.000 USD	653.326	0,43
Smithfield Foods Incorporated	3,00	15.10.2030	Lebensmittel	705.000 USD	562.513	0,37
State Street Corporation	2,40	24.01.2030	Banken	545.000 USD	471.994	0,31
TJX Companies Incorporated	1,60	15.05.2031	Einzelhandel	590.000 USD	480.494	0,32
T-Mobile USA Incorporated	3,30	15.02.2051	Telekommunikation	500.000 USD	355.527	0,24
T-Mobile USA Incorporated	3,75	15.04.2027	Telekommunikation	830.000 USD	797.857	0,53
Union Pacific Corporation	2,40	05.02.2030	Transport	820.000 USD	721.222	0,48
UnitedHealth Group Incorporated	4,20	15.05.2032	Gesundheitsdienstleistungen	1.000.000 USD	980.124	0,65
UnitedHealth Group Incorporated	5,88	15.02.2053	Gesundheitsdienstleistungen	870.000 USD	977.875	0,65
UnitedHealth Group Incorporated	6,05	15.02.2063	Gesundheitsdienstleistungen	400.000 USD	455.417	0,30
Unum Group	4,50	15.12.2049	Versicherung	905.000 USD	662.987	0,44
US Bancorp ±	4,65	01.02.2029	Banken	1.000.000 USD	977.469	0,65
Verizon Communications Incorporated	2,88	15.01.2038	Telekommunikation	500.000 EUR	466.442	0,31
Verizon Communications Incorporated	3,55	22.03.2051	Telekommunikation	370.000 USD	282.295	0,19
Verizon Communications Incorporated	4,13	15.08.2046	Telekommunikation	1.235.000 USD	1.054.709	0,70
Vornado Realty LP	3,40	01.06.2031	REITs	55.000 USD	38.047	0,03
Warnermedia Holdings Incorporated	5,05	15.03.2042	Unterhaltung	340.000 USD	284.388	0,19
Warnermedia Holdings Incorporated	5,14	15.03.2052	Unterhaltung	1.445.000 USD	1.170.787	0,78
Western Digital Corporation	3,10	01.02.2032	Computer	900.000 USD	678.317	0,45
			Diversifizierte			
Western Union Company	2,85	10.01.2025	Finanzdienstleister	1.035.000 USD	987.812	0,66
			Diversifizierte			
Western Union Company	4,25	09.06.2023	Finanzdienstleister	960.000 USD	954.917	0,64
Williams Companies Incorporated	2,60	15.03.2031	Pipelines	710.000 USD	597.108	0,40
Williams Companies Incorporated	4,85	01.03.2048	Pipelines	620.000 USD	547.413	0,36
					73.095.904	48,64
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel					135.051.910	89,87

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

CLIMATE TRANSITION GLOBAL INVESTMENT GRADE CREDIT FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Nennwert @	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>					
Staatsanleihen					
Vereinigte Staaten					
United States Treasury Bond	2,00	15.11.2041	1.410.000 USD	1.064.164	0,71
United States Treasury Bond	2,25	15.02.2052	415.000 USD	309.467	0,21
United States Treasury Bond	2,88	15.05.2052	1.835.000 USD	1.569.785	1,04
United States Treasury Bond	3,00	15.08.2052	635.000 USD	557.808	0,37
United States Treasury Note	0,25	30.09.2025	30.000 USD	27.454	0,02
United States Treasury Note	0,88	30.09.2026	225.000 USD	203.766	0,13
United States Treasury Note	1,88	28.02.2027	765.000 USD	713.811	0,47
United States Treasury Note	1,88	15.02.2032	320.000 USD	280.850	0,19
United States Treasury Note	2,25	31.03.2024	660.000 USD	644.763	0,43
United States Treasury Note	2,75	15.08.2032	345.000 USD	324.677	0,22
United States Treasury Note	3,13	31.08.2027	135.000 USD	132.047	0,09
United States Treasury Note	3,50	15.02.2033	825.000 USD	826.289	0,55
United States Treasury Note	4,13	15.11.2032	1.600.000 USD	1.681.250	1,12
Summe Staatsanleihen				8.336.131	5,55
Kommunalanleihen					
Vereinigte Staaten					
New Jersey Transportation Trust Fund Authority	4,13	15.06.2042	130.000 USD	114.758	0,08
Summe Kommunalanleihen				114.758	0,08
Summe Wertpapieranlagen				143.502.799	95,50
Bankguthaben					
Termineinlage					
Kanada					
Bank of Nova Scotia (o)	3,33		578 CAD	427	0,00
Bank of Nova Scotia (o)	4,18		2.490.513 USD	2.490.513	1,66
Frankreich					
HSBC Bank plc (o)	1,93		478.268 EUR	518.682	0,35
Vereinigtes Königreich					
Sumitomo Mitsui Banking Corporation (o)	3,17		13.702 GBP	16.903	0,01
Summe Termineinlagen				3.026.525	2,02
Kontokorrentkonten				1.870.373	1,24
Summe Bankguthaben				4.896.898	3,26
<i>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, netto</i>				1.865.397	1,24
Gesamtes Fondsvermögen				150.265.094	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

CLIMATE TRANSITION GLOBAL INVESTMENT GRADE CREDIT FUND

± Variabel verzinsliche Anlage. Der aufgeführte Zins entspricht dem effektiven Zinssatz zum Ende des Berichtszeitraums.

^ Die Anlage erfolgt unbefristet und hat daher kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das angegebene Datum spiegelt den nächsten Call-Termin wider.

@ Nennwert lautet auf angegebene Währung.

(o) Tagesgelder.

Abkürzung:	CAD	Kanadischer Dollar
	EUR	Euro
	GBP	Britisches Pfund
	REITs	Real Estate Investment Trust (REITs)
	USD	US-Dollar

Die Wertpapiere wurden auf Grundlage des Landes der Unternehmensgründung/-ansässigkeit aufgelistet.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

EMERGING MARKETS EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien				
Brasilien				
Atacadao SA	Einzelhandel	651.000	1.591.392	0,48
B3 SA – Brasil Bolsa Balcao	Diversifizierte Finanzdienstleister	1.703.800	3.479.235	1,06
Banco Bradesco SA ADR	Banken	531.048	1.391.346	0,42
BRF SA ADR	Lebensmittel	516.150	660.672	0,20
Compania Brasileira de Aluminio	Bergbau	478.500	715.609	0,22
Diagnosticos da America SA	Gesundheitsdienstleistungen	277.321	408.722	0,12
Hapvida Participacoes e Investimentos SA	Gesundheitsdienstleistungen	2.724.830	1.408.528	0,43
Lojas Renner SA	Einzelhandel	668.288	2.184.797	0,67
Magazine Luiza SA	Einzelhandel	1.840.600	1.202.022	0,37
MercadoLibre Incorporated	Internet	2.056	2.709.931	0,83
Multiplan Empreendimentos Imobiliarios SA	Immobilien	148.506	721.954	0,22
Raia Drogasil SA	Einzelhandel	170.500	822.485	0,25
			17.296.693	5,27
Chile				
Banco Santander Chile ADR	Banken	116.664	2.080.119	0,63
Falabella SA	Einzelhandel	1.712.748	3.938.788	1,20
			6.018.907	1,83
China				
Agora Incorporated ADR	Software	141.039	510.561	0,16
Alibaba Group Holding Limited	Internet	284.000	3.597.001	1,10
Alibaba Group Holding Limited ADR	Internet	64.918	6.633.321	2,02
Bilibili Incorporated ADR	Software	182.048	4.278.128	1,30
China Literature Limited	Internet	363.879	1.879.103	0,57
China Meidong Auto Holdings Limited	Einzelhandel	1.022.000	2.204.341	0,67
FinVolution Group ADR	Diversifizierte Finanzdienstleister	375.173	1.564.471	0,48
GreenTree Hospitality Group Limited ADR	Hotels	238.751	1.062.442	0,32
Hua Medicine	Pharmazie	642.611	296.534	0,09
Li Ning Company Limited	Einzelhandel	872.327	6.859.905	2,09
Meituan	Internet	409.660	7.432.140	2,27
Shandong Weigao Group Medical Polymer Company Limited	Gesundheitsprodukte	2.912.000	4.653.133	1,42
Tencent Holdings Limited	Internet	338.600	16.547.153	5,04
Tencent Music Entertainment Group ADR	Internet	390.678	3.234.814	0,99
Trip.com Group Limited ADR	Internet	82.294	3.100.015	0,94
Tsingtao Brewery Company Limited	Getränke	421.520	4.607.310	1,40
Vipshop Holdings Limited ADR	Internet	290.456	4.409.122	1,34
Weibo Corporation ADR	Internet	169.394	3.398.044	1,04
Xiaomi Corporation	Telekommunikation	2.031.200	3.125.917	0,95
Zepp Health Corporation ADR	Möbel & Innenausstattung	173.233	226.935	0,07
Zhou Hei Ya International Holdings Company Limited	Lebensmittel	2.222.437	1.051.346	0,32
			80.671.736	24,58
Hongkong				
AIA Group Limited	Versicherung	760.000	7.970.392	2,43
Sun Art Retail Group Limited	Einzelhandel	6.647.500	2.665.404	0,81
Want Want China Holdings Limited	Lebensmittel	6.193.000	3.984.508	1,22
WH Group Limited	Lebensmittel	11.692.506	6.970.452	2,12
			21.590.756	6,58

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

EMERGING MARKETS EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Indien				
Axis Bank Limited	Banken	287.248	3.009.430	0,92
Bajaj Finance Limited	Diversifizierte Finanzdienstleister	28.752	1.972.809	0,60
Bharti Airtel Limited	Telekommunikation	531.576	4.847.710	1,48
Dalmia Bharat Limited	Baustoffe	50.724	1.218.380	0,37
Fortis Healthcare Limited	Gesundheitsdienstleistungen	413.989	1.310.928	0,40
HDFC Bank Limited ADR	Banken	99.622	6.641.799	2,02
Housing Development Finance Corporation Limited	Diversifizierte Finanzdienstleister	93.400	2.995.158	0,91
Indus Towers Limited	Telekommunikation	650.000	1.133.154	0,34
Kotak Mahindra Bank Limited	Banken	87.921	1.858.374	0,57
Reliance Industries Limited	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	370.800	10.543.546	3,21
Reliance Industries Limited GDR	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	30.000	1.692.563	0,52
SBI Life Insurance Company Limited	Versicherung	88.076	1.181.613	0,36
			38.405.464	11,70
Indonesien				
PT Bank Central Asia Tbk	Banken	5.470.000	3.200.191	0,98
PT Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk	Banken	5.000.000	1.584.264	0,48
PT Telkom Indonesia Persero Tbk ADR	Telekommunikation	205.860	5.613.802	1,71
			10.398.257	3,17
Mexiko				
America Movil SAB de CV ADR	Telekommunikation	302.756	6.373.014	1,94
Becle SAB de CV	Getränke	1.249.314	3.250.851	0,99
Cemex SAB de CV ADR	Baustoffe	365.129	2.019.163	0,62
Fibra Uno Administracion SA de CV	REITs	4.675.832	6.546.684	1,99
Fomento Economico Mexicano SAB de CV ADR	Getränke	113.328	10.787.692	3,29
Grupo Financiero Banorte SAB de CV	Banken	207.344	1.745.740	0,53
Wal-Mart de Mexico SAB de CV	Einzelhandel	350.700	1.401.243	0,43
			32.124.387	9,79
Philippinen				
ACEN Corporation	Strom	412.956	46.744	0,01
Ayala Corporation	Immobilien	137.652	1.654.168	0,50
San Miguel Food & Beverage Incorporated	Lebensmittel	446.309	394.518	0,12
SM Investments Corporation	Lebensmittel	126.900	2.082.974	0,64
			4.178.404	1,27
Polen				
InPost SA	Transport	222.000	2.030.274	0,62
Russland				
Fix Price Group plc GDR * ▲ >	Einzelhandel	39.803	0	0,00
LUKOIL PJSC * ▲ >	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	32.612	0	0,00
Sberbank of Russia PJSC * ▲ >	Banken	636.488	0	0,00
Yandex NV * ▲ >	Internet	98.100	0	0,00
			0	0,00
Südafrika				
MTN Group Limited	Telekommunikation	394.586	2.826.992	0,86
Shoprite Holdings Limited	Lebensmittel	312.100	3.894.826	1,19
Standard Bank Group Limited	Banken	187.208	1.815.137	0,55

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

EMERGING MARKETS EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Südafrika (Fortsetzung)				
Tiger Brands Limited	Lebensmittel	141.980	1.598.980	0,49
			<u>10.135.935</u>	<u>3,09</u>
Südkorea				
KT Corporation ADR	Telekommunikation	381.526	4.326.505	1,32
LG Chem Limited	Chemie	4.436	2.436.225	0,74
Naver Corporation	Internet	20.650	3.235.670	0,99
Samsung Electronics Company Limited	Halbleiter	398.950	19.728.461	6,01
Samsung Life Insurance Company Limited	Versicherung	61.471	2.964.365	0,90
SK Hynix Incorporated	Halbleiter	46.300	3.168.538	0,97
SK Telecom Company Limited	Telekommunikation	92.000	3.413.395	1,04
SK Telecom Company Limited ADR	Telekommunikation	35.000	717.850	0,22
			<u>39.991.009</u>	<u>12,19</u>
Taiwan				
MediaTek Incorporated	Halbleiter	169.880	4.404.330	1,34
President Chain Store Corporation	Einzelhandel	272.000	2.410.604	0,74
Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited ADR	Halbleiter	285.560	26.562.791	8,10
Uni-President Enterprises Corporation	Lebensmittel	3.475.071	8.215.028	2,50
			<u>41.592.753</u>	<u>12,68</u>
Thailand				
PTT Exploration & Production PCL	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	226.957	1.000.082	0,31
PTT PCL	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	2.834.300	2.628.086	0,80
SCB X PCL	Banken	797.700	2.391.117	0,73
Thai Beverage PCL	Getränke	7.705.850	3.653.766	1,11
			<u>9.673.051</u>	<u>2,95</u>
Summe Stammaktien			<u>314.107.626</u>	<u>95,72</u>
Summe Wertpapieranlagen			<u>314.107.626</u>	<u>95,72</u>
	Verzinsung in %	Nennwert in USD		
Bankguthaben				
Termineinlage				
Vereinigte Staaten				
Citibank (o)	4,18	12.779.109	12.779.109	3,89
Kontokorrentkonten				
			<u>2.064.953</u>	<u>0,63</u>
Summe Bankguthaben			<u>14.844.062</u>	<u>4,52</u>
<i>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, netto</i>			<i>(785.154)</i>	<i>(0,24)</i>
Gesamtes Fondsvermögen			<u>328.166.534</u>	<u>100,00</u>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

EMERGING MARKETS EQUITY FUND

* Das Wertpapier wurde nach dem vom Verwaltungsrat genehmigten Verfahren zum beizulegenden Zeitwert bewertet.

♣ Wertpapier ohne Ertrag.

> Wertpapier mit beschränkter Handelbarkeit. Der Teilfonds hielt beschränkt handelbare Wertpapiere mit einem aktuellen Gesamtwert von 0 USD (ursprüngliche Gesamtkosten von 7.920.208 USD), was 0 % seines Nettovermögens zum Ende des Berichtszeitraums entspricht.

(o) Tagesgelder.

Abkürzung:	ADR	American Depository Receipt
	GDR	Global Depository Receipt
	REITs	Real Estate Investment Trust (REITs)
	USD	US-Dollar

Die Wertpapiere wurden auf Grundlage des Landes der Unternehmensgründung/-ansässigkeit aufgelistet.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

EMERGING MARKETS EQUITY INCOME FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien				
Brasilien				
Ambev SA	Getränke	282.700	799.276	0,75
B3 SA – Brasil Bolsa Balcao	Diversifizierte Finanzdienstleister	268.500	548.289	0,52
Banco BTG Pactual SA	Diversifizierte Finanzdienstleister	158.940	616.199	0,58
Companhia Brasileira de Aluminio	Bergbau	364.700	545.418	0,52
Embraer SA ADR	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	53.441	874.829	0,83
Petroleo Brasileiro SA ADR	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	54.054	501.621	0,47
			<u>3.885.632</u>	<u>3,67</u>
Chile				
Cencosud SA	Lebensmittel	467.180	902.752	0,85
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR	Chemie	5.238	424.592	0,40
			<u>1.327.344</u>	<u>1,25</u>
China				
360 DigiTech Incorporated ADR	Diversifizierte Finanzdienstleister	68.888	1.336.427	1,26
Alibaba Group Holding Limited	Internet	450.500	5.705.806	5,39
Baoshan Iron & Steel Company Limited	Eisen/Stahl	1.428.376	1.296.760	1,22
China Communications Services Corporation Limited	Bau- & Ingenieurwesen	2.172.000	1.068.770	1,01
China Construction Bank Corporation	Banken	1.669.000	1.080.168	1,02
China Feihe Limited	Pharmazie	749.000	561.343	0,53
China International Capital Corporation Limited	Diversifizierte Finanzdienstleister	609.600	1.223.062	1,15
China Vanke Company Limited	Immobilien	477.900	754.101	0,71
China Yongda Automobiles Services Holdings Limited	Einzelhandel	744.500	528.898	0,50
Country Garden Services Holdings Company Limited	Immobilien	339.000	584.467	0,55
CSPC Pharmaceutical Group Limited	Pharmazie	842.000	825.427	0,78
ENN Energy Holdings Limited	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	73.100	1.000.957	0,95
Ganfeng Lithium Group Company Limited	Chemie	71.200	443.674	0,42
Hengli Petrochemical Company Limited	Chemie	418.500	987.257	0,93
Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited	Lebensmittel	199.980	845.801	0,80
JD.com Incorporated	Internet	95.400	2.083.173	1,97
Midea Group Company Limited	Möbel & Innenausstattung	266.201	2.082.595	1,97
Ping An Insurance Group Company of China Limited	Versicherung	246.000	1.591.427	1,50
Postal Savings Bank of China Company Limited	Banken	1.248.000	740.134	0,70
Sinopharm Group Company Limited	Pharmazie	317.200	958.505	0,91
Tingyi Cayman Islands Holding Corporation	Lebensmittel	324.000	542.200	0,51
Yum China Holdings Incorporated	Einzelhandel	13.150	823.549	0,78
Zhejiang NHU Company Limited	Pharmazie	187.920	490.743	0,46
Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Company Limited	Maschinen – Bau- und Bergbau	855.200	452.298	0,43
			<u>28.007.542</u>	<u>26,45</u>
Kolumbien				
Ecopetrol SA ADR	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	74.597	787.744	0,74
Griechenland				
National Bank of Greece SA	Banken	85.656	417.060	0,39

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

EMERGING MARKETS EQUITY INCOME FUND

	Sektor	Aktien	Marktwert USD	% des Nettovermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Hongkong				
ASMPT Limited	Halbleiter	66.800	662.522	0,63
China Resources Land Limited	Immobilien	224.000	1.020.059	0,96
China State Construction International Holdings Limited	Bau- & Ingenieurwesen	914.000	1.034.034	0,98
Chow Tai Fook Jewellery Group Limited	Einzelhandel	588.600	1.169.605	1,10
Hong Kong Exchanges & Clearing Limited	Diversifizierte Finanzdienstleister	36.800	1.631.150	1,54
			<u>5.517.370</u>	<u>5,21</u>
Indien				
Bajaj Auto Limited	Freizeit	26.957	1.275.191	1,20
Embassy Office Parks REIT	REITs	270.328	1.027.190	0,97
GAIL India Limited	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	1.094.215	1.404.266	1,33
Indus Towers Limited	Telekommunikation	411.486	717.350	0,68
Infosys Limited ADR	Computer	115.484	2.014.041	1,90
LIC Housing Finance Limited	Diversifizierte Finanzdienstleister	290.732	1.166.373	1,10
Mahanagar Gas Limited	Strom	114.910	1.376.857	1,30
NHPC Limited	Strom	1.072.977	526.380	0,50
Power Grid Corporation of India Limited	Strom	478.837	1.318.277	1,24
Tech Mahindra Limited	Software	52.736	710.916	0,67
			<u>11.536.841</u>	<u>10,89</u>
Indonesien				
PT Bank Mandiri Persero Tbk	Banken	735.400	506.430	0,48
PT Bank Negara Indonesia Persero Tbk	Banken	1.721.382	1.077.138	1,01
PT Telkom Indonesia Persero Tbk	Telekommunikation	1.784.000	484.433	0,46
			<u>2.068.001</u>	<u>1,95</u>
Italien				
PRADA SpA	Bekleidung	117.000	829.655	0,78
Malaysia				
Petronas Chemicals Group Bhd	Chemie	262.800	422.317	0,40
RHB Bank Bhd	Banken	388.862	492.009	0,46
			<u>914.326</u>	<u>0,86</u>
Mexiko				
America Movil SAB de CV ADR	Telekommunikation	25.686	540.690	0,51
Grupo Bimbo SAB de CV	Lebensmittel	138.300	695.184	0,66
Grupo Financiero Banorte SAB de CV	Banken	65.600	552.321	0,52
Wal-Mart de Mexico SAB de CV	Einzelhandel	191.572	765.438	0,72
			<u>2.553.633</u>	<u>2,41</u>
Panama				
Copa Holdings SA	Fluggesellschaften	6.256	577.742	0,55
Peru				
Credicorp Limited	Banken	3.659	484.415	0,46
Philippinen				
Bank of the Philippine Islands	Banken	318.329	601.851	0,57
Polen				
Bank Polska Kasa Opieki SA	Banken	36.008	716.317	0,68

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

EMERGING MARKETS EQUITY INCOME FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Katar				
Industries Qatar QSC	Chemie	123.381	442.123	0,42
Russland				
Alrosa PJSC * ▲ >	Bergbau	638.450	0	0,00
Magnit PJSC * ▲ >	Lebensmittel	15.789	0	0,00
			0	0,00
Saudi-Arabien				
Alinma Bank	Banken	67.263	530.407	0,50
Arabian Drilling Company	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	15.751	641.168	0,61
Saudi Telecom Company	Telekommunikation	51.096	546.523	0,52
United Electronics Company	Einzelhandel	21.565	447.317	0,42
			2.165.415	2,05
Singapur				
BOC Aviation Limited	Diversifizierte Finanzdienstleister	99.900	774.705	0,73
Südafrika				
Absa Group Limited	Banken	51.360	524.965	0,49
Bidvest Group Limited	Gewerbliche Dienste	71.861	1.022.803	0,97
Gold Fields Limited ADR	Bergbau	55.505	739.327	0,70
Sanlam Limited	Diversifizierte Finanzdienstleister	257.739	815.993	0,77
Standard Bank Group Limited	Banken	53.067	514.529	0,49
			3.617.617	3,42
Südkorea				
Doosan Bobcat Incorporated	Maschinen – Bau- und Bergbau	25.133	845.308	0,80
Hana Financial Group Incorporated	Banken	23.342	731.048	0,69
KB Financial Group Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	18.746	684.645	0,64
Kia Corporation	Automobilhersteller	26.821	1.673.847	1,58
Samsung Electronics Company Limited	Halbleiter	59.741	2.954.250	2,79
SK Telecom Company Limited	Telekommunikation	27.374	1.015.633	0,96
			7.904.731	7,46
Taiwan				
Advantech Company Limited	Computer	86.000	1.052.109	0,99
Cathay Financial Holding Company Limited	Versicherung	778.000	1.071.188	1,01
Chroma ATE Incorporated	Elektronik	106.000	619.781	0,59
E Ink Holdings Incorporated	Elektronik	131.000	799.578	0,75
Formosa Plastics Corporation	Chemie	174.000	525.307	0,50
Hon Hai Precision Industry Company Limited	Elektronik	154.600	529.195	0,50
MediaTek Incorporated	Halbleiter	47.000	1.218.528	1,15
Poya International Company Limited	Einzelhandel	33.000	619.986	0,59
Realtek Semiconductor Corporation	Halbleiter	72.000	919.035	0,87
Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	Halbleiter	449.000	7.868.555	7,43
Vanguard International Semiconductor Corporation	Halbleiter	273.000	873.329	0,82
			16.096.591	15,20

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

EMERGING MARKETS EQUITY INCOME FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Thailand				
Bangkok Bank PCL	Banken	346.400	1.536.288	1,45
Thai Beverage PCL	Getränke	1.717.000	814.124	0,77
Tisco Financial Group PCL	Diversifizierte Finanzdienstleister	174.300	512.272	0,48
			2.862.684	2,70
Vereinigte Arabische Emirate				
Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	Banken	181.460	410.660	0,39
Aldar Properties PJSC	Immobilien	340.016	431.196	0,41
			841.856	0,80
Vereinigtes Königreich				
Anglo American plc	Bergbau	14.279	474.941	0,45
Vereinigte Staaten				
Southern Copper Corporation	Bergbau	17.207	1.312.034	1,24
Summe Stammaktien			96.718.170	91,33
	Dividenden- rendite %			
Vorzugsaktien				
Brasilien				
Itau Unibanco Holding SA	4,88 Banken	177.800	867.873	0,82
Südkorea				
LG Chem Limited	2,27 Chemie	6.589	1.578.761	1,49
Samsung Electronics Company Limited	1,95 Halbleiter	62.367	2.595.378	2,45
			4.174.139	3,94
Summe Vorzugsaktien			5.042.012	4,76
Summe Wertpapieranlagen			101.760.182	96,09

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

EMERGING MARKETS EQUITY INCOME FUND

	Verzinsung in %	Nennwert @	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
Bankguthaben				
Termineinlagen				
Frankreich				
Société Générale Bank (o)	0,60	140.220 HKD	17.863	0,02
Vereinigtes Königreich				
Sumitomo Mitsui Banking Corporation (o)	3,17	6 GBP	7	0,00
Vereinigte Staaten				
China Construction Bank Corporation (o)	4,18	2.923.375 USD	2.923.375	2,76
Summe Termineinlagen			2.941.245	2,78
Kontokorrentkonten			1.070.498	1,01
Summe Bankguthaben			4.011.743	3,79
<i>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, netto</i>			<i>128.060</i>	<i>0,12</i>
Gesamtes Fondsvermögen			105.899.985	100,00

* Das Wertpapier wurde nach dem vom Verwaltungsrat genehmigten Verfahren zum beizulegenden Zeitwert bewertet.

▲ Wertpapier ohne Ertrag.

> Wertpapier mit beschränkter Handelbarkeit. Der Teilfonds hielt beschränkt handelbare Wertpapiere mit einem aktuellen Gesamtwert von 0 USD (ursprüngliche Gesamtkosten von 2.109.036 USD), was 0 % seines Nettovermögens zum Ende des Berichtszeitraums entspricht.

@ Nennwert lautet auf angegebene Währung.

(o) Tagesgelder.

Abkürzung:	ADR	American Depository Receipt
	GBP	Britisches Pfund
	HKD	Hongkong-Dollar
	REITs	Real Estate Investment Trust (REITs)
	USD	US-Dollar

Die Wertpapiere wurden auf Grundlage des Landes der Unternehmensgründung/-ansässigkeit aufgelistet.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

EUR INVESTMENT GRADE CREDIT FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Sektor	Nennwert @	Markt- wert EUR	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>						
Unternehmensanleihen und Schuldtitel						
Australien						
APA Infrastructure Limited Australia & New Zealand Banking Group Limited ±	2,00	15.07.2030	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	300.000 EUR	253.925	0,25
Santos Finance Limited Transurban Finance Company Proprietary Limited	4,13	14.09.2027	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	300.000 USD	256.460	0,25
	1,75	29.03.2028	Gewerbliche Dienste	400.000 EUR	362.420	0,35
					<u>1.568.565</u>	<u>1,52</u>
Österreich						
BAWAG Group AG ±	2,38	26.03.2029	Banken	600.000 EUR	562.723	0,54
Erste Group Bank AG	0,13	17.05.2028	Banken	300.000 EUR	244.433	0,24
Raiffeisen Bank International AG ±	2,88	18.06.2032	Banken	300.000 EUR	232.116	0,22
Raiffeisen Bank International AG ±	7,38	20.12.2032	Banken	500.000 EUR	482.948	0,47
					<u>1.522.220</u>	<u>1,47</u>
Belgien						
Aliaxis Finance SA	0,88	08.11.2028	Baustoffe	400.000 EUR	307.635	0,30
Argenta Spaarbank NV	1,00	06.02.2024	Banken	500.000 EUR	487.290	0,47
Argenta Spaarbank NV ±	1,38	08.02.2029	Banken	600.000 EUR	486.611	0,47
Belfius Bank SA ±	1,25	06.04.2034	Banken	500.000 EUR	392.120	0,38
Ethias SA	5,00	14.01.2026	Versicherung	700.000 EUR	687.771	0,66
			Regierung – Supranationale Institutionen	1.800.000 EUR	1.700.406	1,64
European Union Bond	2,75	04.12.2037				
KBC Group NV ±	0,25	01.03.2027	Banken	400.000 EUR	357.924	0,35
KBC Group NV ±	1,50	29.03.2026	Banken	400.000 EUR	379.656	0,37
KBC Group NV ±	4,38	23.11.2027	Banken	300.000 EUR	299.986	0,29
Lonza Finance International NV	1,63	21.04.2027	Gesundheitsdienstleistungen	300.000 EUR	276.916	0,27
Solvay SA ±	4,25	04.12.2023	Chemie	300.000 EUR	297.090	0,29
					<u>5.673.405</u>	<u>5,49</u>
Kanada						
Royal Bank of Canada	2,13	26.04.2029	Banken	800.000 EUR	710.768	0,69
Toronto-Dominion Bank	3,63	13.12.2029	Banken	300.000 EUR	288.782	0,28
					<u>999.550</u>	<u>0,97</u>
Dänemark						
Carlsberg Breweries AS	0,38	30.06.2027	Getränke	500.000 EUR	437.385	0,42
H Lundbeck AS	0,88	14.10.2027	Biotechnologie	600.000 EUR	522.298	0,51
Jyske Bank AS ±	0,38	15.10.2025	Banken	200.000 EUR	188.468	0,18
Nykredit Realkredit AS	0,88	17.01.2024	Banken	700.000 EUR	683.577	0,66
Nykredit Realkredit AS ±	0,88	28.07.2031	Banken	200.000 EUR	172.812	0,17
Pandora AS	4,50	10.04.2028	Einzelhandel	300.000 EUR	303.687	0,29
TDC Net AS	5,62	06.02.2030	Telekommunikation	300.000 EUR	296.457	0,29
					<u>2.604.684</u>	<u>2,52</u>
Estland						
Luminor Bank AS ±	0,79	03.12.2024	Banken	400.000 EUR	378.680	0,37
Finnland						
Castellum Helsinki Finance Holding Abp	0,88	17.09.2029	Immobilien	400.000 EUR	261.876	0,25
Castellum Helsinki Finance Holding Abp	2,00	24.03.2025	Immobilien	100.000 EUR	90.570	0,09

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

EUR INVESTMENT GRADE CREDIT FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Sektor	Nennwert @	Markt- wert EUR	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>						
Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Fortsetzung)						
Finnland (Fortsetzung)						
Citycon OYJ [±]	3,63	10.06.2026	Immobilien	195.000 EUR	99.401	0,10
Mandatum Life Insurance Company Limited [±]	1,88	04.10.2049	Versicherung Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	800.000 EUR	731.541	0,71
Neste OYJ	3,88	16.03.2029	Dienstleistungen	300.000 EUR	303.122	0,29
Nokia OYJ	4,38	21.08.2031	Telekommunikation	300.000 EUR	296.805	0,29
OP Corporate Bank plc	0,10	16.11.2027	Banken	500.000 EUR	423.252	0,41
OP Corporate Bank plc	2,88	15.12.2025	Banken	200.000 EUR	195.328	0,19
Sampo OYJ [±]	3,38	23.05.2049	Versicherung	400.000 EUR	354.964	0,34
					2.756.859	2,67
Frankreich						
ALD SA	1,25	02.03.2026	Gewerbliche Dienste	700.000 EUR	645.757	0,62
Atos SE	1,00	12.11.2029	Computer	600.000 EUR	402.000	0,39
AXA SA [±]	1,38	07.10.2041	Versicherung	1.000.000 EUR	749.992	0,73
Banque Federative du Credit Mutuel SA	0,25	29.06.2028	Banken	400.000 EUR	336.795	0,33
Banque Federative du Credit Mutuel SA	0,63	19.11.2027	Banken	1.000.000 EUR	853.370	0,83
Banque Federative du Credit Mutuel SA	0,75	08.06.2026	Banken	100.000 EUR	90.959	0,09
Banque Federative du Credit Mutuel SA	3,13	14.09.2027	Banken	300.000 EUR	292.438	0,28
BNP Paribas SA [±]	0,50	19.02.2028	Banken	400.000 EUR	344.407	0,33
BNP Paribas SA [±]	2,13	23.01.2027	Banken	300.000 EUR	282.428	0,27
BNP Paribas SA [±]	2,75	25.07.2028	Banken	400.000 EUR	374.772	0,36
BPCE SA	3,50	23.10.2027	Banken	600.000 USD	504.441	0,49
Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama	0,75	07.07.2028	Versicherung	600.000 EUR	485.846	0,47
Capgemini SE	1,13	23.06.2030	Computer	900.000 EUR	752.945	0,73
CNP Assurances [±]	4,25	05.06.2045	Versicherung	500.000 EUR	483.900	0,47
Credit Agricole Assurances SA	1,50	06.10.2031	Versicherung	1.000.000 EUR	759.456	0,73
Credit Agricole Assurances SA	2,00	17.07.2030	Versicherung	600.000 EUR	483.524	0,47
Credit Agricole SA [±]	0,50	21.09.2029	Banken	300.000 EUR	246.363	0,24
Credit Agricole SA [±]	1,00	22.04.2026	Banken	500.000 EUR	469.336	0,45
Credit Mutuel Arkea SA	3,38	19.09.2027	Banken	700.000 EUR	679.402	0,66
Electricite de France SA	2,00	09.12.2049	Strom	300.000 EUR	180.933	0,17
Electricite de France SA [±]	2,63	01.12.2027	Strom	400.000 EUR	317.000	0,31
Engie SA	4,25	11.01.2043	Strom	500.000 EUR	496.415	0,48
La Mondiale SAM [±]	5,05	17.12.2025	Versicherung	305.000 EUR	297.802	0,29
Orange SA	3,63	16.11.2031	Telekommunikation	600.000 EUR	596.255	0,58
PSA Banque France SA	0,63	21.06.2024	Banken	500.000 EUR	481.461	0,47
RCI Banque SA	1,00	17.05.2023	Automobilhersteller	300.000 EUR	299.043	0,29
RCI Banque SA	4,63	13.07.2026	Automobilhersteller	900.000 EUR	903.433	0,87
Société Générale SA	4,00	16.11.2027	Banken	400.000 EUR	401.685	0,39
Suez SACA	1,88	24.05.2027	Wasser	400.000 EUR	372.783	0,36
TDF Infrastructure SASU	1,75	01.12.2029	Medien	500.000 EUR	396.204	0,38
Teleperformance	3,75	24.06.2029	Computer	200.000 EUR	189.930	0,18
TotalEnergies SE [±]	1,63	25.10.2027	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	400.000 EUR	330.288	0,32
TotalEnergies SE [±]	1,75	04.04.2024	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	400.000 EUR	383.800	0,37
Unibail – Rodamco-Westfield SE	0,75	25.10.2028	REITs	500.000 EUR	396.953	0,38
					15.282.116	14,78

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

EUR INVESTMENT GRADE CREDIT FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Sektor	Nennwert @	Markt- wert EUR	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>						
Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Fortsetzung)						
Deutschland						
Allianz SE ±	2,12	08.07.2050	Versicherung	300.000 EUR	244.117	0,24
Amprion GmbH	3,45	22.09.2027	Strom	200.000 EUR	198.238	0,19
Bayer AG ±	2,38	12.11.2079	Pharmazie	200.000 EUR	185.390	0,18
Bayer AG ±	3,13	12.11.2079	Pharmazie	300.000 EUR	259.209	0,25
Commerzbank AG ±	6,50	06.12.2032	Banken	700.000 EUR	691.785	0,67
Deutsche Bank AG ±	1,75	19.11.2030	Banken	700.000 EUR	549.195	0,53
E.ON SE	1,63	29.03.2031	Strom	600.000 EUR	517.844	0,50
Eurogrid GmbH	3,28	05.09.2031	Strom	600.000 EUR	587.730	0,57
Hamburg Commercial Bank AG	0,38	09.03.2026	Banken	600.000 EUR	522.378	0,51
LANXESS AG	0,63	01.12.2029	Chemie	500.000 EUR	394.218	0,38
LANXESS AG	1,75	22.03.2028	Chemie	200.000 EUR	180.468	0,17
LEG Immobilien SE	0,75	30.06.2031	Immobilien	600.000 EUR	426.534	0,41
Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG in Muenchen ±	1,25	26.05.2041	Versicherung	300.000 EUR	224.377	0,22
O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH	1,75	05.07.2025	Telekommunikation	700.000 EUR	667.030	0,64
Vonovia SE	0,63	14.12.2029	Immobilien	300.000 EUR	218.949	0,21
Vonovia SE	0,75	01.09.2032	Immobilien	1.000.000 EUR	640.520	0,62
					6.507.982	6,29
Irland						
AIB Group plc	2,25	03.07.2025	Banken	400.000 EUR	384.087	0,37
Experian Europe DAC	1,56	16.05.2031	Gewerbliche Dienste	200.000 EUR	168.948	0,16
Permanent TSB Group Holdings plc ±	5,25	30.06.2025	Banken	700.000 EUR	692.017	0,67
					1.245.052	1,20
Italien						
BPER Banca ±	6,13	01.02.2028	Banken	300.000 EUR	300.393	0,29
Enel SpA ^±	6,63	16.04.2031	Strom	100.000 EUR	100.625	0,10
			Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen			
ENI SpA ^±	2,75	11.02.2030	Dienstleistungen	300.000 EUR	231.388	0,22
FincoBank Banca Finco SpA ±	0,50	21.10.2027	Banken	300.000 EUR	257.454	0,25
Hera SpA	1,00	25.04.2034	Strom	400.000 EUR	289.082	0,28
Intesa Sanpaolo SpA	1,00	04.07.2024	Banken	300.000 EUR	289.400	0,28
Intesa Sanpaolo SpA ±	5,00	08.03.2028	Banken	600.000 EUR	599.770	0,58
UniCredit SpA ±	2,73	15.01.2032	Banken	300.000 EUR	255.575	0,25
					2.323.687	2,25
Japan						
Mizuho Financial Group Incorporated	0,69	07.10.2030	Banken	400.000 EUR	312.907	0,30
Luxemburg						
Grand City Properties SA ^±	1,50	11.03.2026	Immobilien	400.000 EUR	138.220	0,13
Grand City Properties SA	1,50	22.02.2027	Immobilien	300.000 EUR	238.944	0,23
Holcim Finance Luxembourg SA	0,50	23.04.2031	Baustoffe	400.000 EUR	297.931	0,29
Prologis International Funding II SA	0,88	09.07.2029	Immobilien	600.000 EUR	470.106	0,46
Prologis International Funding II SA	4,63	21.02.2035	Immobilien	400.000 EUR	372.439	0,36
SELP Finance Sarl	1,50	20.11.2025	REITs	400.000 EUR	360.637	0,35
SELP Finance Sarl	3,75	10.08.2027	REITs	600.000 EUR	550.152	0,53
SES SA	2,00	02.07.2028	Telekommunikation	900.000 EUR	755.917	0,73
SES SA ^±	2,88	27.05.2026	Telekommunikation	400.000 EUR	324.000	0,31
Swiss Re Finance Luxembourg SA ±	2,53	30.04.2050	Versicherung	500.000 EUR	413.205	0,40
					3.921.551	3,79

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

EUR INVESTMENT GRADE CREDIT FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Sektor	Nennwert @	Markt- wert EUR	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>						
Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Fortsetzung)						
Niederlande						
ABB Finance BV (z)	0,00	19.01.2030	Bau- & Ingenieurwesen	500.000 EUR	397.773	0,38
ABN AMRO Bank NV	0,50	23.09.2029	Banken	700.000 EUR	559.820	0,54
ABN AMRO Bank NV	2,38	01.06.2027	Banken	300.000 EUR	280.728	0,27
Alcon Finance BV	2,38	31.05.2028	Gesundheitsprodukte	500.000 EUR	464.655	0,45
American Medical Systems Europe BV	1,38	08.03.2028	Gesundheitsprodukte	300.000 EUR	269.785	0,26
ASR Nederland NV ±	3,38	02.05.2049	Versicherung	300.000 EUR	255.375	0,25
BP Capital Markets BV	1,47	21.09.2041	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	300.000 EUR	194.034	0,19
Citycon Treasury BV	1,63	12.03.2028	Immobilien	500.000 EUR	354.908	0,34
Cooperatieve Rabobank UA ±	0,38	01.12.2027	Banken	500.000 EUR	436.475	0,42
de Volksbank NV	4,88	07.03.2030	Banken	300.000 EUR	304.800	0,30
Digital Dutch Finco BV	1,50	15.03.2030	REITs	300.000 EUR	233.216	0,23
Digital Intrepid Holding BV	0,63	15.07.2031	REITs	800.000 EUR	549.770	0,53
Enel Finance International NV (z)	0,00	17.06.2027	Strom	500.000 EUR	426.833	0,41
Enel Finance International NV	0,88	17.06.2036	Strom	600.000 EUR	394.761	0,38
Enel Finance International NV	3,88	09.03.2029	Strom	700.000 EUR	701.604	0,68
Heimstadn Bostad Treasury BV	1,38	03.03.2027	Immobilien	400.000 EUR	318.996	0,31
Iberdrola International BV ^±	2,25	28.01.2029	Strom	200.000 EUR	162.750	0,16
ING Groep NV ±	0,25	18.02.2029	Banken	1.100.000 EUR	895.774	0,87
ING Groep NV ±	2,13	23.05.2026	Banken	300.000 EUR	287.645	0,28
ING Groep NV ±	4,88	14.11.2027	Banken	300.000 EUR	304.775	0,29
Koninklijke Philips NV	2,13	05.11.2029	Gesundheitsprodukte Diversifizierte	500.000 EUR	449.454	0,43
LeasePlan Corporation NV	2,13	06.05.2025	Finanzdienstleister	600.000 EUR	574.821	0,56
NIBC Bank NV	1,13	19.04.2023	Banken	800.000 EUR	799.256	0,77
NIBC Bank NV	2,00	09.04.2024	Banken	200.000 EUR	194.471	0,19
NN Group NV ±	5,25	01.03.2043	Versicherung	500.000 EUR	472.539	0,46
PACCAR Financial Europe BV	3,25	29.11.2025	Automobilhersteller Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	300.000 EUR	298.440	0,29
Shell International Finance BV	1,25	11.11.2032	Dienstleistungen	350.000 EUR	280.897	0,27
Syngenta Finance NV	3,38	16.04.2026	Chemie	400.000 EUR	387.319	0,37
					11.251.674	10,88
Neuseeland						
Chorus Limited	3,63	07.09.2029	Telekommunikation	700.000 EUR	682.482	0,66
Norwegen						
Aker BP ASA	1,13	12.05.2029	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	600.000 EUR	496.776	0,48
Aker BP ASA	3,00	15.01.2025	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	200.000 USD	177.317	0,17
DNB Bank ASA ±	3,13	21.09.2027	Banken	1.700.000 EUR	1.669.992	1,62
Equinor ASA	1,38	22.05.2032	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	400.000 EUR	332.314	0,32
					2.676.399	2,59
Portugal						
Caixa Geral de Depositos SA ±	5,75	28.06.2028	Banken	300.000 EUR	297.744	0,29
Spanien						
Acciona Energia Financiacion Filiales SA	1,38	26.01.2032	Energie – Alternative Quellen	200.000 EUR	163.774	0,16
Banco de Credito Social Cooperativo SA ±	5,25	27.11.2031	Banken	400.000 EUR	304.524	0,29
Banco de Sabadell SA ±	1,13	11.03.2027	Banken	500.000 EUR	451.143	0,44
Bankinter SA	0,63	06.10.2027	Banken	900.000 EUR	769.961	0,74
CaixaBank SA ±	3,75	15.02.2029	Banken	400.000 EUR	393.336	0,38
Iberdrola Finanzas SA ^±	4,88	25.04.2028	Strom	200.000 EUR	192.994	0,19
					2.275.732	2,20

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

EUR INVESTMENT GRADE CREDIT FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Sektor	Nennwert @	Markt- wert EUR	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>						
Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Fortsetzung)						
Schweden						
Akelius Residential Property AB ±	3,88	05.10.2078	Immobilien	201.000 EUR	192.833	0,19
Essity AB	0,25	08.02.2031	Kosmetik/Körperpflege	700.000 EUR	526.780	0,51
Heimstaden Bostad AB	1,13	21.01.2026	Immobilien	300.000 EUR	252.203	0,24
Heimstaden Bostad AB ^±	3,63	13.10.2026	Immobilien	500.000 EUR	250.695	0,24
Molnlycke Holding AB	0,63	15.01.2031	Gesundheitsprodukte Maschinen – Bau- und	400.000 EUR	306.035	0,30
Sandvik AB	0,38	25.11.2028	Bergbau	400.000 EUR	334.513	0,32
Tele2 AB	1,13	15.05.2024	Telekommunikation	300.000 EUR	290.740	0,28
Tele2 AB	2,13	15.05.2028	Telekommunikation	800.000 EUR	730.648	0,71
					2.884.447	2,79
Schweiz						
UBS AG	0,01	31.03.2026	Banken	700.000 EUR	622.612	0,60
UBS AG	0,50	31.03.2031	Banken	1.200.000 EUR	927.480	0,90
UBS Group AG ±	1,00	21.03.2025	Banken	500.000 EUR	482.625	0,46
Zuercher Kantonalbank ±	2,02	13.04.2028	Banken	1.000.000 EUR	909.700	0,88
					2.942.417	2,84
Vereinigtes Königreich						
Anglo American Capital plc	4,75	21.09.2032	Bergbau	500.000 EUR	502.316	0,49
AstraZeneca plc	3,75	03.03.2032	Pharmazie Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	700.000 EUR	712.942	0,69
BP Capital Markets plc	2,52	07.04.2028	Dienstleistungen	500.000 EUR	472.772	0,46
British Telecommunications plc	0,50	12.09.2025	Telekommunikation	600.000 EUR	558.313	0,54
British Telecommunications plc	3,38	30.08.2032	Telekommunikation	500.000 EUR	469.200	0,45
HSBC Holdings plc ±	3,02	15.06.2027	Banken	500.000 EUR	479.896	0,46
Lloyds Banking Group plc ±	0,50	12.11.2025	Banken	400.000 EUR	378.614	0,37
Nationwide Building Society	3,25	05.09.2029	Sparkassen & Kreditbanken	400.000 EUR	376.083	0,36
NatWest Group plc ±	0,67	14.09.2029	Banken	500.000 EUR	405.421	0,39
NatWest Group plc ±	0,78	26.02.2030	Banken	700.000 EUR	560.875	0,54
NatWest Group plc ±	4,07	06.09.2028	Banken	500.000 EUR	490.797	0,47
Natwest Markets plc	0,13	18.06.2026	Banken	500.000 EUR	441.399	0,43
Pinewood Finance Company Limited	3,25	30.09.2025	Diversifizierte Finanzdienstleister	500.000 GBP	532.045	0,51
Pinewood Finance Company Limited	3,63	15.11.2027	Diversifizierte Finanzdienstleister	200.000 GBP	201.722	0,20
Rentokil Initial plc	0,50	14.10.2028	Gewerbliche Dienste	1.100.000 EUR	911.493	0,88
Standard Chartered plc ±	0,80	17.11.2029	Banken	800.000 EUR	651.520	0,63
Tesco Corporate Treasury Services plc	0,88	29.05.2026	Diversifizierte Finanzdienstleister	600.000 EUR	544.985	0,53
Thames Water Utilities Finance plc	0,88	31.01.2028	Wasser	300.000 EUR	258.857	0,25
Thames Water Utilities Finance plc	4,00	18.04.2027	Wasser	400.000 EUR	401.318	0,39
Tritax EuroBox plc	0,95	02.06.2026	Immobilien	900.000 EUR	750.669	0,73
Virgin Money UK plc ±	0,38	27.05.2024	Banken	200.000 EUR	198.500	0,19
Virgin Money UK plc ±	2,88	24.06.2025	Banken	700.000 EUR	673.116	0,65
Vodafone Group plc	2,50	24.05.2039	Telekommunikation	1.000.000 EUR	786.900	0,76
Vodafone Group plc ±	2,63	27.08.2080	Telekommunikation	300.000 EUR	269.265	0,26
					12.029.018	11,63
Vereinigte Staaten						
AbbVie Incorporated	1,25	01.06.2024	Pharmazie	400.000 EUR	389.548	0,38
American Tower Corporation	0,50	15.01.2028	REITs	900.000 EUR	750.492	0,73
Bank of America Corporation ±	1,78	04.05.2027	Banken	500.000 EUR	465.161	0,45
Bank of America Corporation ±	1,95	27.10.2026	Banken	1.100.000 EUR	1.042.230	1,01
Celanese US Holdings LLC	0,63	10.09.2028	Chemie	400.000 EUR	309.440	0,30
Celanese US Holdings LLC	1,13	26.09.2023	Chemie	175.000 EUR	172.931	0,17

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

EUR INVESTMENT GRADE CREDIT FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Sektor	Nennwert @	Markt- wert EUR	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>						
Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Fortsetzung)						
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)						
Citigroup Incorporated ±	3,71	22.09.2028	Banken	800.000 EUR	785.010	0,76
Coca-Cola Company	0,13	15.03.2029	Getränke	600.000 EUR	493.224	0,48
			Diversifizierte			
Computershare US Incorporated	1,13	07.10.2031	Finanzdienstleister	600.000 EUR	458.876	0,44
Digital Euro Finco LLC	2,63	15.04.2024	REITs	400.000 EUR	390.554	0,38
Fidelity National Information Services Incorporated	1,00	03.12.2028	Software	400.000 EUR	343.235	0,33
Ford Motor Credit Company LLC	4,87	03.08.2027	Automobilhersteller	300.000 EUR	291.000	0,28
Goldman Sachs Group Incorporated	1,25	07.02.2029	Banken	400.000 EUR	339.373	0,33
Goldman Sachs Group Incorporated	4,00	21.09.2029	Banken	600.000 EUR	590.670	0,57
JPMorgan Chase & Company ±	0,39	24.02.2028	Banken	1.300.000 EUR	1.124.500	1,09
JPMorgan Chase & Company ±	1,09	11.03.2027	Banken	500.000 EUR	459.372	0,44
JPMorgan Chase & Company ±	1,96	23.03.2030	Banken	600.000 EUR	529.615	0,51
McDonald's Corporation	1,50	28.11.2029	Einzelhandel	600.000 EUR	521.436	0,50
McDonald's Corporation	2,38	31.05.2029	Einzelhandel	300.000 EUR	278.365	0,27
McDonald's Corporation	2,63	11.06.2029	Einzelhandel	500.000 EUR	468.722	0,45
Morgan Stanley ±	0,64	26.07.2024	Banken	400.000 EUR	395.754	0,38
Morgan Stanley ±	1,34	23.10.2026	Banken	400.000 EUR	374.448	0,36
Morgan Stanley ±	2,10	08.05.2026	Banken	400.000 EUR	383.468	0,37
Toyota Motor Credit Corporation	4,05	13.09.2029	Automobilhersteller	300.000 EUR	307.651	0,30
Verizon Communications Incorporated	1,85	18.05.2040	Telekommunikation	300.000 EUR	211.835	0,20
					<u>11.876.910</u>	<u>11,48</u>
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel					<u>92.014.081</u>	<u>88,98</u>
Staatsanleihen						
Deutschland						
Bundesobligation	1,30	15.10.2027		900.000 EUR	859.406	0,83
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe (z)	0,00	15.05.2036		700.000 EUR	511.584	0,49
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe (z)	0,00	15.08.2050		400.000 EUR	215.440	0,21
Summe Staatsanleihen					<u>1.586.430</u>	<u>1,53</u>
Forderungs- und hypotheckenbesicherte Wertpapiere						
Vereinigtes Königreich						
Income Contingent Student Loans 1 2002-2006 plc	4,71	24.07.2056		157.812 GBP	178.550	0,17
Income Contingent Student Loans 2 2007-2009 plc	4,71	24.07.2058		153.730 GBP	173.911	0,17
Summe Forderungs- und hypotheckenbesicherte Wertpapiere					<u>352.461</u>	<u>0,34</u>
Summe Wertpapieranlagen					<u>93.952.972</u>	<u>90,85</u>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

EUR INVESTMENT GRADE CREDIT FUND

	Verzinsung in %	Nennwert @	Markt- wert EUR	% des Netto- vermögens
Bankguthaben				
Termineinlagen				
Japan				
Sumitomo Mitsui Banking Corporation (o)	1,93	7.798.825 EUR	7.798.825	7,54
Vereinigtes Königreich				
Sumitomo Mitsui Banking Corporation (o)	3,17	256.748 GBP	292.196	0,28
Vereinigte Staaten				
China Construction Bank Corporation (o)	4,18	40.773 USD	37.529	0,04
Summe Termineinlagen			8.128.550	7,86
Kontokorrentkonten			2.478	0,00
Summe Bankguthaben			8.131.028	7,86
<i>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, netto</i>			<i>1.329.417</i>	<i>1,29</i>
Gesamtes Fondsvermögen			103.413.417	100,00

@ Nennwert lautet auf angegebene Währung.

± Variabel verzinsliche Anlage. Der aufgeführte Zins entspricht dem effektiven Zinssatz zum Ende des Berichtszeitraums.

^ Die Anlage erfolgt unbefristet und hat daher kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das angegebene Datum spiegelt den nächsten Call-Termin wider.

(z) Nullkuponanleihe.

(o) Tagesgelder.

Abkürzung:	EUR	Euro
	GBP	Britisches Pfund
	REITs	Real Estate Investment Trust (REITs)
	USD	US-Dollar

Die Wertpapiere wurden auf Grundlage des Landes der Unternehmensgründung/-ansässigkeit aufgelistet.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

EUR SHORT DURATION CREDIT FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Sektor	Nennwert @	Markt- wert EUR	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>						
Unternehmensanleihen und Schuldtitel						
Australien						
Ausgrid Finance Proprietary Limited	1,25	30.07.2025	Strom	1.600.000 EUR	1.515.067	0,41
Australia & New Zealand Banking Group Limited ±	0,67	05.05.2031	Banken	3.100.000 EUR	2.696.070	0,73
					<u>4.211.137</u>	<u>1,14</u>
Österreich						
BAWAG Group AG ±	2,38	26.03.2029	Banken	3.400.000 EUR	3.188.765	0,86
Erste Group Bank AG	0,13	17.05.2028	Banken	2.200.000 EUR	1.792.507	0,49
					<u>4.981.272</u>	<u>1,35</u>
Belgien						
Aliaxis Finance SA	0,88	08.11.2028	Baustoffe	1.300.000 EUR	999.814	0,27
Anheuser-Busch InBev SA	1,13	01.07.2027	Getränke	4.500.000 EUR	4.108.635	1,11
Argenta Spaarbank NV	1,00	06.02.2024	Banken	2.700.000 EUR	2.631.366	0,71
Argenta Spaarbank NV ±	1,38	08.02.2029	Banken	2.100.000 EUR	1.703.138	0,46
Belfius Bank SA ±	1,25	06.04.2034	Banken	1.800.000 EUR	1.411.632	0,38
KBC Group NV ±	0,13	10.09.2026	Banken	800.000 EUR	727.371	0,20
KBC Group NV ±	1,50	29.03.2026	Banken	1.900.000 EUR	1.803.366	0,49
Solvay SA ^±	4,25	04.12.2023	Chemie	1.400.000 EUR	1.386.420	0,38
					<u>14.771.742</u>	<u>4,00</u>
Kanada						
Royal Bank of Canada	0,25	02.05.2024	Banken	2.400.000 EUR	2.310.091	0,63
Toronto-Dominion Bank	3,63	13.12.2029	Banken	2.200.000 EUR	2.117.738	0,57
					<u>4.427.829</u>	<u>1,20</u>
Dänemark						
Carlsberg Breweries AS	0,50	06.09.2023	Getränke	1.100.000 EUR	1.086.081	0,29
Carlsberg Breweries AS	3,25	12.10.2025	Getränke	3.200.000 EUR	3.181.389	0,86
H Lundbeck AS	0,88	14.10.2027	Biotechnologie	1.500.000 EUR	1.305.746	0,35
Jyske Bank AS ±	0,38	15.10.2025	Banken	300.000 EUR	282.703	0,08
Nykredit Realkredit AS	0,13	10.07.2024	Banken	800.000 EUR	759.728	0,21
Nykredit Realkredit AS	0,25	13.01.2026	Banken	300.000 EUR	269.439	0,07
Nykredit Realkredit AS	0,88	17.01.2024	Banken	2.400.000 EUR	2.343.691	0,64
Nykredit Realkredit AS ±	0,88	28.07.2031	Banken	700.000 EUR	604.842	0,16
Pandora AS	4,50	10.04.2028	Einzelhandel	600.000 EUR	607.373	0,17
Sydbank AS	1,38	18.09.2023	Banken	400.000 EUR	395.414	0,11
					<u>10.836.406</u>	<u>2,94</u>
Estland						
Luminor Bank AS ±	0,79	03.12.2024	Banken	700.000 EUR	662.690	0,18
Luminor Bank AS ±	7,25	16.01.2026	Banken	1.000.000 EUR	998.760	0,27
					<u>1.661.450</u>	<u>0,45</u>
Finnland						
Castellum Helsinki Finance Holding Abp	2,00	24.03.2025	Immobilien	900.000 EUR	815.130	0,22
Citycon OYJ ^±	3,63	10.06.2026	Immobilien	846.000 EUR	431.247	0,12
Mandatum Life Insurance Company Limited ±	1,88	04.10.2049	Versicherung	1.400.000 EUR	1.280.196	0,35

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

EUR SHORT DURATION CREDIT FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Sektor	Nennwert @	Markt- wert EUR	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>						
Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Fortsetzung)						
Finnland (Fortsetzung)						
Neste OYJ	3,88	16.03.2029	<i>Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen</i>	1.100.000 EUR	1.111.449	0,30
Nordea Bank Abp	0,88	26.06.2023	<i>Banken</i>	2.600.000 EUR	2.585.877	0,70
OP Corporate Bank plc	0,38	29.08.2023	<i>Banken</i>	2.000.000 EUR	1.976.708	0,54
OP Corporate Bank plc	0,38	19.06.2024	<i>Banken</i>	3.400.000 EUR	3.253.351	0,88
OP Corporate Bank plc	2,88	15.12.2025	<i>Banken</i>	500.000 EUR	488.319	0,13
					11.942.277	3,24
Frankreich						
Banque Federative du Credit Mutuel SA	0,75	08.06.2026	<i>Banken</i>	5.700.000 EUR	5.184.640	1,40
Banque Federative du Credit Mutuel SA	3,13	14.09.2027	<i>Banken</i>	2.000.000 EUR	1.949.588	0,53
BNP Paribas SA ±	0,38	14.10.2027	<i>Banken</i>	1.000.000 EUR	874.636	0,24
BNP Paribas SA ±	2,13	23.01.2027	<i>Banken</i>	5.500.000 EUR	5.177.843	1,40
BNP Paribas SA ±	2,75	25.07.2028	<i>Banken</i>	500.000 EUR	468.465	0,13
BPCE SA	0,63	28.04.2025	<i>Banken</i>	6.200.000 EUR	5.817.150	1,58
Capgemini SE	0,63	23.06.2025	<i>Computer</i>	1.600.000 EUR	1.501.101	0,41
Credit Agricole SA ±	0,50	21.09.2029	<i>Banken</i>	4.300.000 EUR	3.531.203	0,96
Credit Agricole SA ±	1,00	22.04.2026	<i>Banken</i>	2.300.000 EUR	2.158.945	0,58
Credit Agricole SA	4,13	07.03.2030	<i>Banken</i>	1.700.000 EUR	1.745.390	0,47
Credit Mutuel Arkea SA	3,38	19.09.2027	<i>Banken</i>	3.900.000 EUR	3.785.239	1,03
Danone SA ^±	1,75	02.05.2023	<i>Lebensmittel</i>	2.800.000 EUR	2.774.520	0,75
Electricite de France SA ^±	2,63	01.12.2027	<i>Strom</i>	2.800.000 EUR	2.219.000	0,60
Electricite de France SA	3,63	13.10.2025	<i>Strom</i>	300.000 USD	268.946	0,07
Electricite de France SA	3,88	12.01.2027	<i>Strom</i>	500.000 EUR	500.517	0,13
RCI Banque SA	4,63	13.07.2026	<i>Automobilhersteller</i>	3.900.000 EUR	3.914.875	1,06
Societe Fonciere Lyonnaise SA	0,50	21.04.2028	<i>REITs</i>	1.100.000 EUR	916.421	0,25
Société Générale SA	4,00	16.11.2027	<i>Banken</i>	3.100.000 EUR	3.113.057	0,84
Suez SACA	1,88	24.05.2027	<i>Wasser</i>	1.100.000 EUR	1.025.152	0,28
TotalEnergies SE ^±	1,63	25.10.2027	<i>Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen</i>	2.000.000 EUR	1.651.440	0,45
TotalEnergies SE ^±	1,75	04.04.2024	<i>Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen</i>	800.000 EUR	767.600	0,21
TotalEnergies SE ^±	2,71	05.05.2023	<i>Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen</i>	1.000.000 EUR	996.160	0,27
Unibail – Rodamco-Westfield SE	0,75	25.10.2028	<i>REITs</i>	1.800.000 EUR	1.429.031	0,39
					51.770.919	14,03
Deutschland						
Albemarle New Holding GmbH	1,13	25.11.2025	<i>Chemie</i>	285.000 EUR	265.941	0,07
Amprion GmbH	3,45	22.09.2027	<i>Strom</i>	2.500.000 EUR	2.477.975	0,67
Bayer AG	0,05	12.01.2025	<i>Pharmazie</i>	1.500.000 EUR	1.408.830	0,38
Bayer AG ±	2,38	12.11.2079	<i>Pharmazie</i>	2.400.000 EUR	2.224.680	0,60
Commerzbank AG	0,50	28.08.2023	<i>Banken</i>	1.800.000 EUR	1.778.040	0,48
Deutsche Bank AG	2,63	16.12.2024	<i>Banken</i>	900.000 GBP	944.968	0,26
Eurogrid GmbH	1,63	03.11.2023	<i>Strom</i>	1.900.000 EUR	1.881.152	0,51
Hamburg Commercial Bank AG ±	0,50	22.09.2026	<i>Banken</i>	1.100.000 EUR	958.727	0,26
Hamburg Commercial Bank AG	6,25	18.11.2024	<i>Banken</i>	1.600.000 EUR	1.602.672	0,43
LANXESS AG	1,75	22.03.2028	<i>Chemie</i>	3.700.000 EUR	3.338.650	0,91
O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH	1,75	05.07.2025	<i>Telekommunikation</i>	3.200.000 EUR	3.049.280	0,83
Vonovia SE	0,25	01.09.2028	<i>Immobilien</i>	1.200.000 EUR	912.504	0,25
Vonovia SE	1,38	28.01.2026	<i>Immobilien</i>	1.200.000 EUR	1.085.169	0,29
					21.928.588	5,94

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

EUR SHORT DURATION CREDIT FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Sektor	Nennwert @	Markt- wert EUR	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>						
Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Fortsetzung)						
Islande						
Landsbankinn HF	0,50	20.05.2024	Banken	900.000 EUR	841.644	0,23
Irland						
Permanent TSB Group Holdings plc ±	5,25	30.06.2025	Banken	1.700.000 EUR	1.680.613	0,46
Italien						
BPER Banca ±	6,13	01.02.2028	Banken	1.400.000 EUR	1.401.834	0,38
ENI SpA ^±	2,00	11.02.2027	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	2.500.000 EUR	2.098.623	0,57
FinecoBank Banca Fineco SpA ±	0,50	21.10.2027	Banken	2.700.000 EUR	2.317.086	0,63
Intesa Sanpaolo SpA	1,00	04.07.2024	Banken	1.800.000 EUR	1.736.403	0,47
Intesa Sanpaolo SpA	2,63	20.06.2024	Banken	1.100.000 EUR	1.081.177	0,29
Intesa Sanpaolo SpA ±	5,00	08.03.2028	Banken	1.200.000 EUR	1.199.539	0,33
UniCredit SpA	0,33	19.01.2026	Banken	1.800.000 EUR	1.627.790	0,44
					11.462.452	3,11
Japan						
Mizuho Financial Group Incorporated	0,21	07.10.2025	Banken	800.000 EUR	732.139	0,20
Luxemburg						
Grand City Properties SA ^±	1,50	11.03.2026	Immobilien	900.000 EUR	310.995	0,08
Grand City Properties SA	1,50	22.02.2027	Immobilien	2.200.000 EUR	1.752.252	0,48
SELP Finance Sarl	3,75	10.08.2027	REITs	1.400.000 EUR	1.283.688	0,35
SES SA ^±	2,88	27.05.2026	Telekommunikation	2.700.000 EUR	2.187.000	0,59
					5.533.935	1,50
Niederlande						
ABN AMRO Bank NV	2,38	01.06.2027	Banken	3.700.000 EUR	3.462.316	0,94
Alcon Finance BV	2,38	31.05.2028	Gesundheitsprodukte	3.200.000 EUR	2.973.792	0,81
American Medical Systems Europe BV	1,38	08.03.2028	Gesundheitsprodukte	1.700.000 EUR	1.528.783	0,41
Citycon Treasury BV	1,63	12.03.2028	Immobilien	700.000 EUR	496.871	0,13
Coloplast Finance BV	2,25	19.05.2027	Gesundheitsprodukte	2.900.000 EUR	2.737.977	0,74
Cooperatieve Rabobank UA ±	0,38	01.12.2027	Banken	3.000.000 EUR	2.618.850	0,71
Cooperatieve Rabobank UA	1,25	14.01.2025	Banken	1.700.000 GBP	1.801.350	0,49
de Volksbank NV	4,88	07.03.2030	Banken	1.200.000 EUR	1.219.200	0,33
Digital Dutch Finco BV	0,63	15.07.2025	REITs	1.700.000 EUR	1.544.355	0,42
Enel Finance International NV (z)	0,00	17.06.2027	Strom	3.800.000 EUR	3.243.931	0,88
Heimstadn Bostad Treasury BV	1,38	03.03.2027	Immobilien	700.000 EUR	558.243	0,15
Iberdrola International BV ^±	3,25	12.11.2024	Strom	1.900.000 EUR	1.824.000	0,49
ING Groep NV	1,13	14.02.2025	Banken	4.400.000 EUR	4.192.549	1,14
ING Groep NV ±	4,88	14.11.2027	Banken	700.000 EUR	711.142	0,19
Koninklijke Philips NV	1,88	05.05.2027	Gesundheitsprodukte Diversifizierte	1.900.000 EUR	1.775.919	0,48
LeasePlan Corporation NV	2,13	06.05.2025	Finanzdienstleister	3.100.000 EUR	2.969.909	0,81
NIBC Bank NV	1,13	19.04.2023	Banken	1.700.000 EUR	1.698.419	0,46
PACCAR Financial Europe BV	3,25	29.11.2025	Automobilhersteller Erdöl & Erdgas –	2.100.000 EUR	2.089.080	0,57
Repsol International Finance BV	0,13	05.10.2024	Dienstleistungen	2.400.000 EUR	2.285.481	0,62
Syngenta Finance NV	3,38	16.04.2026	Chemie	2.100.000 EUR	2.033.426	0,55
					41.765.593	11,32

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

EUR SHORT DURATION CREDIT FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Sektor	Nennwert @	Markt- wert EUR	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>						
Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Fortsetzung)						
Norwegen						
Aker BP ASA	3,00	15.01.2025	<i>Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen</i>	400.000 USD	354.635	0,10
DNB Bank ASA	0,05	14.11.2023	<i>Banken</i>	2.100.000 EUR	2.056.005	0,56
DNB Bank ASA ±	3,13	21.09.2027	<i>Banken</i>	3.100.000 EUR	3.045.279	0,82
					5.455.919	1,48
Portugal						
Caixa Geral de Depositos SA ±	0,38	21.09.2027	<i>Banken</i>	1.500.000 EUR	1.299.141	0,35
Spanien						
Acciona Energia Financiacion Filiales SA	0,38	07.10.2027	<i>Energie – Alternative Quellen</i>	700.000 EUR	608.268	0,17
Banco de Credito Social Cooperativo SA ±	5,25	27.11.2031	<i>Banken</i>	1.400.000 EUR	1.065.834	0,29
Banco de Sabadell SA	1,13	27.03.2025	<i>Banken</i>	2.000.000 EUR	1.841.148	0,50
Bankinter SA	0,88	05.03.2024	<i>Banken</i>	2.200.000 EUR	2.139.095	0,58
CaixaBank SA ±	0,38	18.11.2026	<i>Banken</i>	700.000 EUR	630.020	0,17
CaixaBank SA	1,13	12.11.2026	<i>Banken</i>	200.000 EUR	180.161	0,05
CaixaBank SA ±	3,75	15.02.2029	<i>Banken</i>	5.900.000 EUR	5.801.706	1,57
Unicaja Banco SA ±	1,00	01.12.2026	<i>Banken</i>	1.500.000 EUR	1.343.472	0,36
					13.609.704	3,69
Schweden						
Akelius Residential Property AB	1,13	14.03.2024	<i>Immobilien</i>	1.600.000 EUR	1.539.741	0,42
Akelius Residential Property AB ±	3,88	05.10.2078	<i>Immobilien</i>	602.000 EUR	577.541	0,16
Fastighets AB Balder	1,88	14.03.2025	<i>Immobilien</i>	1.200.000 EUR	1.062.768	0,29
Heimstaden Bostad AB	1,13	21.01.2026	<i>Immobilien</i>	1.600.000 EUR	1.345.084	0,36
Heimstaden Bostad AB ^±	3,63	13.10.2026	<i>Immobilien</i>	1.400.000 EUR	701.946	0,19
Molnlycke Holding AB	1,75	28.02.2024	<i>Gesundheitsprodukte Maschinen – Bau- und</i>	3.200.000 EUR	3.136.838	0,85
Sandvik AB	0,38	25.11.2028	<i>Bergbau</i>	2.000.000 EUR	1.672.564	0,45
Svenska Handelsbanken AB	1,00	15.04.2025	<i>Banken</i>	1.500.000 EUR	1.427.534	0,39
Svenska Handelsbanken AB ±	1,63	05.03.2029	<i>Banken</i>	1.400.000 EUR	1.349.905	0,36
Swedbank AB	1,30	17.02.2027	<i>Banken</i>	2.800.000 EUR	2.500.529	0,68
Tele2 AB	1,13	15.05.2024	<i>Telekommunikation</i>	3.200.000 EUR	3.101.229	0,84
Vattenfall AB	0,05	15.10.2025	<i>Strom</i>	900.000 EUR	824.431	0,22
					19.240.110	5,21
Schweiz						
UBS AG	0,01	31.03.2026	<i>Banken</i>	2.900.000 EUR	2.579.393	0,70
UBS AG	0,01	29.06.2026	<i>Banken</i>	1.300.000 EUR	1.146.746	0,31
UBS Group AG ±	1,00	21.03.2025	<i>Banken</i>	1.200.000 EUR	1.158.300	0,31
Zuercher Kantonalbank ±	2,02	13.04.2028	<i>Banken</i>	3.200.000 EUR	2.911.040	0,79
					7.795.479	2,11
Vereinigtes Königreich						
AstraZeneca plc	3,63	03.03.2027	<i>Pharmazie</i>	3.000.000 EUR	3.034.404	0,82
Barclays plc ±	3,38	02.04.2025	<i>Banken</i>	3.300.000 EUR	3.270.379	0,89
British Telecommunications plc	0,50	12.09.2025	<i>Telekommunikation</i>	3.400.000 EUR	3.163.775	0,86
HSBC Holdings plc ±	3,02	15.06.2027	<i>Banken</i>	3.300.000 EUR	3.167.314	0,86
Lloyds Banking Group plc ±	0,50	12.11.2025	<i>Banken</i>	3.300.000 EUR	3.123.562	0,85
Nationwide Building Society	3,25	05.09.2029	<i>Sparkassen & Kreditbanken</i>	2.200.000 EUR	2.068.454	0,56
NatWest Group plc ±	0,67	14.09.2029	<i>Banken</i>	1.000.000 EUR	810.842	0,22
NatWest Group plc ±	4,07	06.09.2028	<i>Banken</i>	2.700.000 EUR	2.650.304	0,72

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

EUR SHORT DURATION CREDIT FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Sektor	Nennwert @	Markt- wert EUR	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>						
Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Fortsetzung)						
Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)						
Natwest Markets plc	0,13	18.06.2026	Banken	1.400.000 EUR	1.235.917	0,34
Natwest Markets plc	1,38	02.03.2027	Banken	1.200.000 EUR	1.080.408	0,29
Pinewood Finance Company Limited	3,25	30.09.2025	Diversifizierte Finanzdienstleister	1.600.000 GBP	1.702.544	0,46
Rentokil Initial plc	0,95	22.11.2024	Gewerbliche Dienste	2.700.000 EUR	2.587.750	0,70
SSE plc	1,25	16.04.2025	Strom	2.600.000 EUR	2.481.986	0,67
Tesco Corporate Treasury Services plc	0,88	29.05.2026	Diversifizierte Finanzdienstleister	2.200.000 EUR	1.998.278	0,54
Thames Water Utilities Finance plc	0,88	31.01.2028	Wasser	700.000 EUR	604.000	0,16
Thames Water Utilities Finance plc	4,00	18.04.2027	Wasser	1.800.000 EUR	1.805.932	0,49
Tritax EuroBox plc	0,95	02.06.2026	Immobilien	1.700.000 EUR	1.417.930	0,38
Virgin Money UK plc ±	0,38	27.05.2024	Banken	1.100.000 EUR	1.091.750	0,30
Virgin Money UK plc ±	2,88	24.06.2025	Banken	2.000.000 EUR	1.923.188	0,52
Vodafone Group plc ±	2,63	27.08.2080	Telekommunikation	1.800.000 EUR	1.615.590	0,44
					40.834.307	11,07
Vereinigte Staaten						
AbbVie Incorporated	1,25	01.06.2024	Pharmazie	3.100.000 EUR	3.018.999	0,82
American Tower Corporation	0,40	15.02.2027	REITs	3.000.000 EUR	2.592.654	0,70
American Tower Corporation	1,38	04.04.2025	REITs	1.400.000 EUR	1.332.671	0,36
Bank of America Corporation ±	1,95	27.10.2026	Banken	6.200.000 EUR	5.874.388	1,59
Booking Holdings Incorporated	0,50	08.03.2028	Internet	4.700.000 EUR	4.043.833	1,10
Celanese US Holdings LLC	1,13	26.09.2023	Chemie	518.000 EUR	511.875	0,14
Citigroup Incorporated	0,75	26.10.2023	Banken	2.300.000 EUR	2.263.347	0,61
Digital Euro Finco LLC	2,63	15.04.2024	REITs	1.500.000 EUR	1.464.576	0,40
Discovery Communications LLC	1,90	19.03.2027	Medien	1.600.000 EUR	1.466.358	0,40
Ecolab Incorporated	1,00	15.01.2024	Chemie	2.800.000 EUR	2.746.184	0,74
Fidelity National Information Services Incorporated	0,75	21.05.2023	Software	3.600.000 EUR	3.587.227	0,97
Fiserv Incorporated	0,38	01.07.2023	Software	2.400.000 EUR	2.381.703	0,65
Ford Motor Credit Company LLC	4,87	03.08.2027	Automobilhersteller	1.200.000 EUR	1.164.000	0,32
Goldman Sachs Group Incorporated	1,25	07.02.2029	Banken	2.700.000 EUR	2.290.766	0,62
Jefferies Financial Group Incorporated	1,00	19.07.2024	Diversifizierte Finanzdienstleister	1.400.000 EUR	1.337.681	0,36
JPMorgan Chase & Company ±	1,09	11.03.2027	Banken	4.600.000 EUR	4.226.223	1,15
McDonald's Corporation	2,38	31.05.2029	Einzelhandel	3.600.000 EUR	3.340.375	0,90
Morgan Stanley ±	0,64	26.07.2024	Banken	1.600.000 EUR	1.583.015	0,43
Morgan Stanley	1,75	11.03.2024	Banken	4.000.000 EUR	3.920.640	1,06
Toyota Motor Credit Corporation	4,05	13.09.2029	Automobilhersteller	1.100.000 EUR	1.128.054	0,31
Verizon Communications Incorporated	1,63	01.03.2024	Telekommunikation	3.400.000 EUR	3.338.528	0,90
					53.613.097	14,53
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel					330.395.753	89,55
Staatsanleihen						
Frankreich						
French Republic Bond OAT	2,25	25.05.2024		10.000.000 EUR	9.911.200	2,68
Deutschland						
Bundesobligation	1,30	15.10.2027		12.400.000 EUR	11.840.711	3,21
Summe Staatsanleihen					21.751.911	5,89
Summe Wertpapieranlagen					352.147.664	95,44

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

EUR SHORT DURATION CREDIT FUND

	Verzinsung in %	Nennwert @	Markt- wert EUR	% des Netto- vermögens
Bankguthaben				
Termineinlagen				
Frankreich				
HSBC Bank plc (o)	1,93	21.638.557 EUR	21.638.557	5,87
Vereinigtes Königreich				
Sumitomo Mitsui Banking Corporation (o)	3,17	80.858 GBP	92.022	0,02
Vereinigte Staaten				
Citibank (o)	4,18	22.130 USD	20.369	0,01
Summe Termineinlagen			21.750.948	5,90
Summe Bankguthaben			21.750.948	5,90
<i>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, netto</i>			<i>(4.957.648)</i>	<i>(1,35)</i>
Gesamtes Fondsvermögen			368.940.964	100,00

@ Nennwert lautet auf angegebene Währung.

± Variabel verzinsliche Anlage. Der aufgeführte Zins entspricht dem effektiven Zinssatz zum Ende des Berichtszeitraums.

^ Die Anlage erfolgt unbefristet und hat daher kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das angegebene Datum spiegelt den nächsten Call-Termin wider.

(z) Nullkuponanleihe.

(o) Tagesgelder.

Abkürzung: EUR Euro
GBP Britisches Pfund
REITs Real Estate Investment Trust (REITs)
USD US-Dollar

Die Wertpapiere wurden auf Grundlage des Landes der Unternehmensgründung/-ansässigkeit aufgelistet.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL EQUITY ENHANCED INCOME FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien				
Australien				
Fortescue Metals Group Limited	Eisen/Stahl	37.110	557.822	0,83
Brasilien				
BB Seguridade Participacoes SA	Versicherung	133.133	853.940	1,27
EDP – Energias do Brasil SA	Strom	192.882	850.158	1,27
			1.704.098	2,54
Kanada				
Open Text Corporation	Software	23.658	912.535	1,36
Pembina Pipeline Corporation	Pipelines	28.068	909.225	1,35
			1.821.760	2,71
China				
JD.com Incorporated	Internet	19.850	433.448	0,65
Postal Savings Bank of China Company Limited	Banken	1.483.000	879.503	1,31
			1.312.951	1,96
Dänemark				
AP Moller – Maersk AS	Transport	278	505.323	0,75
Finnland				
Nokia OYJ	Telekommunikation	152.461	748.414	1,12
Frankreich				
AXA SA	Versicherung	39.832	1.215.576	1,81
BNP Paribas SA	Banken	14.166	845.959	1,26
Capgemini SE	Computer	3.353	623.107	0,93
Orange SA	Telekommunikation	37.997	451.411	0,67
Publicis Groupe SA	Werbung	11.149	870.289	1,30
Schneider Electric SE	Elektroteile & -ausrüstung	4.988	833.614	1,24
			4.839.956	7,21
Deutschland				
Bayerische Motoren Werke AG	Automobilhersteller	7.292	799.194	1,19
Siemens AG	Sonstige Hersteller	5.456	883.893	1,32
			1.683.087	2,51
Hongkong				
China Medical System Holdings Limited	Gesundheitsprodukte	410.000	646.885	0,96
SITC International Holdings Company Limited	Transport	330.000	709.223	1,06
			1.356.108	2,02
Indonesien				
PT Telkom Indonesia Persero Tbk	Telekommunikation	3.303.000	896.907	1,34
Irland				
Accenture plc +	Computer	3.041	869.148	1,29
Japan				
Honda Motor Company Limited	Automobilhersteller	32.600	862.308	1,28
Persol Holdings Company Limited	Gewerbliche Dienste	29.700	598.007	0,89

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL EQUITY ENHANCED INCOME FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Japan (Fortsetzung)				
Sompo Holdings Incorporated	Versicherung	17.400	689.477	1,03
			<u>2.149.792</u>	<u>3,20</u>
Niederlande				
Signify NV	Elektroteile & -ausrüstung	19.907	663.800	0,99
Stellantis NV	Automobilhersteller	44.512	809.508	1,21
			<u>1.473.308</u>	<u>2,20</u>
Singapur				
DBS Group Holdings Limited	Banken	32.000	795.576	1,19
Südkorea				
Samsung Electronics Company Limited GDR	Halbleiter	470	580.584	0,87
SK Telecom Company Limited	Telekommunikation	15.911	590.332	0,88
Woori Financial Group Incorporated	Banken	67.998	598.156	0,89
			<u>1.769.072</u>	<u>2,64</u>
Schweden				
Svenska Handelsbanken AB	Banken	67.487	584.496	0,87
Taiwan				
Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited ADR +	Halbleiter	6.113	568.631	0,85
Vereinigtes Königreich				
3i Group plc	Private Equity	42.964	895.520	1,33
Barratt Developments plc	Hausbau	131.297	755.586	1,13
GSK plc	Pharmazie	45.341	801.145	1,19
Man Group plc	Diversifizierte Finanzdienstleister	232.837	678.307	1,01
nVent Electric plc +	Elektronik	25.192	1.081.744	1,61
Shell plc	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	19.510	556.008	0,83
SSE plc	Strom	32.751	730.801	1,09
			<u>5.499.111</u>	<u>8,19</u>
Vereinigte Staaten				
AbbVie Incorporated +	Pharmazie	5.894	939.327	1,40
AGCO Corporation +	Maschinen – Diversifiziert	5.964	806.333	1,20
Alphabet Incorporated +	Internet	11.332	1.175.468	1,75
Amazon.com Incorporated +	Internet	9.763	1.008.420	1,50
Apple Incorporated +	Computer	12.924	2.131.168	3,18
Ares Capital Corporation +	Anlagegesellschaften	54.937	1.003.974	1,50
Arista Networks Incorporated +	Telekommunikation	5.823	977.449	1,46
AT&T Incorporated +	Telekommunikation	54.422	1.047.623	1,56
Bank of America Corporation +	Banken	24.262	693.893	1,03
Bristol-Myers Squibb Company +	Pharmazie	16.345	1.132.872	1,69
Brixmor Property Group Incorporated +	REITs	34.380	739.858	1,10
Broadcom Incorporated +	Halbleiter	1.731	1.110.506	1,66
Cisco Systems Incorporated +	Telekommunikation	16.855	881.095	1,31
Coca-Cola Company +	Getränke	23.006	1.427.062	2,13
Comcast Corporation +	Medien	21.858	828.637	1,23
ConocoPhillips +	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	12.480	1.238.141	1,85
Costco Wholesale Corporation +	Einzelhandel	2.002	994.734	1,48

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL EQUITY ENHANCED INCOME FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
Devon Energy Corporation +	<i>Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen</i>	19.802	1.002.179	1,49
General Motors Company +	<i>Automobilhersteller</i>	16.636	610.208	0,91
Gilead Sciences Incorporated +	<i>Biotechnologie</i>	11.359	942.456	1,40
Hillenbrand Incorporated +	<i>Sonstige Hersteller</i>	15.442	733.958	1,09
KLA Corporation +	<i>Halbleiter</i>	2.182	870.989	1,30
Microchip Technology Incorporated +	<i>Halbleiter</i>	10.063	843.078	1,26
Microsoft Corporation +	<i>Software</i>	8.806	2.538.770	3,78
NVIDIA Corporation +	<i>Halbleiter</i>	2.905	806.922	1,20
Oaktree Specialty Lending Corporation +	<i>Anlagegesellschaften</i>	48.344	907.417	1,35
Pfizer Incorporated +	<i>Pharmazie</i>	21.297	868.918	1,30
Qualcomm Incorporated +	<i>Halbleiter</i>	5.502	701.945	1,05
Reliance Steel & Aluminum Company +	<i>Eisen/Stahl</i>	2.801	719.129	1,07
Simon Property Group Incorporated +	<i>REITs</i>	8.080	904.718	1,35
Starwood Property Trust Incorporated +	<i>REITs</i>	35.873	634.593	0,95
Target Corporation +	<i>Einzelhandel</i>	4.031	667.654	1,00
Tesla Incorporated +	<i>Automobilhersteller</i>	2.270	470.934	0,70
United Rentals Incorporated +	<i>Gewerbliche Dienste</i>	2.014	797.061	1,19
UnitedHealth Group Incorporated	<i>Gesundheitsdienstleistungen</i>	3.063	1.447.543	2,16
US Bancorp +	<i>Banken</i>	21.401	771.506	1,15
Weyerhaeuser Company +	<i>REITs</i>	23.929	720.981	1,07
			<u>36.097.519</u>	<u>53,80</u>
Summe Stammaktien			65.233.079	97,22
Summe Wertpapieranlagen			65.233.079	97,22
	Verzinsung in %	Nennwert @		
Bankguthaben				
Termineinlagen				
Frankreich				
BNP Paribas (o)	2,32	25.845 AUD	17.276	0,02
HSBC Bank plc (o)	1,93	228 EUR	248	0,00
			<u>17.524</u>	<u>0,02</u>
Singapur				
DBS Bank Limited (o)	4,18	1.347.837 USD	1.347.837	2,01
Schweden				
Skandinaviska Enskilda Banken AB (o)	1,78	539.896 SEK	52.018	0,08
Summe Termineinlagen			1.417.379	2,11
Kontokorrentkonten			7.961	0,01
Summe Bankguthaben			1.425.340	2,12
<i>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, netto</i>			<u>442.608</u>	<u>0,66</u>
Gesamtes Fondsvermögen			67.101.027	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL EQUITY ENHANCED INCOME FUND

- + Die Wertpapiere werden vollständig oder teilweise als Sicherheit für Anlagen in geschriebene Optionen abgesondert.
- @ Nennwert lautet auf angegebene Währung.
- (o) Tagesgelder.

Abkürzung:	ADR	American Depository Receipt
	AUD	Australischer Dollar
	EUR	Euro
	GDR	Global Depository Receipt
	REITs	Real Estate Investment Trust (REITs)
	SEK	Schwedische Krone
	USD	US-Dollar

Die Wertpapiere wurden auf Grundlage des Landes der Unternehmensgründung/-ansässigkeit aufgelistet.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL FACTOR ENHANCED EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien				
Australien				
Ampol Limited	<i>Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen</i>	152	3.105	0,01
Aurizon Holdings Limited	<i>Transport</i>	45.316	102.267	0,28
BHP Group Limited	<i>Bergbau</i>	2.070	65.568	0,18
BlueScope Steel Limited	<i>Eisen/Stahl</i>	3.233	43.845	0,12
Brambles Limited	<i>Gewerbliche Dienste</i>	3.665	33.109	0,09
Computershare Limited	<i>Computer</i>	3.221	46.877	0,13
Dexus	<i>REITs</i>	3.110	15.754	0,04
GPT Group	<i>REITs</i>	5.240	15.004	0,04
Lendlease Corporation Limited	<i>Bau- & Ingenieurwesen</i>	1.651	8.050	0,02
Medibank Pvt Limited	<i>Gesundheitsdienstleistungen</i>	10.319	23.332	0,07
Mineral Resources Limited	<i>Eisen/Stahl</i>	321	17.386	0,05
Mirvac Group	<i>REITs</i>	18.751	26.314	0,07
Pilbara Minerals Limited	<i>Bergbau</i>	3.273	8.724	0,03
Qantas Airways Limited	<i>Fluggesellschaften</i>	2.748	12.289	0,03
Rio Tinto Limited	<i>Bergbau</i>	693	55.791	0,15
South32 Limited	<i>Bergbau</i>	2.871	8.431	0,02
Stockland	<i>REITs</i>	11.242	30.162	0,08
			<u>516.008</u>	<u>1,41</u>
Belgien				
Solvay SA	<i>Chemie</i>	164	18.790	0,05
Umicore SA	<i>Chemie</i>	1.649	56.036	0,15
			<u>74.826</u>	<u>0,20</u>
Kanada				
Brookfield Asset Management Limited	<i>Diversifizierte Finanzdienstleister</i>	122	3.991	0,01
Brookfield Corporation	<i>Private Equity</i>	488	15.877	0,04
BRP Incorporated	<i>Freizeit</i>	1.657	129.489	0,35
CGI Incorporated	<i>Computer</i>	2.157	207.595	0,57
Element Fleet Management Corporation	<i>Gewerbliche Dienste</i>	7.800	102.302	0,28
Empire Company Limited	<i>Lebensmittel</i>	5.031	134.683	0,37
Gildan Activewear Incorporated	<i>Bekleidung</i>	2.724	90.374	0,25
Imperial Oil Limited	<i>Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen</i>	76	3.860	0,01
Nutrien Limited	<i>Chemie</i>	1.171	86.362	0,24
Nuvei Corporation	<i>Gewerbliche Dienste</i>	100	4.351	0,01
Open Text Corporation	<i>Software</i>	195	7.511	0,02
Restaurant Brands International Incorporated	<i>Einzelhandel</i>	400	26.816	0,07
Rogers Communications Incorporated	<i>Telekommunikation</i>	195	9.025	0,02
Saputo Incorporated	<i>Lebensmittel</i>	800	20.672	0,06
TFI International Incorporated	<i>Transport</i>	876	104.387	0,28
			<u>947.295</u>	<u>2,58</u>
Dänemark				
AP Moller – Maersk AS	<i>Transport</i>	8	14.569	0,04
Carlsberg AS	<i>Getränke</i>	104	16.167	0,04
Coloplast AS	<i>Gesundheitsprodukte</i>	105	13.851	0,04
Danske Bank AS	<i>Banken</i>	4.386	88.406	0,24
Demant AS	<i>Gesundheitsprodukte</i>	1.454	51.140	0,14
Novo Nordisk AS	<i>Pharmazie</i>	865	137.637	0,38
Pandora AS	<i>Einzelhandel</i>	1.728	166.177	0,45
Rockwool AS	<i>Baustoffe</i>	169	41.519	0,11
			<u>529.466</u>	<u>1,44</u>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL FACTOR ENHANCED EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Finnland				
Orion OYJ	Pharmazie	1.227	54.943	0,15
Frankreich				
Amundi SA	Diversifizierte Finanzdienstleister	891	56.242	0,15
BioMerieux	Gesundheitsdienstleistungen	104	10.983	0,03
Bolloré SE	Medien	557	3.449	0,01
Capgemini SE	Computer	242	45.053	0,12
Carrefour SA	Lebensmittel	3.307	66.980	0,18
Eurazeo SE	Private Equity	901	64.249	0,18
Ipsen SA	Pharmazie	50	5.515	0,02
Orange SA	Telekommunikation	3.622	43.107	0,12
Renault SA	Automobilhersteller	1.777	72.554	0,20
Sanofi	Pharmazie	544	59.119	0,16
Société Générale SA	Banken	3.283	74.103	0,20
Sodexo SA	Lebensmitteldienste	1.476	144.421	0,39
TotalEnergies SE	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	432	25.518	0,07
Ubisoft Entertainment SA	Software	1.052	28.090	0,08
Wendel SE	Anlagegesellschaften	1.084	114.828	0,31
			814.211	2,22
Deutschland				
Bayer AG	Pharmazie	616	39.422	0,11
Bayerische Motoren Werke AG	Automobilhersteller	1.062	116.603	0,32
Bechtle AG	Computer	1.104	52.963	0,14
Daimler Truck Holding AG	Automobilhersteller	1.494	50.512	0,14
Deutsche Bank AG	Banken	10.097	102.863	0,28
Deutsche Telekom AG	Telekommunikation	1.382	33.549	0,09
HeidelbergCement AG	Baustoffe	495	36.209	0,10
Mercedes-Benz Group AG	Automobilhersteller	1.254	96.609	0,26
Rheinmetall AG	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	249	73.899	0,20
SAP SE	Software	548	69.321	0,19
Scout24 SE	Internet	224	13.347	0,04
			685.297	1,87
Hongkong				
CK Asset Holdings Limited	Immobilien	9.000	54.564	0,15
CK Hutchison Holdings Limited	Lebensmittel	20.500	126.826	0,35
Jardine Matheson Holdings Limited	Diversifizierte Holdings	1.168	56.814	0,15
SITC International Holdings Company Limited	Transport	6.000	12.895	0,03
Sun Hung Kai Properties Limited	Immobilien	1.500	21.014	0,06
Swire Pacific Limited	Diversifizierte Holdings	12.000	92.219	0,25
			364.332	0,99
Irland				
Accenture plc	Computer	584	166.913	0,45
CRH plc	Baustoffe	313	15.841	0,04
DCC plc	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	795	46.449	0,13
Medtronic plc	Gesundheitsprodukte	1.042	84.006	0,23
			313.209	0,85
Israel				
Check Point Software Technologies Limited	Computer	628	81.640	0,22

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL FACTOR ENHANCED EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Israel (Fortsetzung)				
ICL Group Limited	Chemie	1.776	12.018	0,04
			93.658	0,26
Italien				
Assicurazioni Generali SpA	Versicherung	2.106	42.037	0,12
ENI SpA	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	2.839	39.665	0,11
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	Banken	420	4.228	0,01
Prysmian SpA	Elektroteile & -ausrüstung	2.547	107.142	0,29
UniCredit SpA	Banken	1.431	27.020	0,07
			220.092	0,60
Japan				
Aisin Corporation	Automobilteile & -zubehör	700	19.248	0,05
Capcom Company Limited	Software	700	24.994	0,07
Chubu Electric Power Company Incorporated	Strom	3.900	41.045	0,11
Dai Nippon Printing Company Limited	Gewerbliche Dienste	100	2.793	0,01
Daito Trust Construction Company Limited	Immobilien	700	69.576	0,19
ENEOS Holdings Incorporated	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	4.200	14.701	0,04
Fuji Electric Company Limited	Werkzeug/Werkzeugmaschinen	1.400	55.156	0,15
Fujitsu Limited	Computer	900	121.329	0,33
Hitachi Construction Machinery Company Limited	Maschinen – Bau- und Bergbau	1.000	23.252	0,06
Idemitsu Kosan Company Limited	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	2.600	56.786	0,15
Isuzu Motors Limited	Automobilhersteller	3.800	45.306	0,12
ITOCHU Corporation	Vertrieb/Großhandel	300	9.747	0,03
Itochu Techno-Solutions Corporation	Computer	1.600	39.331	0,11
JFE Holdings Incorporated	Eisen/Stahl	4.800	60.780	0,17
Kakaku.com Incorporated	Internet	1.300	17.803	0,05
Kansai Electric Power Company Incorporated	Strom	2.500	24.290	0,07
Kintetsu Group Holdings Company Limited	Transport	1.500	48.207	0,13
Konami Group Corporation	Software	800	36.631	0,10
Marubeni Corporation	Vertrieb/Großhandel	5.000	67.838	0,19
Mazda Motor Corporation	Automobilhersteller	13.400	123.309	0,34
Mitsubishi Corporation	Vertrieb/Großhandel	400	14.341	0,04
Mitsubishi HC Capital Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	10.000	51.515	0,14
Mitsubishi Heavy Industries Limited	Maschinen – Bau- und Bergbau	2.900	106.586	0,29
Mitsui & Company Limited	Vertrieb/Großhandel	700	21.767	0,06
Mitsui Chemicals Incorporated	Chemie	2.900	74.702	0,20
NGK Insulators Limited	Automobilteile & -zubehör	2.700	35.719	0,10
Nippon Express Holdings Incorporated	Transport	100	6.020	0,02
Nippon Steel Corporation	Eisen/Stahl	2.900	68.224	0,19
Nippon Telegraph & Telephone Corporation	Telekommunikation	1.200	35.774	0,10
Nomura Real Estate Holdings Incorporated	Immobilien	700	15.464	0,04
NTT Data Corporation	Computer	400	5.246	0,01
Oracle Corporation	Software	1.000	72.050	0,20
ORIX Corporation	Diversifizierte Finanzdienstleister	500	8.224	0,02
Otsuka Corporation	Computer	1.700	60.232	0,16
Persol Holdings Company Limited	Gewerbliche Dienste	2.800	56.244	0,15
SCSK Corporation	Computer	3.700	54.047	0,15
Square Enix Holdings Company Limited	Software	1.800	86.296	0,24
Subaru Corporation	Automobilhersteller	600	9.556	0,03
SUMCO Corporation	Halbleiter	1.700	25.514	0,07
Sumitomo Corporation	Vertrieb/Großhandel	1.100	19.441	0,05

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL FACTOR ENHANCED EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Japan (Fortsetzung)				
TIS Incorporated	Software	3.900	102.894	0,28
Tokyo Gas Company Limited	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	1.800	33.748	0,09
Tosoh Corporation	Chemie	2.700	36.605	0,10
Toyota Tsusho Corporation	Vertrieb/Großhandel	800	34.029	0,09
Trend Micro Incorporated	Internet	700	34.261	0,09
Yamaha Motor Company Limited	Freizeit	2.300	60.050	0,16
ZOZO Incorporated	Internet	1.900	43.354	0,12
			<u>2.074.025</u>	<u>5,66</u>
Luxemburg				
ArcelorMittal SA	Eisen/Stahl	2.252	68.350	0,18
Eurofins Scientific SE	Gesundheitsdienstleistungen	322	21.600	0,06
Tenaris SA	Metallverarbeitung/produkte	1.214	17.232	0,05
			<u>107.182</u>	<u>0,29</u>
Niederlande				
ASML Holding NV	Halbleiter	85	58.027	0,16
EXOR NV	Anlagegesellschaften	1.105	91.282	0,25
EXOR NV	Anlagegesellschaften	2.755	227.002	0,62
Koninklijke Ahold Delhaize NV	Lebensmittel	1.790	61.266	0,17
NXP Semiconductors NV	Halbleiter	254	47.365	0,13
OCI NV	Chemie	2.090	70.978	0,19
Randstad NV	Gewerbliche Dienste	2.084	123.938	0,34
Stellantis NV	Automobilhersteller	8.729	159.033	0,43
			<u>838.891</u>	<u>2,29</u>
Neuseeland				
Spark New Zealand Limited	Telekommunikation	29.579	93.765	0,26
Norwegen				
Kongsberg Gruppen ASA	Schiffbau	630	25.458	0,07
Norsk Hydro ASA	Metallverarbeitung/produkte	5.703	42.551	0,12
Yara International ASA	Chemie	2.197	95.453	0,26
			<u>163.462</u>	<u>0,45</u>
Portugal				
Galp Energia SGPS SA	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	951	10.780	0,03
Jeronimo Martins SGPS SA	Lebensmittel	932	21.916	0,06
			<u>32.696</u>	<u>0,09</u>
Singapur				
City Developments Limited	Hotels	5.100	28.326	0,08
Jardine Cycle & Carriage Limited	Einzelhandel	3.600	84.856	0,23
Keppel Corporation Limited	Bau- & Ingenieurwesen	1.000	4.247	0,01
Venture Corporation Limited	Elektronik	13.000	173.186	0,47
Wilmar International Limited	Landwirtschaft	13.000	41.224	0,12
			<u>331.839</u>	<u>0,91</u>
Spanien				
ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	Bau- & Ingenieurwesen	1.073	34.236	0,09
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Banken	19.827	142.006	0,39

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL FACTOR ENHANCED EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Spanien (Fortsetzung)				
Banco Santander SA	Banken	23.843	89.010	0,24
Grifols SA	Pharmazie	1.583	15.697	0,04
Repsol SA	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	8.517	131.209	0,36
			<u>412.158</u>	<u>1,12</u>
Schweden				
Boliden AB	Bergbau	587	23.081	0,06
Essity AB	Kosmetik/Körperpflege	1.122	32.078	0,09
Getinge AB	Gesundheitsprodukte	5.606	136.845	0,37
Husqvarna AB	Maschinen – Diversifiziert	1.419	12.328	0,04
Securitas AB	Gewerbliche Dienste	22.197	197.636	0,54
SKF AB	Metallverarbeitung/produkte	2.188	43.136	0,12
Swedbank AB	Banken	1.355	22.303	0,06
Swedish Orphan Biovitrum AB	Biotechnologie	1.421	33.140	0,09
Tele2 AB	Telekommunikation	4.815	47.968	0,13
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	Telekommunikation	613	3.597	0,01
Volvo AB	Automobilhersteller	4.670	96.321	0,26
Volvo Car AB	Automobilhersteller	1.757	7.693	0,02
			<u>656.126</u>	<u>1,79</u>
Schweiz				
ABB Limited	Elektroteile & -ausrüstung	3.389	116.765	0,32
Adecco Group AG	Gewerbliche Dienste	4.163	151.870	0,41
Chubb Limited	Versicherung	6	1.165	0,00
Clariant AG	Chemie	158	2.625	0,01
Glencore plc	Bergbau	25.820	148.917	0,41
Holcim AG	Baustoffe	406	26.224	0,07
Julius Baer Group Limited	Diversifizierte Finanzdienstleister	530	36.259	0,10
Nestle SA	Lebensmittel	82	10.014	0,03
Novartis AG	Pharmazie	1.767	162.492	0,44
Roche Holding AG	Pharmazie	264	79.451	0,22
Roche Holding AG	Pharmazie	223	63.818	0,17
Schindler Holding AG	Werkzeug/Werkzeugmaschinen	26	5.770	0,01
Sonova Holding AG	Gesundheitsprodukte	111	32.794	0,09
Swatch Group AG	Einzelhandel	287	98.992	0,27
Swiss Re AG	Versicherung	201	20.681	0,06
Temenos AG	Software	98	6.830	0,02
UBS Group AG	Banken	8.287	175.628	0,48
Zurich Insurance Group AG	Versicherung	16	7.679	0,02
			<u>1.147.974</u>	<u>3,13</u>
Vereinigtes Königreich				
3i Group plc	Private Equity	5.355	111.875	0,31
Auto Trader Group plc	Internet	8.392	64.159	0,17
BAE Systems plc	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	8.105	98.266	0,27
Compass Group plc	Lebensmitteldienste	4.536	114.260	0,31
GSK plc	Pharmazie	1.978	35.031	0,10
HSBC Holdings plc	Banken	8.481	57.774	0,16
Imperial Brands plc	Landwirtschaft	4.805	110.750	0,30
J Sainsbury plc	Lebensmittel	1.139	3.929	0,01
Johnson Matthey plc	Chemie	4.157	102.150	0,28
Kingfisher plc	Einzelhandel	191	619	0,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL FACTOR ENHANCED EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)				
Sage Group plc	Software	15.432	148.434	0,40
Shell plc	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	1.280	36.562	0,10
Tesco plc	Diversifizierte Finanzdienstleister	6.683	21.960	0,06
Unilever plc	Kosmetik/Körperpflege	1.890	98.164	0,27
Willis Towers Watson plc	Versicherung	70	16.267	0,04
			1.020.200	2,78
Vereinigte Staaten				
Abbott Laboratories	Gesundheitsprodukte	879	89.008	0,24
AbbVie Incorporated	Pharmazie	1.398	222.799	0,61
Adobe Incorporated	Software	340	131.026	0,36
AES Corporation	Strom	1.104	26.584	0,07
Aflac Incorporated	Versicherung	686	44.261	0,12
Agilent Technologies Incorporated	Elektronik	764	105.692	0,29
Akamai Technologies Incorporated	Software	108	8.456	0,02
Allstate Corporation	Versicherung	238	26.373	0,07
Alphabet Incorporated Class A	Internet	4.234	439.193	1,20
Alphabet Incorporated Class C	Internet	3.837	399.048	1,09
Amazon.com Incorporated	Internet	5.627	581.213	1,59
American Financial Group Incorporated	Versicherung	761	92.462	0,25
American International Group Incorporated	Versicherung	678	34.144	0,09
American Water Works Company Incorporated	Wasser	127	18.604	0,05
Ameriprise Financial Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	250	76.625	0,21
Amgen Incorporated	Biotechnologie	713	172.368	0,47
APA Corporation	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	2.497	90.042	0,25
Apple Incorporated	Computer	9.256	1.526.314	4,16
Applied Materials Incorporated	Halbleiter	776	95.316	0,26
Aramark	Lebensmitteldienste	4.414	158.021	0,43
Arch Capital Group Limited	Versicherung	751	50.970	0,14
Archer-Daniels-Midland Company	Landwirtschaft	1.465	116.702	0,32
Arrow Electronics Incorporated	Elektronik	2.147	268.096	0,73
AT&T Incorporated	Telekommunikation	8.566	164.896	0,45
Autodesk Incorporated	Software	99	20.608	0,06
AutoZone Incorporated	Einzelhandel	26	63.912	0,17
Avantor Incorporated	Gesundheitsprodukte	1.228	25.960	0,07
Bank of America Corporation	Banken	997	28.514	0,08
Bank of New York Mellon Corporation	Banken	1.557	70.750	0,19
Bath & Body Works Incorporated	Einzelhandel	547	20.009	0,05
Becton Dickinson & Company	Pharmazie	372	92.085	0,25
Berkshire Hathaway Incorporated	Versicherung	489	150.989	0,41
Best Buy Company Incorporated	Einzelhandel	972	76.078	0,21
Biogen Incorporated	Biotechnologie	285	79.239	0,22
BlackRock Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	90	60.221	0,16
Blackstone Incorporated	Private Equity	342	30.041	0,08
Booking Holdings Incorporated	Internet	15	39.786	0,11
Booz Allen Hamilton Holding Corporation	Gewerbliche Dienste	1.183	109.652	0,30
BorgWarner Incorporated	Automobilteile & -zubehör	920	45.181	0,12
Boston Scientific Corporation	Gesundheitsprodukte	236	11.807	0,03
Bristol-Myers Squibb Company	Pharmazie	3.089	214.099	0,58
Broadcom Incorporated	Halbleiter	273	175.140	0,48
Broadridge Financial Solutions Incorporated	Software	260	38.108	0,10
Bunge Limited	Landwirtschaft	1.736	165.823	0,45

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL FACTOR ENHANCED EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
Cadence Design Systems Incorporated	Software	536	112.608	0,31
Campbell Soup Company	Lebensmittel	1.493	82.085	0,22
Carlyle Group Incorporated	Private Equity	1.763	54.759	0,15
Caterpillar Incorporated	Maschinen – Bau- und Bergbau	339	77.577	0,21
Cboe Global Markets Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	416	55.844	0,15
CBRE Group Incorporated	Immobilien	214	15.581	0,04
CDW Corporation	Internet	537	104.656	0,29
Celanese Corporation	Chemie	66	7.187	0,02
Centene Corporation	Gesundheitsdienstleistungen	138	8.723	0,02
CenterPoint Energy Incorporated	Strom	258	7.601	0,02
CF Industries Holdings Incorporated	Chemie	1.152	83.509	0,23
CH Robinson Worldwide Incorporated	Transport	793	78.800	0,22
Charles River Laboratories International Incorporated	Gesundheitsdienstleistungen	50	10.091	0,03
Chevron Corporation	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	679	110.786	0,30
Chewy Incorporated	Internet	4.351	162.640	0,44
Chipotle Mexican Grill Incorporated	Einzelhandel	5	8.541	0,02
Cigna Group	Pharmazie	417	106.556	0,29
Cisco Systems Incorporated	Telekommunikation	1.278	66.807	0,18
Citigroup Incorporated	Banken	305	14.301	0,04
Cleveland-Cliffs Incorporated	Eisen/Stahl	825	15.122	0,04
Clorox Company	Haushaltsprodukte und -waren	165	26.110	0,07
CMS Energy Corporation	Strom	43	2.639	0,01
Coca-Cola Company	Getränke	1.309	81.197	0,22
Cognizant Technology Solutions Corporation	Computer	2.099	127.892	0,35
Colgate-Palmolive Company	Kosmetik/Körperpflege	984	73.948	0,20
Comcast Corporation	Medien	1.189	45.075	0,12
Conagra Brands Incorporated	Lebensmittel	353	13.259	0,04
ConocoPhillips	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	316	31.350	0,09
Consolidated Edison Incorporated	Strom	493	47.165	0,13
Constellation Energy Corporation	Strom	1.227	96.320	0,26
Corning Incorporated	Telekommunikation	63	2.223	0,01
Costco Wholesale Corporation	Einzelhandel	98	48.693	0,13
CSX Corporation	Transport	1.468	43.952	0,12
Cummins Incorporated	Automobilhersteller	506	120.873	0,33
CVS Health Corporation	Pharmazie	351	26.083	0,07
Danaher Corporation	Gesundheitsprodukte	338	85.190	0,23
Darden Restaurants Incorporated	Einzelhandel	869	134.834	0,37
Deere & Company	Maschinen – Diversifiziert	85	35.095	0,10
Delta Air Lines Incorporated	Fluggesellschaften	3.322	116.004	0,32
DENTSPLY SIRONA Incorporated	Gesundheitsprodukte	517	20.308	0,06
Devon Energy Corporation	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	180	9.110	0,02
DISH Network Corporation	Medien	160	1.493	0,00
DocuSign Incorporated	Software	242	14.109	0,04
Dollar General Corporation	Einzelhandel	27	5.682	0,02
Domino's Pizza Incorporated	Einzelhandel	241	79.499	0,22
Dow Incorporated	Chemie	1.155	63.317	0,17
DR Horton Incorporated	Hausbau	540	52.753	0,14
Dropbox Incorporated	Software	10.789	233.258	0,64
DTE Energy Company	Strom	714	78.212	0,21
Eastman Chemical Company	Chemie	323	27.242	0,07
Eaton Corporation plc	Sonstige Hersteller	101	17.305	0,05
eBay Incorporated	Internet	2.135	94.730	0,26

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL FACTOR ENHANCED EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
Electronic Arts Incorporated	Software	262	31.558	0,09
Elevance Health Incorporated	Gesundheitsdienstleistungen	65	29.888	0,08
Eli Lilly & Company	Pharmazie	386	132.560	0,36
EPAM Systems Incorporated	Computer	280	83.720	0,23
Equitable Holdings Incorporated	Versicherung	6.876	174.582	0,48
Erie Indemnity Company	Versicherung	60	13.900	0,04
Essential Utilities Incorporated	Wasser	375	16.369	0,04
Everest Re Group Limited	Versicherung	190	68.024	0,19
Exelon Corporation	Strom	798	33.428	0,09
Expedia Group Incorporated	Internet	127	12.323	0,03
Expeditors International of Washington Incorporated	Transport	57	6.277	0,02
Exxon Mobil Corporation	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	2.488	272.834	0,74
Fair Isaac Corporation	Software	248	174.267	0,48
Fidelity National Information Services Incorporated	Software	609	33.087	0,09
First Solar Incorporated	Energie – Alternative Quellen	164	35.670	0,10
FirstEnergy Corporation	Strom	120	4.807	0,01
Fiserv Incorporated	Software	535	60.471	0,17
FleetCor Technologies Incorporated	Gewerbliche Dienste	180	37.953	0,10
Ford Motor Company	Automobilhersteller	8.593	108.272	0,30
Fortinet Incorporated	Computer	146	9.703	0,03
Fox Corporation	Medien	1.671	56.898	0,16
Franklin Resources Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	2.849	76.752	0,21
Gartner Incorporated	Gewerbliche Dienste	154	50.169	0,14
GE HealthCare Technologies Incorporated	Gesundheitsprodukte	609	49.956	0,14
Gen Digital Incorporated	Internet	3.152	54.088	0,15
Generac Holdings Incorporated	Elektroteile & -ausrüstung	376	40.612	0,11
General Dynamics Corporation	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	404	92.197	0,25
General Mills Incorporated	Lebensmittel	1.212	103.578	0,28
General Motors Company	Automobilhersteller	1.618	59.348	0,16
Gilead Sciences Incorporated	Biotechnologie	2.743	227.587	0,62
Global Payments Incorporated	Gewerbliche Dienste	187	19.680	0,05
Globe Life Incorporated	Versicherung	301	33.116	0,09
Goldman Sachs Group Incorporated	Banken	258	84.394	0,23
Hartford Financial Services Group Incorporated	Versicherung	746	51.989	0,14
Hershey Company	Lebensmittel	43	10.940	0,03
Hewlett Packard Enterprise Company	Computer	710	11.310	0,03
HF Sinclair Corporation	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	2.717	131.448	0,36
Hilton Worldwide Holdings Incorporated	Hotels	141	19.863	0,05
Hologic Incorporated	Gesundheitsprodukte	1.006	81.184	0,22
Home Depot Incorporated	Einzelhandel	442	130.443	0,36
HP Incorporated	Computer	1.919	56.323	0,15
Hubbell Incorporated	Elektronik	365	88.808	0,24
Humana Incorporated	Gesundheitsdienstleistungen	20	9.709	0,03
Huntington Ingalls Industries Incorporated	Schiffbau	592	122.556	0,33
Incyte Corporation	Biotechnologie	461	33.316	0,09
Intercontinental Exchange Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	18	1.877	0,01
International Business Machines Corporation	Computer	1.517	198.864	0,54
Intuit Incorporated	Software	110	49.041	0,13
Invesco Limited	Diversifizierte Finanzdienstleister	6.882	112.865	0,31
IQVIA Holdings Incorporated	Gesundheitsdienstleistungen	345	68.617	0,19
Iron Mountain Incorporated	REITs	1.261	66.720	0,18
Jack Henry & Associates Incorporated	Software	484	72.949	0,20

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL FACTOR ENHANCED EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
Jacobs Solutions Incorporated	Bau- & Ingenieurwesen	459	53.937	0,15
JB Hunt Transport Services Incorporated	Transport	710	124.577	0,34
JM Smucker Company	Lebensmittel	175	27.540	0,08
Johnson & Johnson	Pharmazie	1.360	210.800	0,57
JPMorgan Chase & Company	Banken	934	121.710	0,33
Juniper Networks Incorporated	Telekommunikation	1.884	64.847	0,18
Kellogg Company	Lebensmittel	1.246	83.432	0,23
Keysight Technologies Incorporated	Elektronik	78	12.595	0,03
Kimberly-Clark Corporation	Haushaltsprodukte und -waren	611	82.008	0,22
KLA Corporation	Halbleiter	188	75.044	0,20
Knight-Swift Transportation Holdings Incorporated	Transport	2.370	134.095	0,37
Kroger Company	Lebensmittel	457	22.562	0,06
L3Harris Technologies Incorporated	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	64	12.559	0,03
Lam Research Corporation	Halbleiter	206	109.205	0,30
Lamb Weston Holdings Incorporated	Lebensmittel	310	32.401	0,09
LEAR Corporation	Automobilteile & -zubehör	168	23.434	0,06
Leidos Holdings Incorporated	Computer	1.130	104.028	0,28
Lennar Corporation	Hausbau	259	27.224	0,07
Lincoln National Corporation	Versicherung	1.624	36.491	0,10
LKQ Corporation	Vertrieb/Großhandel	268	15.212	0,04
Lowe's Companies Incorporated	Einzelhandel	336	67.190	0,18
LPL Financial Holdings Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	757	153.217	0,42
Lumen Technologies Incorporated	Telekommunikation	15.378	40.752	0,11
LyondellBasell Industries NV	Chemie	1.370	128.629	0,35
Marathon Oil Corporation	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	1.403	33.616	0,09
Marathon Petroleum Corporation	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	1.187	160.043	0,44
Marriott International Incorporated	Hotels	396	65.752	0,18
Masco Corporation	Baustoffe	697	34.655	0,09
Masimo Corporation	Gesundheitsprodukte	46	8.489	0,02
Mastercard Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	295	107.206	0,29
McDonald's Corporation	Einzelhandel	454	126.943	0,35
Merck & Company Incorporated	Pharmazie	2.134	227.036	0,62
Meta Platforms Incorporated	Internet	1.840	389.970	1,06
MetLife Incorporated	Versicherung	1.035	59.968	0,16
Mettler-Toledo International Incorporated	Elektronik	50	76.511	0,21
Microchip Technology Incorporated	Halbleiter	796	66.689	0,18
Microsoft Corporation	Software	4.631	1.335.117	3,64
Moderna Incorporated	Biotechnologie	551	84.623	0,23
Morgan Stanley	Banken	651	57.158	0,16
Mosaic Company	Chemie	1.972	90.475	0,25
Netflix Incorporated	Internet	229	79.115	0,22
NIKE Incorporated	Bekleidung	123	15.085	0,04
NiSource Incorporated	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	286	7.997	0,02
NRG Energy Incorporated	Strom	154	5.281	0,01
Nucor Corporation	Eisen/Stahl	541	83.568	0,23
NVIDIA Corporation	Halbleiter	938	260.548	0,71
NVR Incorporated	Hausbau	5	27.861	0,08
Occidental Petroleum Corporation	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	634	39.581	0,11
Old Dominion Freight Line Incorporated	Transport	160	54.534	0,15
Omnicom Group Incorporated	Werbung	615	58.019	0,16
ON Semiconductor Corporation	Halbleiter	1.320	108.662	0,30
Oracle Corporation	Software	1.900	176.548	0,48

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL FACTOR ENHANCED EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
O'Reilly Automotive Incorporated	Einzelhandel	27	22.922	0,06
Ovintiv Incorporated	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	2.521	90.958	0,25
Owens Corning	Baustoffe	879	84.208	0,23
PACCAR Incorporated	Automobilhersteller	1.860	136.152	0,37
Paychex Incorporated	Software	179	20.512	0,06
PepsiCo Incorporated	Getränke	898	163.705	0,45
Pfizer Incorporated	Pharmazie	3.732	152.266	0,42
PG&E Corporation	Strom	358	5.789	0,02
Philip Morris International Incorporated	Landwirtschaft	117	11.378	0,03
Phillips 66	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	753	76.339	0,21
PPL Corporation	Strom	946	26.289	0,07
Principal Financial Group Incorporated	Versicherung	520	38.646	0,11
Procter & Gamble Company	Kosmetik/Körperpflege	1.148	170.696	0,47
Progressive Corporation	Versicherung	18	2.575	0,01
Prudential Financial Incorporated	Versicherung	229	18.947	0,05
PTC Incorporated	Software	496	63.602	0,17
Public Storage	REITs	90	27.193	0,07
PulteGroup Incorporated	Hausbau	1.502	87.537	0,24
Qorvo Incorporated	Halbleiter	67	6.805	0,02
Qualcomm Incorporated	Halbleiter	961	122.604	0,33
Raymond James Financial Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	668	62.304	0,17
Raytheon Technologies Corporation	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	242	23.699	0,06
Regeneron Pharmaceuticals Incorporated	Biotechnologie	148	121.607	0,33
Regions Financial Corporation	Banken	668	12.398	0,03
ResMed Incorporated	Gesundheitsprodukte	70	15.329	0,04
Robert Half International Incorporated	Gewerbliche Dienste	763	61.475	0,17
Roper Technologies Incorporated	Software	56	24.679	0,07
Salesforce Incorporated	Software	101	20.178	0,06
SEI Investments Company	Diversifizierte Finanzdienstleister	2.548	146.637	0,40
Sensata Technologies Holding plc	Elektronik	101	5.052	0,01
Skyworks Solutions Incorporated	Halbleiter	205	24.186	0,07
Snap-on Incorporated	Werkzeug/Werkzeugmaschinen	289	71.351	0,19
SS&C Technologies Holdings Incorporated	Software	801	45.232	0,12
Starbucks Corporation	Einzelhandel	1.024	106.629	0,29
State Street Corporation	Banken	780	59.038	0,16
Steel Dynamics Incorporated	Eisen/Stahl	1.156	130.697	0,36
Stryker Corporation	Gesundheitsprodukte	102	29.118	0,08
Synchrony Financial	Diversifizierte Finanzdienstleister	300	8.724	0,02
Synopsys Incorporated	Software	236	91.155	0,25
Sysco Corporation	Lebensmittel	427	32.977	0,09
T Rowe Price Group Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	147	16.596	0,05
Target Corporation	Einzelhandel	15	2.484	0,01
Teleflex Incorporated	Gesundheitsprodukte	181	45.849	0,13
Teradyne Incorporated	Halbleiter	248	26.662	0,07
Tesla Incorporated	Automobilhersteller	648	134.434	0,37
Texas Instruments Incorporated	Halbleiter	489	90.959	0,25
Thermo Fisher Scientific Incorporated	Gesundheitsprodukte	243	140.058	0,38
TJX Companies Incorporated	Einzelhandel	575	45.057	0,12
T-Mobile US Incorporated	Telekommunikation	104	15.063	0,04
Tractor Supply Company	Einzelhandel	10	2.350	0,01
Travelers Companies Incorporated	Versicherung	64	10.970	0,03
Tyson Foods Incorporated	Lebensmittel	382	22.660	0,06

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL FACTOR ENHANCED EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens	
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>					
Stammaktien (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)					
UGI Corporation	<i>Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen</i>	906	31.493	0,09	
U-Haul Holding Company	<i>Gewerbliche Dienste</i>	965	50.035	0,14	
Ulta Beauty Incorporated	<i>Einzelhandel</i>	72	39.288	0,11	
Union Pacific Corporation	<i>Transport</i>	129	25.963	0,07	
United Parcel Service Incorporated	<i>Transport</i>	166	32.202	0,09	
UnitedHealth Group Incorporated	<i>Gesundheitsdienstleistungen</i>	288	136.106	0,37	
Valero Energy Corporation	<i>Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen</i>	1.088	151.885	0,41	
Veeva Systems Incorporated	<i>Software</i>	65	11.946	0,03	
VeriSign Incorporated	<i>Internet</i>	49	10.355	0,03	
Verizon Communications Incorporated	<i>Telekommunikation</i>	1.023	39.784	0,11	
Vertex Pharmaceuticals Incorporated	<i>Biotechnologie</i>	488	153.754	0,42	
Viatis Incorporated	<i>Pharmazie</i>	17.485	168.206	0,46	
Visa Incorporated	<i>Diversifizierte Finanzdienstleister</i>	749	168.870	0,46	
Vistra Corporation	<i>Strom</i>	236	5.664	0,02	
Walgreens Boots Alliance Incorporated	<i>Einzelhandel</i>	1.479	51.144	0,14	
Walmart Incorporated	<i>Einzelhandel</i>	606	89.355	0,24	
Walt Disney Company	<i>Medien</i>	601	60.178	0,16	
Waters Corporation	<i>Gesundheitsprodukte</i>	289	89.483	0,24	
West Pharmaceutical Services Incorporated	<i>Gesundheitsprodukte</i>	42	14.552	0,04	
Western Union Company	<i>Diversifizierte Finanzdienstleister</i>	14.287	159.300	0,43	
Westinghouse Air Brake Technologies Corporation	<i>Maschinen – Diversifiziert</i>	44	4.447	0,01	
Westlake Corporation	<i>Chemie</i>	587	68.080	0,19	
Whirlpool Corporation	<i>Möbel & Innenausstattung</i>	72	9.505	0,03	
WR Berkley Corporation	<i>Versicherung</i>	758	47.193	0,13	
WW Grainger Incorporated	<i>Vertrieb/Großhandel</i>	31	21.353	0,06	
Yum! Brands Incorporated	<i>Einzelhandel</i>	790	104.343	0,28	
Zimmer Biomet Holdings Incorporated	<i>Gesundheitsprodukte</i>	381	49.225	0,13	
Zoom Video Communications Incorporated	<i>Software</i>	618	45.633	0,12	
			23.520.410	64,14	
Summe Stammaktien			35.012.065	95,48	
	Dividenden- rendite %				
Vorzugsaktien					
Deutschland					
Bayerische Motoren Werke AG	5,94	<i>Automobilhersteller</i>	89	9.114	0,03
Volkswagen AG	20,91	<i>Automobilhersteller</i>	596	81.484	0,22
Summe Vorzugsaktien			90.598	0,25	
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			35.102.663	95,73	

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL FACTOR ENHANCED EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Sonstige Wertpapiere</u>				
Stammaktien				
Kanada				
Alimentation Couche-Tard Incorporated	Einzelhandel	800	40.167	0,11
AltaGas Limited	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	683	11.370	0,03
Canadian Apartment Properties REIT	REITs	1.250	43.789	0,12
Canadian Tire Corporation Limited	Einzelhandel	95	12.381	0,03
Canadian Utilities Limited	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	1.200	33.393	0,09
Fairfax Financial Holdings Limited	Versicherung	95	63.094	0,17
George Weston Limited	Lebensmittel	588	77.815	0,21
iA Financial Corporation Incorporated	Versicherung	193	12.216	0,03
IGM Financial Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	2.810	83.863	0,23
Loblaw Companies Limited	Lebensmittel	571	51.967	0,14
Metro Incorporated	Lebensmittel	300	16.479	0,05
Quebecor Incorporated	Medien	100	2.469	0,01
RioCan Real Estate Investment Trust	REITs	4.772	71.896	0,20
Tourmaline Oil Corporation	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	100	4.162	0,01
Summe Stammaktien			525.061	1,43
Summe Wertpapieranlagen			525.061	1,43
Summe Wertpapieranlagen			35.627.724	97,16
	Verzinsung in %	Nennwert @		
Bankguthaben				
Termineinlagen				
Kaiman-Inseln				
BBH Grand Cayman (o)	3,40	1 NZD	0	0,00
Frankreich				
BNP Paribas (o)	0,60	60.021 HKD	7.646	0,02
HSBC Bank plc (o)	1,93	2.265 EUR	2.461	0,01
			10.107	0,03
Japan				
Sumitomo Mitsui Banking Corporation (o)	(0,35)	362.961 JPY	2.727	0,01
Niederlande				
ING Bank NV (o)	2,38	510 SGD	383	0,00
Schweden				
Skandinaviska Enskilda Banken AB (o)	0,36	7.526 CHF	8.239	0,02
Skandinaviska Enskilda Banken AB (o)	1,78	15.316 SEK	1.477	0,00
			9.716	0,02
Vereinigtes Königreich				
ANZ (o)	2,32	3.931 AUD	2.633	0,01
Sumitomo Mitsui Banking Corporation (o)	3,17	11 GBP	14	0,00
			2.647	0,01

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL FACTOR ENHANCED EQUITY FUND

	Verzinsung in %	Nennwert @	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
Bankguthaben (Fortsetzung)				
Termineinlagen (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten				
China Construction Bank Corporation (o)	4,18	708.784 USD	708.784	1,93
Summe Termineinlagen			734.364	2,00
Summe Bankguthaben			734.364	2,00
<i>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, netto</i>			<i>309.171</i>	<i>0,84</i>
Gesamtes Fondsvermögen			36.671.259	100,00

@ Nennwert lautet auf angegebene Währung.

(o) Tagesgelder.

Abkürzung:	AUD	Australischer Dollar
	CHF	Schweizer Franken
	EUR	Euro
	GBP	Britisches Pfund
	HKD	Hongkong-Dollar
	JPY	Japanischer Yen
	NZD	Neuseeländischer Dollar
	REITs	Real Estate Investment Trust (REITs)
	SEK	Schwedische Krone
	SGD	Singapur-Dollar
	USD	US-Dollar

Die Wertpapiere wurden auf Grundlage des Landes der Unternehmensgründung/-ansässigkeit aufgelistet.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL LONG/ SHORT EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien				
Australien				
Atlassian Corporation	Software	254	43.477	0,03
Aurizon Holdings Limited	Transport	26.721	60.186	0,05
Coronado Global Resources Incorporated	Kohle	41.482	45.321	0,04
Pilbara Minerals Limited	Bergbau	500.202	1.330.739	1,04
Qantas Airways Limited	Fluggesellschaften	34.391	153.503	0,12
Rio Tinto Limited	Bergbau	8.472	680.723	0,53
Whitehaven Coal Limited	Kohle	139.550	628.241	0,49
			<u>2.942.190</u>	<u>2,30</u>
Belgien				
Solvay SA	Chemie	26.072	2.981.758	2,33
Umicore SA	Chemie	13.771	467.129	0,36
			<u>3.448.887</u>	<u>2,69</u>
Brasilien				
MercadoLibre Incorporated +	Internet	594	782.928	0,61
Kanada				
ARC Resources Limited	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	127.500	1.446.226	1,13
Empire Company Limited	Lebensmittel	61.500	1.648.646	1,29
Kinross Gold Corporation	Bergbau	4.000	18.824	0,01
Open Text Corporation	Software	500	19.286	0,01
			<u>3.132.982</u>	<u>2,44</u>
Dänemark				
AP Moller – Maersk AS	Transport	566	1.004.110	0,78
Finnland				
Kesko OYJ	Lebensmittel	1.884	40.490	0,03
Frankreich				
Sartorius Stedim Biotech	Gesundheitsprodukte	5.227	1.603.619	1,25
Hongkong				
CK Hutchison Holdings Limited	Lebensmittel	457.000	2.827.298	2,21
New World Development Company Limited	Immobilien	225.000	603.136	0,47
Swire Pacific Limited	Diversifizierte Holdings	195.000	1.498.572	1,17
WH Group Limited	Lebensmittel	2.909.000	1.734.191	1,35
			<u>6.663.197</u>	<u>5,20</u>
Irland				
Accenture plc +	Computer	1.548	442.434	0,35
Medtronic plc +	Gesundheitsprodukte	4.158	335.218	0,26
			<u>777.652</u>	<u>0,61</u>
Italien				
ENI SpA	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	70.462	982.689	0,77
Saras SpA	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	562.574	874.140	0,68
UniCredit SpA	Banken	22.933	432.238	0,34
			<u>2.289.067</u>	<u>1,79</u>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL LONG/ SHORT EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Luxemburg				
Tenaris SA	<i>Metallverarbeitung/produkte</i>	37.104	525.734	0,41
Norwegen				
Equinor ASA	<i>Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen</i>	27.449	780.332	0,61
Yara International ASA	<i>Chemie</i>	24.412	1.060.960	0,83
			1.841.292	1,44
Singapur				
Wilmar International Limited	<i>Landwirtschaft</i>	443.400	1.404.741	1,10
Spanien				
Naturgy Energy Group SA	<i>Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen</i>	24.735	744.611	0,58
Repsol SA	<i>Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen</i>	20.143	309.756	0,24
			1.054.367	0,82
Schweden				
Embracer Group AB	<i>Software</i>	191.773	895.581	0,70
Securitas AB	<i>Gewerbliche Dienste</i>	79.141	704.010	0,55
Volvo AB	<i>Automobilhersteller</i>	10.130	217.896	0,17
			1.817.487	1,42
Schweiz				
Glencore plc	<i>Bergbau</i>	326.789	1.880.415	1,47
Roche Holding AG	<i>Pharmazie</i>	1.944	584.154	0,45
Swatch Group AG	<i>Einzelhandel</i>	2.991	1.030.073	0,80
Swatch Group AG Registered	<i>Einzelhandel</i>	5.777	366.300	0,29
			3.860.942	3,01
Vereinigtes Königreich				
Coca-Cola Europacific Partners plc +	<i>Getränke</i>	4.984	295.003	0,23
GSK plc	<i>Pharmazie</i>	85.703	1.514.314	1,18
Imperial Brands plc	<i>Landwirtschaft</i>	1.788	41.116	0,03
NatWest Group plc	<i>Banken</i>	235.687	769.054	0,60
			2.619.487	2,04
Vereinigte Staaten				
AbbVie Incorporated +	<i>Pharmazie</i>	3.489	556.042	0,43
Adobe Incorporated +	<i>Software</i>	2.349	905.234	0,71
Advance Auto Parts Incorporated +	<i>Einzelhandel</i>	10.749	1.307.186	1,02
Albemarle Corporation +	<i>Chemie</i>	6.278	1.387.689	1,08
Alphabet Incorporated Class A +	<i>Internet</i>	20.457	2.122.005	1,66
Alphabet Incorporated Class C +	<i>Internet</i>	19.970	2.076.880	1,62
A-Mark Precious Metals Incorporated +	<i>Vertrieb/Großhandel</i>	23.401	810.845	0,63
American International Group Incorporated +	<i>Versicherung</i>	4.591	231.203	0,18
Amgen Incorporated +	<i>Biotechnologie</i>	12.101	2.925.417	2,28
Amneal Pharmaceuticals Incorporated +	<i>Pharmazie</i>	165.265	229.718	0,18
Apple Incorporated +	<i>Computer</i>	12.582	2.074.772	1,62
Archer-Daniels-Midland Company +	<i>Landwirtschaft</i>	27.984	2.229.205	1,74
Arrow Electronics Incorporated +	<i>Elektronik</i>	5.903	737.108	0,57
Autodesk Incorporated +	<i>Software</i>	10.332	2.150.709	1,68
AutoZone Incorporated +	<i>Einzelhandel</i>	965	2.372.115	1,85

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL LONG/ SHORT EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
Bandwidth Incorporated +	Software	69.497	1.056.354	0,82
Bank of New York Mellon Corporation +	Banken	37.818	1.718.450	1,34
Becton Dickinson & Company +	Pharmazie	10.428	2.581.347	2,01
Bristol-Myers Squibb Company +	Pharmazie	8.382	580.956	0,45
Broadcom Incorporated +	Halbleiter	518	332.318	0,26
Bunge Limited +	Landwirtschaft	1.170	111.758	0,09
Cal-Maine Foods Incorporated +	Lebensmittel	9.805	597.026	0,47
Catalyst Pharmaceuticals Incorporated +	Pharmazie	37.949	629.194	0,49
Caterpillar Incorporated +	Maschinen – Bau- und Bergbau	6.994	1.600.507	1,25
Centene Corporation +	Gesundheitsdienstleistungen	11.280	713.009	0,56
Cigna Group +	Pharmazie	6.739	1.722.017	1,34
Clearway Energy Incorporated +	Strom	17.322	520.180	0,41
Clorox Company +	Haushaltsprodukte und -waren	2.458	388.954	0,30
Comcast Corporation +	Medien	4.767	180.717	0,14
Comstock Resources Incorporated +	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	15.951	172.111	0,13
Conagra Brands Incorporated +	Lebensmittel	28.060	1.053.934	0,82
Consensus Cloud Solutions Incorporated +	Software	1.128	38.454	0,03
Cross Country Healthcare Incorporated	Gewerbliche Dienste	24.948	556.839	0,43
CVS Health Corporation +	Pharmazie	35.302	2.623.292	2,05
Deere & Company +	Maschinen – Diversifiziert	997	411.641	0,32
Dillard's Incorporated	Einzelhandel	130	39.998	0,03
DISH Network Corporation +	Medien	37.706	351.797	0,27
Eagle Pharmaceuticals Incorporated +	Pharmazie	18.161	515.228	0,40
Enphase Energy Incorporated +	Energie – Alternative Quellen	3.191	671.004	0,52
Fidelity National Information Services Incorporated +	Software	357	19.396	0,02
Gilead Sciences Incorporated +	Biotechnologie	20.043	1.662.968	1,30
Hewlett Packard Enterprise Company +	Computer	28.125	448.031	0,35
HF Sinclair Corporation +	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	34.419	1.665.191	1,30
Holley Incorporated +	Automobilteile & -zubehör	83.981	230.108	0,18
Hologic Incorporated +	Gesundheitsprodukte	6.124	494.207	0,39
Hubbell Incorporated +	Elektronik	3.555	864.967	0,67
Incyte Corporation +	Biotechnologie	2.274	164.342	0,13
Invesco Limited +	Diversifizierte Finanzdienstleister	7.781	127.608	0,10
Keysight Technologies Incorporated +	Elektronik	3.171	512.053	0,40
Kimberly-Clark Corporation +	Haushaltsprodukte und -waren	9.152	1.228.381	0,96
Kraft Heinz Company +	Lebensmittel	919	35.538	0,03
Kroger Company +	Lebensmittel	1.216	60.034	0,05
Linde plc +	Chemie	846	300.702	0,23
Marathon Petroleum Corporation +	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	12.051	1.624.836	1,27
Microchip Technology Incorporated +	Halbleiter	12.915	1.082.019	0,84
Microsoft Corporation +	Software	2.651	764.283	0,60
Netflix Incorporated +	Internet	5.495	1.898.413	1,48
NRG Energy Incorporated +	Strom	567	19.442	0,02
PACCAR Incorporated +	Automobilhersteller	16.692	1.221.854	0,95
Perdoceo Education Corporation +	Gewerbliche Dienste	28.752	386.139	0,30
Phillips 66 +	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	7.185	728.415	0,57
PulteGroup Incorporated +	Hausbau	16.710	973.859	0,76
Sanmina Corporation	Elektronik	3.082	187.971	0,15
State Street Corporation +	Banken	24.242	1.834.877	1,43
Stryker Corporation +	Gesundheitsprodukte	103	29.403	0,02
Super Micro Computer Incorporated +	Computer	1.976	210.543	0,16
Titan International Incorporated +	Automobilteile & -zubehör	13.736	143.953	0,11

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL LONG/ SHORT EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
United Therapeutics Corporation +	<i>Biotechnologie</i>	11.251	2.519.774	1,97
Valero Energy Corporation +	<i>Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen</i>	13.219	1.845.372	1,44
Vanda Pharmaceuticals Incorporated +	<i>Pharmazie</i>	75.038	509.508	0,40
VeriSign Incorporated +	<i>Internet</i>	5.613	1.186.195	0,93
Verizon Communications Incorporated +	<i>Telekommunikation</i>	14.239	553.755	0,43
Vertex Pharmaceuticals Incorporated +	<i>Biotechnologie</i>	2.795	880.621	0,69
VF Corporation +	<i>Bekleidung</i>	48.239	1.105.156	0,86
Viatis Incorporated +	<i>Pharmazie</i>	161.632	1.554.900	1,21
Vir Biotechnology Incorporated +	<i>Biotechnologie</i>	24.245	564.181	0,44
Wabash National Corporation +	<i>Automobilhersteller</i>	28.069	690.217	0,54
Walgreens Boots Alliance Incorporated +	<i>Einzelhandel</i>	9.599	331.933	0,26
Zimmer Biomet Holdings Incorporated +	<i>Gesundheitsprodukte</i>	15.309	1.977.923	1,54
Zoom Video Communications Incorporated +	<i>Software</i>	18.533	1.368.477	1,07
			75.290.758	58,73
Summe Stammaktien			111.099.930	86,67
	Dividenden- rendite %			
Vorzugsaktien				
Deutschland				
Bayerische Motoren Werke AG	5,94 <i>Automobilhersteller</i>	2.730	279.056	0,22
Summe Vorzugsaktien			279.056	0,22
			111.378.986	86,89
<u>Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
<u>Sonstige Wertpapiere</u>				
Stammaktien				
Kanada				
Fairfax Financial Holdings Limited	<i>Versicherung</i>	4.300	2.859.762	2,23
George Weston Limited	<i>Lebensmittel</i>	3.200	424.062	0,33
Tourmaline Oil Corporation	<i>Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen</i>	41.900	1.746.066	1,36
Summe Stammaktien			5.029.890	3,92
Summe Wertpapieranlagen			5.029.890	3,92
Summe Wertpapieranlagen			116.408.876	90,81

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL LONG/ SHORT EQUITY FUND

	Verzinsung in %	Nennwert @	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
Bankguthaben				
Termineinlagen				
Frankreich				
BNP Paribas (o)	1,54	208 DKK	31	0,00
BNP Paribas (o)	2,32	1.870 AUD	1.250	0,00
			<u>1.281</u>	<u>0,00</u>
Japan				
Sumitomo Mitsui Banking Corporation (o)	1,93	4.017 EUR	4.356	0,00
Norwegen				
Nordea Bank Abp (o)	1,85	1.372 NOK	131	0,00
Vereinigte Staaten				
China Construction Bank Corporation (o)	4,18	11.984.419 USD	11.984.419	9,35
Summe Termineinlagen			11.990.187	9,35
Kontokorrentkonten			1.041.352	0,82
Summe Bankguthaben			13.031.539	10,17
<i>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, netto</i>			<i>(1.250.306)</i>	<i>(0,98)</i>
Gesamtes Fondsvermögen			128.190.109	100,00

+ Die Wertpapiere werden vollständig oder teilweise als Sicherheit für Anlagen in Differenzkontrakten abgesondert.

@ Nennwert lautet auf angegebene Währung.

(o) Tagesgelder.

Abkürzung:	AUD	Australischer Dollar
	DKK	Dänische Krone
	EUR	Euro
	NOK	Norwegische Krone
	USD	US-Dollar

Die Wertpapiere wurden auf Grundlage des Landes der Unternehmensgründung/-ansässigkeit aufgelistet.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL SMALL CAP EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien				
Australien				
Ansell Limited	Gesundheitsprodukte	24.012	427.816	2,32
Cettire Limited	Internet	74.069	72.775	0,39
Inghams Group Limited	Landwirtschaft	42.714	89.453	0,49
			<u>590.044</u>	<u>3,20</u>
Belgien				
Barco NV	Elektronik	10.583	315.447	1,71
Dänemark				
SimCorp AS	Software	1.921	145.301	0,79
Frankreich				
Alten SA	Bau- & Ingenieurwesen	2.307	368.380	2,00
Metropole Television SA	Medien	6.633	107.584	0,58
			<u>475.964</u>	<u>2,58</u>
Deutschland				
CANCOM SE	Computer	3.529	120.966	0,66
Gerresheimer AG	Behälter & Verpackung	2.389	236.884	1,29
Krones AG	Maschinen – Diversifiziert	1.562	184.758	1,00
MYT Netherlands Parent BV ADR	Internet	5.329	37.463	0,20
TAG Immobilien AG	Immobilien	15.511	107.380	0,58
			<u>687.451</u>	<u>3,73</u>
Irland				
Irish Residential Properties REIT plc	REITs	87.308	87.988	0,48
Israel				
CyberArk Software Limited	Computer	1.687	249.642	1,35
Italien				
De' Longhi SpA	Möbel & Innenausstattung	2.980	67.997	0,37
GVS SpA	Umweltkontrolle	26.164	174.445	0,94
Interpump Group SpA	Maschinen – Diversifiziert	3.311	185.675	1,01
			<u>428.117</u>	<u>2,32</u>
Japan				
Aeon Delight Company Limited	Gewerbliche Dienste	8.100	186.066	1,01
Daiseki Company Limited	Umweltkontrolle	3.820	121.420	0,66
DTS Corporation	Computer	10.800	263.138	1,43
Fuji Seal International Incorporated	Behälter & Verpackung	10.000	114.313	0,62
Horiba Limited	Elektronik	1.700	102.029	0,55
Meitec Corporation	Bau- & Ingenieurwesen	14.900	266.778	1,45
Nihon Parkerizing Company Limited	Chemie	22.100	166.121	0,90
Orix JREIT Incorporated	REITs	165	209.208	1,14
Taikisha Limited	Bau- & Ingenieurwesen	3.800	105.799	0,57
			<u>1.534.872</u>	<u>8,33</u>
Luxemburg				
Majorel Group Luxembourg SA	Computer	2.686	59.279	0,32

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL SMALL CAP EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Niederlande				
TKH Group NV	Elektronik	931	48.523	0,26
Norwegen				
Atea ASA	Internet	8.161	99.774	0,54
Elopak ASA	Behälter & Verpackung	35.262	73.253	0,40
			173.027	0,94
Spanien				
Vidrala SA	Behälter & Verpackung	713	78.089	0,43
Viscofan SA	Lebensmittel	4.842	346.763	1,88
			424.852	2,31
Schweden				
Hexpol AB	Sonstige Hersteller	9.649	119.522	0,65
Loomis AB	Gewerbliche Dienste	6.132	210.086	1,14
			329.608	1,79
Schweiz				
Bossard Holding AG	Vertrieb/Großhandel	501	126.624	0,69
Bucher Industries AG	Maschinen – Diversifiziert	281	131.427	0,71
Global Blue Group Holding AG	Gewerbliche Dienste	16.152	96.912	0,53
			354.963	1,93
Vereinigtes Königreich				
Britvic plc	Getränke	28.595	314.923	1,71
Dechra Pharmaceuticals plc	Pharmazie	676	22.132	0,12
Domino's Pizza Group plc	Einzelhandel	38.991	137.483	0,75
Elementis plc	Chemie	68.049	99.979	0,54
Lancashire Holdings Limited	Versicherung	18.253	124.566	0,68
Morgan Advanced Materials plc	Sonstige Hersteller	11.347	39.861	0,22
Nomad Foods Limited	Lebensmittel	8.069	151.213	0,82
S4 Capital plc	Werbung	45.933	92.130	0,50
Samarkand Group plc	Internet	31.725	13.697	0,07
Spectris plc	Elektronik	8.379	380.167	2,06
			1.376.151	7,47
Vereinigte Staaten				
Ambarella Incorporated	Halbleiter	2.170	168.001	0,91
Aris Water Solutions Incorporated	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	9.422	73.397	0,40
AZEK Company Incorporated	Baustoffe	5.490	129.235	0,70
Azenta Incorporated	Gesundheitsprodukte	8.317	371.105	2,01
Balchem Corporation	Chemie	1.372	173.531	0,94
Blackbaud Incorporated	Software	4.755	329.521	1,79
Brady Corporation	Elektronik	2.953	158.665	0,86
Cactus Incorporated	Maschinen – Diversifiziert	3.672	151.397	0,82
CBIZ Incorporated	Gewerbliche Dienste	4.672	231.217	1,26
CSW Industrials Incorporated	Maschinen – Diversifiziert	3.940	547.384	2,97
Denny's Corporation	Einzelhandel	37.721	420.966	2,29
E2open Parent Holdings Incorporated	Software	28.280	164.590	0,89
Enovis Corporation	Gesundheitsprodukte	6.381	341.320	1,85
EnPro Industries Incorporated	Sonstige Hersteller	2.131	221.390	1,20

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL SMALL CAP EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
FARO Technologies Incorporated	Elektronik	4.976	122.459	0,67
FormFactor Incorporated	Halbleiter	5.673	180.685	0,98
Gibraltar Industries Incorporated	Baustoffe	10.754	521.569	2,83
Globus Medical Incorporated	Gesundheitsprodukte	6.605	374.107	2,03
Hanover Insurance Group Incorporated	Versicherung	2.996	384.986	2,09
Helen of Troy Limited	Haushaltsprodukte und -waren	2.997	285.224	1,55
Holley Incorporated	Automobilteile & -zubehör	53.722	147.198	0,80
Horace Mann Educators Corporation	Versicherung	1.262	42.252	0,23
ICU Medical Incorporated	Gesundheitsprodukte	1.287	212.304	1,15
Innospec Incorporated	Chemie	7.005	719.203	3,90
J & J Snack Foods Corporation	Lebensmittel	1.783	264.276	1,43
Mayville Engineering Company Incorporated	Metallverarbeitung/produkte	15.995	238.645	1,30
Novanta Incorporated	Elektroteile & -ausrüstung	3.666	583.224	3,17
Primo Water Corporation	Getränke	11.800	181.169	0,98
Progress Software Corporation	Software	7.382	424.096	2,30
Quanex Building Products Corporation	Haushaltsprodukte und -waren	11.419	245.851	1,33
QuidelOrtho Corporation	Gesundheitsprodukte	2.228	198.492	1,08
Southwestern Energy Company	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	36.473	182.365	0,99
Spectrum Brands Holdings Incorporated	Haushaltsprodukte und -waren	1.859	123.103	0,67
Standex International Corporation	Metallverarbeitung/produkte	1.795	219.780	1,19
Stepan Company	Chemie	3.020	311.151	1,69
Varex Imaging Corporation	Gesundheitsprodukte	14.693	267.266	1,45
Vivid Seats Incorporated	Internet	13.862	105.767	0,57
Wendy's Company	Einzelhandel	11.293	245.962	1,34
Ziff Davis Incorporated	Internet	4.221	329.449	1,79
			10.392.302	56,40
Summe Stammaktien			17.673.531	95,91
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			17.673.531	95,91
<u>Sonstige Wertpapiere</u>				
Stammaktien				
Kanada				
ATS Corporation	Maschinen – Diversifiziert	2.600	108.867	0,59
Canadian Western Bank	Banken	2.300	42.137	0,23
Summe Stammaktien			151.004	0,82
Summe Wertpapieranlagen			151.004	0,82
Summe Wertpapieranlagen			17.824.535	96,73

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

GLOBAL SMALL CAP EQUITY FUND

	Verzinsung in %	Nennwert @	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
Bankguthaben				
Termineinlagen				
Frankreich				
BNP Paribas (o)	1,54	14.854 DKK	2.162	0,01
HSBC Bank plc (o)	1,93	48.698 EUR	52.813	0,29
			<u>54.975</u>	<u>0,30</u>
Niederlande				
ING Bank NV (o)	2,32	12.609 AUD	8.428	0,05
Norwegen				
Nordea Bank Abp (o)	1,85	68.511 NOK	6.544	0,04
Singapur				
DBS Bank Limited (o)	4,18	507.653 USD	507.653	2,75
Schweden				
Skandinaviska Enskilda Banken AB (o)	0,36	2.538 CHF	2.775	0,01
Skandinaviska Enskilda Banken AB (o)	1,78	93.994 SEK	9.056	0,05
			<u>11.831</u>	<u>0,06</u>
Vereinigtes Königreich				
Sumitomo Mitsui Banking Corporation (o)	(0,35)	6.642.618 JPY	50.029	0,27
Sumitomo Mitsui Banking Corporation (o)	3,17	7.632 GBP	9.414	0,05
			<u>59.443</u>	<u>0,32</u>
Summe Termineinlagen			648.874	3,52
Summe Bankguthaben			648.874	3,52
<i>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, netto</i>			<i>(46.984)</i>	<i>(0,25)</i>
Gesamtes Fondsvermögen			18.426.425	100,00

@ Nennwert lautet auf angegebene Währung.
(o) Tagesgelder.

Abkürzung:	ADR	American Depository Receipt
	AUD	Australischer Dollar
	CHF	Schweizer Franken
	DKK	Dänische Krone
	EUR	Euro
	GBP	Pfund Sterling
	JPY	Japanischer Yen
	NOK	Norwegische Krone
	REITs	Real Estate Investment Trust (REITs)
	SEK	Schwedische Krone
	USD	US-Dollar

Die Wertpapiere wurden auf Grundlage des Landes der Unternehmensgründung/-ansässigkeit aufgelistet

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

SMALL CAP INNOVATION FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien				
Brasilien				
StoneCo Limited	Gewerbliche Dienste	7.705	73.506	0,89
Costa Rica				
Establishment Labs Holdings Incorporated	Gesundheitsprodukte	573	38.815	0,47
Dänemark				
Ascendis Pharma AS ADR	Pharmazie	586	62.831	0,76
Indien				
WNS Holdings Limited ADR	Computer	2.261	210.657	2,55
Irland				
Keywords Studios plc	Computer	4.815	163.819	1,99
Israel				
Global-e Online Limited	Software	2.774	89.406	1,08
Nayax Limited	Diversifizierte Finanzdienstleister	2.988	50.722	0,62
			140.128	1,70
Italien				
Stevanato Group SpA	Gesundheitsprodukte	4.898	126.858	1,54
Schweiz				
CRISPR Therapeutics AG	Biotechnologie	522	23.610	0,29
Vereinigtes Königreich				
Endava plc ADR	Computer	1.307	87.804	1,07
Games Workshop Group plc	Spielzeug/Spiele/Freizeit	1.357	161.634	1,96
			249.438	3,03
Vereinigte Staaten				
Advanced Drainage Systems Incorporated	Metallverarbeitung/produkte	896	75.452	0,92
Allied Motion Technologies Incorporated	Elektronik	2.881	111.351	1,35
Apellis Pharmaceuticals Incorporated	Biotechnologie	758	49.998	0,61
Arvinas Incorporated	Pharmazie	1.100	30.052	0,37
Aspen Aerogels Incorporated	Einzelhandel	3.142	23.408	0,28
ATI Incorporated	Eisen/Stahl	2.087	82.353	1,00
Axon Enterprise Incorporated	Sonstige Hersteller	455	102.307	1,24
Axonics Incorporated	Gesundheitsprodukte	1.192	65.036	0,79
Azenta Incorporated	Gesundheitsprodukte	1.497	66.796	0,81
BellRing Brands Incorporated	Pharmazie	4.372	148.648	1,80
BILL Holdings Incorporated	Software	822	66.697	0,81
Bumble Incorporated	Internet	2.569	50.224	0,61
Casella Waste Systems Incorporated	Umweltkontrolle	2.742	226.654	2,75
CCC Intelligent Solutions Holdings Incorporated	Software	7.273	65.239	0,79
Clearwater Analytics Holdings Incorporated	Software	3.727	59.483	0,72
Coty Incorporated	Kosmetik/Körperpflege	9.067	109.348	1,33
CS Disco Incorporated	Software	3.104	20.611	0,25
DigitalBridge Group Incorporated	Telekommunikation	6.217	74.542	0,90
FTI Consulting Incorporated	Gewerbliche Dienste	579	114.266	1,39
Geron Corporation	Biotechnologie	7.728	16.770	0,20
Gitlab Incorporated	Software	1.511	51.812	0,63
Halozyme Therapeutics Incorporated	Biotechnologie	2.373	90.625	1,10

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

SMALL CAP INNOVATION FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
HealthEquity Incorporated	Gewerbliche Dienste	3.737	219.399	2,66
IAC Incorporated	Internet	2.273	117.287	1,42
ICF International Incorporated	Gewerbliche Dienste	1.124	123.303	1,50
ICU Medical Incorporated	Gesundheitsprodukte	524	86.439	1,05
Impinj Incorporated	Halbleiter	1.023	138.637	1,68
Inari Medical Incorporated	Gesundheitsprodukte	1.299	80.200	0,97
indie Semiconductor Incorporated	Automobilteile & -zubehör	6.627	69.915	0,85
Inspire Medical Systems Incorporated	Gesundheitsprodukte	575	134.590	1,63
iRhythm Technologies Incorporated	Gesundheitsprodukte	1.129	140.030	1,70
Jamf Holding Corporation	Software	3.108	60.357	0,73
Lantheus Holdings Incorporated	Gesundheitsprodukte	1.566	129.289	1,57
Lattice Semiconductor Corporation	Halbleiter	877	83.753	1,02
Littelfuse Incorporated	Elektroteile & -ausrüstung	572	153.347	1,86
MaxCyte Incorporated	Gesundheitsprodukte	10.904	53.975	0,66
MGP Ingredients Incorporated	Getränke	1.678	162.296	1,97
Mirati Therapeutics Incorporated	Biotechnologie	400	14.872	0,18
Morningstar Incorporated	Gewerbliche Dienste	492	99.891	1,21
Natera Incorporated	Gesundheitsprodukte	1.070	59.406	0,72
nLight Incorporated	Elektroteile & -ausrüstung	5.710	58.128	0,71
Novanta Incorporated	Elektroteile & -ausrüstung	1.204	191.544	2,32
Olo Incorporated	Software	9.499	77.512	0,94
Open Lending Corporation	Internet	5.429	38.220	0,46
Option Care Health Incorporated	Pharmazie	4.723	150.050	1,82
PagerDuty Incorporated	Software	2.494	87.240	1,06
Papa John's International Incorporated	Einzelhandel	1.946	145.814	1,77
Ranpak Holdings Corporation	Behälter & Verpackung	10.437	54.481	0,66
RBC Bearings Incorporated	Metallverarbeitung/produkte	554	128.932	1,56
Rexford Industrial Realty Incorporated	REITs	3.458	206.270	2,50
Saia Incorporated	Transport	664	180.661	2,19
Shift4 Payments Incorporated	Gewerbliche Dienste	1.853	140.457	1,70
Shoals Technologies Group Incorporated	Energie – Alternative Quellen	3.345	76.233	0,93
Shockwave Medical Incorporated	Gesundheitsprodukte	440	95.405	1,16
SiteOne Landscape Supply Incorporated	Vertrieb/Großhandel	1.040	142.345	1,73
SiTime Corporation	Halbleiter	556	79.080	0,96
Sprout Social Incorporated	Software	1.919	116.829	1,42
Tetra Tech Incorporated	Umweltkontrolle	1.335	196.125	2,38
TG Therapeutics Incorporated	Biotechnologie	2.257	33.945	0,41
Topgolf Callaway Brands Corporation	Freizeit	4.412	95.387	1,16
TransMedics Group Incorporated	Biotechnologie	1.013	76.714	0,93
Treace Medical Concepts Incorporated	Gesundheitsprodukte	5.017	126.378	1,53
Trex Company Incorporated	Baustoffe	1.411	68.673	0,83
UFP Technologies Incorporated	Gesundheitsprodukte	728	94.524	1,15
Wingstop Incorporated	Einzelhandel	1.136	208.547	2,53
Workiva Incorporated	Software	1.243	127.296	1,54
Xometry Incorporated	Metallverarbeitung/produkte	2.284	34.191	0,42
Zentalis Pharmaceuticals Incorporated	Biotechnologie	1.056	18.163	0,22
			6.677.802	81,02
Summe Stammaktien			7.767.464	94,24
Summe Wertpapieranlagen			7.767.464	94,24

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

SMALL CAP INNOVATION FUND

	Verzinsung in %	Nennwert @	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
Bankguthaben				
Termineinlagen				
Kanada				
Royal Bank of Canada (o)	3,33	468 CAD	346	0,00
Japan				
Sumitomo Mitsui Banking Corporation (o)	3,17	3.721 GBP	4.591	0,06
Vereinigte Staaten				
Citibank (o)	4,18	414.885 USD	414.885	5,03
Summe Termineinlagen			419.822	5,09
Summe Bankguthaben			419.822	5,09
<i>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, netto</i>			55.195	0,67
Gesamtes Fondsvermögen			8.242.480	100,00

@ Nennwert lautet auf angegebene Währung.
(o) Tagesgelder.

Abkürzung: ADR American Depository Receipt
CAD Kanadischer Dollar
GBP Britisches Pfund
REITs Real Estate Investment Trust (REITs)
USD US-Dollar

Die Wertpapiere wurden auf Grundlage des Landes der Unternehmensgründung/-ansässigkeit aufgelistet.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

U.S. ALL CAP GROWTH FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien				
Brasilien				
MercadoLibre Incorporated	Internet	1.746	2.301.333	0,47
Kanada				
lululemon athletica Incorporated	Einzelhandel	6.207	2.260.527	0,46
Niederlande				
Argenx SE ADR	Biotechnologie	2.566	956.040	0,20
Schweiz				
On Holding AG	Bekleidung	79.028	2.452.239	0,50
Vereinigte Staaten				
Advanced Micro Devices Incorporated	Halbleiter	21.419	2.099.276	0,43
Agilent Technologies Incorporated	Elektronik	7.240	1.001.582	0,21
Airbnb Incorporated	Internet	36.120	4.493.328	0,92
Allegro MicroSystems Incorporated	Halbleiter	202.436	9.714.904	1,99
Alphabet Incorporated Class A	Internet	189.264	19.632.355	4,02
Alphabet Incorporated Class C	Internet	22.579	2.348.216	0,48
Amazon.com Incorporated	Internet	229.137	23.667.561	4,85
Apple Incorporated	Computer	226.639	37.372.771	7,65
Array Technologies Incorporated	Energie – Alternative Quellen	96.053	2.101.640	0,43
AutoZone Incorporated	Einzelhandel	1.484	3.647.895	0,75
BioMarin Pharmaceutical Incorporated	Biotechnologie	23.195	2.255.482	0,46
Bio-Techne Corporation	Gesundheitsprodukte	16.508	1.224.729	0,25
BlackRock Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	4.594	3.073.937	0,63
Boot Barn Holdings Incorporated	Einzelhandel	3.703	283.798	0,06
Boston Scientific Corporation	Gesundheitsprodukte	237.713	11.892.781	2,44
Cardinal Health Incorporated	Pharmazie	30.952	2.336.876	0,48
Casella Waste Systems Incorporated	Umweltkontrolle	36.422	3.010.643	0,62
Chipotle Mexican Grill Incorporated	Einzelhandel	3.074	5.251.283	1,08
Clearwater Analytics Holdings Incorporated	Software	93.676	1.495.069	0,31
CME Group Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	35.354	6.770.998	1,39
Copart Incorporated	Vertrieb/Großhandel	166.585	12.528.858	2,57
CoStar Group Incorporated	Gewerbliche Dienste	18.365	1.264.430	0,26
CrowdStrike Holdings Incorporated	Computer	24.137	3.313.045	0,68
Datadog Incorporated	Software	6.500	472.290	0,10
DigitalOcean Holdings Incorporated	Software	64.310	2.519.023	0,52
DoubleVerify Holdings Incorporated	Software	17.000	512.550	0,10
Dynatrace Incorporated	Software	67.111	2.838.795	0,58
Equinix Incorporated	REITs	1.784	1.286.335	0,26
Estee Lauder Companies Incorporated	Kosmetik/Körperpflege	3.432	845.851	0,17
Fair Isaac Corporation	Software	6.467	4.544.296	0,93
Five Below Incorporated	Einzelhandel	19.026	3.918.785	0,80
Five9 Incorporated	Software	30.671	2.217.207	0,45
Floor & Decor Holdings Incorporated	Einzelhandel	48.927	4.805.610	0,98
Flywire Corporation	Gewerbliche Dienste	124.562	3.657.140	0,75
Fortive Corporation	Elektronik	40.988	2.794.152	0,57
Globant SA	Computer	2.900	475.629	0,10
Hologic Incorporated	Gesundheitsprodukte	67.825	5.473.477	1,12
Insulet Corporation	Gesundheitsprodukte	12.482	3.981.259	0,82
Interactive Brokers Group Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	48.724	4.022.653	0,82
Intercontinental Exchange Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	21.401	2.231.910	0,46
Intuit Incorporated	Software	14.236	6.346.836	1,30
Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.				

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

U.S. ALL CAP GROWTH FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
Intuitive Surgical Incorporated	Gesundheitsprodukte	14.393	3.676.980	0,75
iRhythm Technologies Incorporated	Gesundheitsprodukte	9.736	1.207.556	0,25
JB Hunt Transport Services Incorporated	Transport	12.056	2.115.346	0,43
Leslie's Incorporated	Einzelhandel	498.546	5.488.991	1,12
Linde plc	Chemie	25.555	9.083.269	1,86
Live Nation Entertainment Incorporated	Unterhaltung	25.817	1.807.190	0,37
LPL Financial Holdings Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	29.437	5.958.049	1,22
MarketAxess Holdings Incorporated	Gewerbliche Dienste	15.843	6.199.207	1,27
Mastercard Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	52.196	18.968.548	3,88
Meta Platforms Incorporated	Internet	21.422	4.540.179	0,93
Microchip Technology Incorporated	Halbleiter	115.370	9.665.699	1,98
Microsoft Corporation	Software	163.033	47.002.414	9,62
MongoDB Incorporated	Software	29.066	6.775.866	1,39
Monolithic Power Systems Incorporated	Halbleiter	23.439	11.732.157	2,40
NEXTracker Incorporated	Elektronik	4.871	176.622	0,04
NVIDIA Corporation	Halbleiter	24.676	6.854.253	1,40
O'Reilly Automotive Incorporated	Einzelhandel	1.869	1.586.744	0,32
Palo Alto Networks Incorporated	Internet	30.676	6.127.224	1,25
Paycom Software Incorporated	Software	12.281	3.733.547	0,76
Paycor HCM Incorporated	Software	156.347	4.146.322	0,85
PayPal Holdings Incorporated	Gewerbliche Dienste	21.907	1.663.618	0,34
Penumbra Incorporated	Gesundheitsprodukte	4.030	1.123.121	0,23
Petco Health & Wellness Company Incorporated	Einzelhandel	72.268	650.412	0,13
Planet Fitness Incorporated	Freizeit	64.482	5.008.317	1,03
Progressive Corporation	Versicherung	16.898	2.417.428	0,49
Qualcomm Incorporated	Halbleiter	15.202	1.939.471	0,40
Repligen Corporation	Gesundheitsprodukte	6.019	1.013.359	0,21
Revanche Therapeutics Incorporated	Pharmazie	119.521	3.849.771	0,79
Sarepta Therapeutics Incorporated	Biotechnologie	10.410	1.434.810	0,29
Seagen Incorporated	Biotechnologie	16.620	3.365.051	0,69
ServiceNow Incorporated	Software	5.963	2.771.125	0,57
Shift4 Payments Incorporated	Gewerbliche Dienste	31.404	2.380.423	0,49
Shoals Technologies Group Incorporated	Energie – Alternative Quellen	243.087	5.539.953	1,13
Shockwave Medical Incorporated	Gesundheitsprodukte	12.751	2.764.799	0,57
Stryker Corporation	Gesundheitsprodukte	9.181	2.620.900	0,54
Sysco Corporation	Lebensmittel	45.203	3.491.028	0,71
Thermo Fisher Scientific Incorporated	Gesundheitsprodukte	1.962	1.130.838	0,23
Thoughtworks Holding Incorporated	Computer	229.384	1.688.266	0,35
Tractor Supply Company	Einzelhandel	4.273	1.004.326	0,21
Tradeweb Markets Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	172.270	13.612.775	2,79
TransDigm Group Incorporated	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	1.803	1.328.901	0,27
Uber Technologies Incorporated	Internet	163.220	5.174.074	1,06
Ulta Beauty Incorporated	Einzelhandel	11.589	6.323.770	1,29
United Parcel Service Incorporated	Transport	13.110	2.543.209	0,52
UnitedHealth Group Incorporated	Gesundheitsdienstleistungen	16.847	7.961.724	1,63
Veeva Systems Incorporated	Software	17.900	3.289.841	0,67
Vertex Pharmaceuticals Incorporated	Biotechnologie	9.885	3.114.467	0,64
Visa Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	32.588	7.347.290	1,50
West Pharmaceutical Services Incorporated	Gesundheitsprodukte	10.123	3.507.316	0,72
Zebra Technologies Corporation	Bürogeräte/Geschäftsausstattung	6.003	1.908.954	0,39

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

U.S. ALL CAP GROWTH FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
Zoetis Incorporated	Pharmazie	10.246	1.705.344	0,35
			474.246.099	97,11
Summe Stammaktien			482.216.238	98,74
Summe Wertpapieranlagen			482.216.238	98,74
	Verzinsung in %	Nennwert @		
Bankguthaben				
Termineinlagen				
Kaiman-Inseln				
BBH Grand Cayman (o)	0,36	21 CHF	23	0,00
Vereinigtes Königreich				
Sumitomo Mitsui Banking Corporation (o)	3,17	390 GBP	481	0,00
Vereinigte Staaten				
China Construction Bank Corporation (o)	4,18	6.028.312 USD	6.028.312	1,23
Summe Termineinlagen			6.028.816	1,23
Summe Bankguthaben			6.028.816	1,23
<i>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, netto</i>			<i>132.910</i>	<i>0,03</i>
Gesamtes Fondsvermögen			488.377.964	100,00

@ Nennwert lautet auf angegebene Währung.
(o) Tagesgelder.

Abkürzung: ADR American Depository Receipt
CHF Schweizer Franken
GBP Britisches Pfund
REITs Real Estate Investment Trust (REITs)
USD US-Dollar

Die Wertpapiere wurden auf Grundlage des Landes der Unternehmensgründung/-ansässigkeit aufgelistet.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

U.S. LARGE CAP GROWTH FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien				
Brasilien				
MercadoLibre Incorporated	Internet	123	162.121	2,80
Kanada				
Waste Connections Incorporated	Umweltkontrolle	1.480	205.824	3,56
Irland				
Aptiv plc	Automobilteile & -zubehör	750	84.143	1,46
Italien				
Ferrari NV	Automobilhersteller	570	154.436	2,67
Schweden				
Spotify Technology SA	Internet	770	102.887	1,78
Vereinigte Staaten				
Advanced Micro Devices Incorporated	Halbleiter	910	89.189	1,54
Align Technology Incorporated	Gesundheitsprodukte	260	86.876	1,50
Alphabet Incorporated	Internet	3.890	403.510	6,98
Amazon.com Incorporated	Internet	4.120	425.555	7,36
BILL Holdings Incorporated	Software	760	61.666	1,07
Cadence Design Systems Incorporated	Software	1.000	210.090	3,64
Chipotle Mexican Grill Incorporated	Einzelhandel	107	182.787	3,16
CrowdStrike Holdings Incorporated	Computer	720	98.827	1,71
Deere & Company	Maschinen – Diversifiziert	340	140.379	2,43
Dexcom Incorporated	Pharmazie	1.420	164.976	2,85
Edwards Lifesciences Corporation	Gesundheitsprodukte	1.270	105.067	1,82
Fiserv Incorporated	Software	1.365	154.286	2,67
Home Depot Incorporated	Einzelhandel	525	154.938	2,68
Intercontinental Exchange Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	1.096	114.302	1,98
Intuitive Surgical Incorporated	Gesundheitsprodukte	568	145.107	2,51
MarketAxess Holdings Incorporated	Gewerbliche Dienste	360	140.864	2,44
Microsoft Corporation	Software	2.023	583.231	10,09
MongoDB Incorporated	Software	314	73.200	1,27
Motorola Solutions Incorporated	Telekommunikation	600	171.678	2,97
Progressive Corporation	Versicherung	1.060	151.644	2,62
S&P Global Incorporated	Gewerbliche Dienste	414	142.735	2,47
SBA Communications Corporation	REITs	480	125.314	2,17
ServiceNow Incorporated	Software	341	158.469	2,74
Sherwin-Williams Company	Chemie	608	136.660	2,37
Texas Instruments Incorporated	Halbleiter	710	132.067	2,29
Union Pacific Corporation	Transport	722	145.310	2,51
UnitedHealth Group Incorporated	Gesundheitsdienstleistungen	421	198.960	3,44
Veeva Systems Incorporated	Software	660	121.301	2,10
Visa Incorporated	Diversifizierte Finanzdienstleister	1.526	344.052	5,95
			5.163.040	89,33
Summe Stammaktien			5.872.451	101,60
Summe Wertpapieranlagen			5.872.451	101,60

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

U.S. LARGE CAP GROWTH FUND

	Verzinsung in %	Nennwert in USD	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
Bankguthaben				
Termineinlage				
Vereinigte Staaten				
China Construction Bank Corporation (o)	4,18	128.665	128.665	2,23
Summe Bankguthaben			128.665	2,23
<i>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, netto</i>			<i>(221.199)</i>	<i>(3,83)</i>
Gesamtes Fondsvermögen			5.779.917	100,00

(o) Tagesgelder.

Abkürzung: REITs Real Estate Investment Trust (REITs)
USD US-Dollar

Die Wertpapiere wurden auf Grundlage des Landes der Unternehmensgründung/-ansässigkeit aufgelistet.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

U.S. SELECT EQUITY FUND

	Sektor	Aktien	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>				
Stammaktien				
Bermudas				
Bank of NT Butterfield & Son Limited	Banken	4.761	128.547	2,28
Kanada				
Agnico Eagle Mines Limited	Bergbau	3.228	164.531	2,92
Canadian Natural Resources Limited	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	2.877	159.242	2,83
			323.773	5,75
Vereinigtes Königreich				
Nomad Foods Limited	Lebensmittel	8.867	166.167	2,95
Vereinigte Staaten				
Advanced Drainage Systems Incorporated	Metallverarbeitung/produkte	1.839	154.862	2,75
American Eagle Outfitters Incorporated	Einzelhandel	4.653	62.536	1,11
Arch Capital Group Limited	Versicherung	2.319	157.391	2,79
Azenta Incorporated	Gesundheitsprodukte	3.752	167.414	2,97
Bio-Rad Laboratories Incorporated	Biotechnologie	294	140.832	2,50
CACI International Incorporated	Computer	500	148.140	2,63
Carlisle Companies Incorporated	Sonstige Hersteller	657	148.528	2,64
Cheesecake Factory Incorporated	Einzelhandel	3.492	122.395	2,17
Dropbox Incorporated	Software	5.884	127.212	2,26
Dun & Bradstreet Holdings Incorporated	Gewerbliche Dienste	11.668	136.982	2,43
Haemonetics Corporation	Gesundheitsprodukte	1.894	156.729	2,78
HealthEquity Incorporated	Gewerbliche Dienste	2.527	148.360	2,63
Integer Holdings Corporation	Gesundheitsprodukte	2.400	186.000	3,30
Jabil Incorporated	Elektronik	2.247	198.096	3,52
Kirby Corporation	Transport	2.277	158.707	2,82
Knight-Swift Transportation Holdings Incorporated	Transport	2.631	148.862	2,64
Leslie's Incorporated	Einzelhandel	12.946	142.535	2,53
Marvell Technology Incorporated	Halbleiter	3.820	165.406	2,93
NCR Corporation	Computer	5.626	132.717	2,35
News Corporation	Medien	9.597	165.740	2,94
Olin Corporation	Chemie	2.902	161.061	2,86
PagerDuty Incorporated	Software	5.314	185.884	3,30
Palo Alto Networks Incorporated	Internet	1.054	210.526	3,74
Pinnacle Financial Partners Incorporated	Banken	2.404	132.605	2,35
Regal Rexnord Corporation	Werkzeug/Werkzeugmaschinen	817	114.976	2,04
Revolve Group Incorporated	Internet	6.647	174.816	3,10
Splunk Incorporated	Software	1.815	174.022	3,09
Stagwell Incorporated	Werbung	22.576	167.514	2,97
Stem Incorporated	Energie – Alternative Quellen	17.061	96.736	1,72
YETI Holdings Incorporated	Freizeit	3.160	126.400	2,24
Zurn Elkay Water Solutions Corporation	Maschinen – Diversifiziert	6.710	143.326	2,54
			4.657.310	82,64
Summe Stammaktien			5.275.797	93,62
Summe Wertpapieranlagen			5.275.797	93,62

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

U.S. SELECT EQUITY FUND

	Verzinsung in %	Nennwert in USD	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
Bankguthaben				
Termineinlage				
Vereinigte Staaten				
China Construction Bank Corporation (o)	4,18	438.493	438.493	7,78
Summe Bankguthaben			438.493	7,78
<i>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, netto</i>			<i>(78.689)</i>	<i>(1,40)</i>
Gesamtes Fondsvermögen			5.635.601	100,00

(o) Tagesgelder.

Abkürzung: USD US-Dollar

Die Wertpapiere wurden auf Grundlage des Landes der Unternehmensgründung/-ansässigkeit aufgelistet.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

U.S. SHORT-TERM HIGH YIELD BOND FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Sektor	Nennwert in USD	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>						
Unternehmensanleihen und Schuldtitel						
Kanada						
1011778 BC ULC	5,75	15.04.2025	Einzelhandel	425.000	426.549	1,42
Air Canada 2020-1 Class C Pass-Through Trust	10,50	15.07.2026	Fluggesellschaften	325.000	345.665	1,15
Clarios Global LP	6,75	15.05.2025	Automobilteile & -zubehör	423.000	427.505	1,42
Northriver Midstream Finance LP	5,63	15.02.2026	Pipelines	435.000	408.186	1,36
					<u>1.607.905</u>	<u>5,35</u>
Frankreich						
Constellium SE	5,88	15.02.2026	Bergbau	125.000	125.137	0,42
Niederlande						
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	6,00	15.04.2024	Pharmazie	337.000	337.000	1,12
Vereinigte Staaten						
Adient Global Holdings Limited	4,88	15.08.2026	Automobilteile & -zubehör	175.000	168.656	0,56
Aethon United BR LP	8,25	15.02.2026	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	185.000	181.526	0,60
Allied Universal Holdco LLC	6,63	15.07.2026	Gewerbliche Dienste	295.000	283.496	0,94
American Airlines Incorporated	5,50	20.04.2026	Fluggesellschaften	115.000	113.173	0,38
Antero Midstream Partners LP	7,88	15.05.2026	Pipelines	250.000	254.560	0,85
Antero Resources Corporation	8,38	15.07.2026	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	100.000	104.134	0,35
Aramark Services Incorporated	6,38	01.05.2025	Lebensmitteldienste	300.000	302.208	1,01
Ardagh Packaging Finance plc	5,25	30.04.2025	Behälter & Verpackung	250.000	246.250	0,82
Avient Corporation	5,75	15.05.2025	Chemie	40.000	39.581	0,13
Bath & Body Works Incorporated	9,38	01.07.2025	Einzelhandel	379.000	404.909	1,35
Buckeye Partners LP	4,13	01.03.2025	Pipelines	170.000	160.806	0,54
Carnival Corporation	10,50	01.02.2026	Freizeit	350.000	364.672	1,21
CCM Merger Incorporated	6,38	01.05.2026	Unterhaltung	210.000	205.036	0,68
CCO Holdings LLC	5,13	01.05.2027	Medien	570.000	538.650	1,79
Cedar Fair LP	5,50	01.05.2025	Unterhaltung	400.000	399.748	1,33
Celanese US Holdings LLC	6,05	15.03.2025	Chemie	200.000	201.148	0,67
Cinemark USA Incorporated	8,75	01.05.2025	Unterhaltung	350.000	357.322	1,19
Clearwater Paper Corporation	5,38	01.02.2025	Behälter & Verpackung	350.000	339.433	1,13
Cleveland-Cliffs Incorporated	6,75	15.03.2026	Eisen/Stahl	250.000	254.500	0,85
CoreCivic Incorporated	8,25	15.04.2026	Gewerbliche Dienste	345.000	347.753	1,16
Crestwood Midstream Partners LP	5,75	01.04.2025	Pipelines	300.000	292.947	0,97
DAE Funding LLC	2,63	20.03.2025	Spedition & Leasing	120.000	112.694	0,38
Dave & Buster's Incorporated	7,63	01.11.2025	Einzelhandel Diversifizierte	300.000	305.722	1,02
Enact Holdings Incorporated	6,50	15.08.2025	Finanzdienstleister	565.000	550.875	1,83
EnLink Midstream Partners LP	4,15	01.06.2025	Pipelines	233.000	226.008	0,75
Enviva Partners LP	6,50	15.01.2026	Energie – Alternative Quellen	605.000	550.550	1,83
EQM Midstream Partners LP	4,00	01.08.2024	Pipelines	150.000	144.242	0,48
EQT Corporation	6,13	01.02.2025	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	310.000	311.844	1,04
Ford Motor Credit Company LLC	5,58	18.03.2024	Automobilhersteller	580.000	574.119	1,91
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC	6,50	01.10.2025	Spedition & Leasing	459.000	459.305	1,53
G-III Apparel Group Limited	7,88	15.08.2025	Vertrieb/Großhandel	380.000	358.150	1,19
Gray Television Incorporated	5,88	15.07.2026	Medien	125.000	108.125	0,36
HAT Holdings I LLC	3,38	15.06.2026	REITs	430.000	373.025	1,24
Hawaiian Airlines 2013-1 Class A Pass-Through Certificates	3,90	15.01.2026	Fluggesellschaften	460.456	413.062	1,37
Hilton Domestic Operating Company Incorporated	5,38	01.05.2025	Hotels	370.000	369.306	1,23

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

U.S. SHORT-TERM HIGH YIELD BOND FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Sektor	Nennwert in USD	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>						
Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Fortsetzung)						
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)						
IQVIA Incorporated	5,00	15.10.2026	Gesundheitsdienstleistungen	210.000	205.275	0,68
Ladder Capital Finance Holdings LLLP	5,25	01.10.2025	REITs	445.000	391.509	1,30
			Diversifizierte			
LFS Topco LLC	5,88	15.10.2026	Finanzdienstleister	200.000	174.323	0,58
Live Nation Entertainment Incorporated	4,88	01.11.2024	Unterhaltung	220.000	215.600	0,72
Live Nation Entertainment Incorporated	6,50	15.05.2027	Unterhaltung	87.000	87.935	0,29
MGM Resorts International	6,75	01.05.2025	Hotels	145.000	146.130	0,49
Michael Kors USA Incorporated	4,25	01.11.2024	Bekleidung	135.000	130.106	0,43
Mileage Plus Holdings LLC	6,50	20.06.2027	Fluggesellschaften	340.000	338.905	1,13
MPT Operating Partnership LP	5,25	01.08.2026	REITs	310.000	278.639	0,93
Murphy Oil Corporation	5,75	15.08.2025	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	234.000	231.097	0,77
Navient Corporation	5,88	25.10.2024	Diversifizierte Finanzdienstleister	460.000	446.831	1,49
Navient Corporation	7,25	25.09.2023	Diversifizierte Finanzdienstleister	124.000	123.579	0,41
NCL Corporation Limited	8,38	01.02.2028	Freizeit	130.000	130.446	0,43
NCR Corporation	5,75	01.09.2027	Computer	175.000	171.978	0,57
Newell Brands Incorporated	4,70	01.04.2026	Haushaltswaren	150.000	144.375	0,48
Nexstar Media Incorporated	5,63	15.07.2027	Medien	350.000	323.411	1,08
NextEra Energy Operating Partners LP	4,25	15.07.2024	Strom	450.000	444.271	1,48
NSG Holdings LLC	7,75	15.12.2025	Strom	298.222	293.749	0,98
Oceaneering International Incorporated	4,65	15.11.2024	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	600.000	587.301	1,95
OneMain Finance Corporation	6,13	15.03.2024	Diversifizierte Finanzdienstleister	585.000	569.875	1,90
Performance Food Group Incorporated	6,88	01.05.2025	Lebensmittel	340.000	340.850	1,13
PRA Group Incorporated	7,38	01.09.2025	Diversifizierte Finanzdienstleister	330.000	328.268	1,09
Prime Security Services Borrower LLC	5,75	15.04.2026	Gewerbliche Dienste	240.000	238.200	0,79
QVC Incorporated	4,85	01.04.2024	Einzelhandel	450.000	360.018	1,20
Range Resources Corporation	4,88	15.05.2025	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	173.000	169.611	0,56
			Diversifizierte			
Rocket Mortgage LLC	2,88	15.10.2026	Finanzdienstleister	250.000	223.750	0,74
Rockies Express Pipeline LLC	3,60	15.05.2025	Pipelines	450.000	420.747	1,40
Royal Caribbean Cruises Limited	11,50	01.06.2025	Freizeit	236.000	251.641	0,84
Sabre GBLB Incorporated	9,25	15.04.2025	Gewerbliche Dienste	300.000	282.600	0,94
Sabre GBLB Incorporated	11,25	15.12.2027	Gewerbliche Dienste	110.000	102.502	0,34
SeaWorld Parks & Entertainment Incorporated	8,75	01.05.2025	Unterhaltung	400.000	410.722	1,37
Service Properties Trust	4,35	01.10.2024	REITs	70.000	66.956	0,22
Service Properties Trust	7,50	15.09.2025	REITs	200.000	197.349	0,66
Southwestern Energy Company	5,70	23.01.2025	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	280.000	280.137	0,93
Spectrum Brands Incorporated	5,75	15.07.2025	Haushaltsprodukte und -waren	350.000	345.514	1,15
Spirit Loyalty Cayman Limited	8,00	20.09.2025	Fluggesellschaften	425.000	426.062	1,42
Spirit Loyalty Cayman Limited	8,00	20.09.2025	Fluggesellschaften	45.000	45.290	0,15
Sprint Spectrum Company LLC	4,74	20.03.2025	Telekommunikation	100.000	99.239	0,33
Starwood Property Trust Incorporated	3,63	15.07.2026	REITs	70.000	58.169	0,19
Starwood Property Trust Incorporated	3,75	31.12.2024	REITs	95.000	87.527	0,29
Starwood Property Trust Incorporated	4,75	15.03.2025	REITs	445.000	418.522	1,39
Tallgrass Energy Partners LP	6,00	01.03.2027	Pipelines	380.000	359.706	1,20
Tenet Healthcare Corporation	4,88	01.01.2026	Gesundheitsdienstleistungen	435.000	426.457	1,42
Townsquare Media Incorporated	6,88	01.02.2026	Medien	380.000	359.484	1,20
			Luft- und			
TransDigm Incorporated	6,25	15.03.2026	Raumfahrt/Verteidigung	410.000	410.373	1,37
TRI Pointe Group Incorporated	5,88	15.06.2024	Hausbau	295.000	293.525	0,98
Uber Technologies Incorporated	7,50	15.05.2025	Internet	420.000	425.386	1,42
			Diversifizierte			
United Wholesale Mortgage LLC	5,50	15.11.2025	Finanzdienstleister	545.000	515.793	1,72
US Foods Incorporated	6,25	15.04.2025	Lebensmittel	320.000	322.885	1,07
USA Compression Partners LP	6,88	01.04.2026	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	300.000	291.584	0,97
Vistra Operations Company LLC	5,63	15.02.2027	Strom	580.000	562.812	1,87

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

U.S. SHORT-TERM HIGH YIELD BOND FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Sektor	Nennwert in USD	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>						
Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Fortsetzung)						
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)						
WESCO Distribution Incorporated	7,13	15.06.2025	Elektroteile und -ausrüstung	370.000	376.086	1,25
Western Digital Corporation	4,75	15.02.2026	Computer	150.000	143.918	0,48
Western Midstream Operating LP	3,95	01.06.2025	Pipelines	265.000	253.624	0,84
					25.748.177	85,68
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel					27.818.219	92,57
Summe Wertpapieranlagen					27.818.219	92,57
Bankguthaben						
Termineinlage						
Vereinigte Staaten						
China Construction Bank Corporation (o)	4,18			1.658.682 USD	1.658.682	5,52
Summe Bankguthaben					1.658.682	5,52
<i>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, netto</i>					<i>574.381</i>	<i>1,91</i>
Gesamtes Fondsvermögen					30.051.282	100,00

(o) Tagesgelder.

Abkürzung: REITs Real Estate Investment Trust (REITs)
USD US-Dollar

Die Wertpapiere wurden auf Grundlage des Landes der Unternehmensgründung/-ansässigkeit aufgelistet.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

USD INVESTMENT GRADE CREDIT FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Sektor	Nennwert in USD	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>						
Unternehmensanleihen und Schuldtitel						
Australien						
Australia & New Zealand Banking Group Limited ±	2,57	25.11.2035	Banken	2.240.000	1.728.932	0,42
Macquarie Group Limited ±	1,63	23.09.2027	Banken	5.095.000	4.477.220	1,10
National Australia Bank Limited	2,33	21.08.2030	Banken	3.190.000	2.490.727	0,61
QBE Insurance Group Limited ^±	5,88	12.05.2025	Versicherung	2.335.000	2.177.240	0,54
Scentre Group Trust 2 ±	5,13	24.09.2080	REITs	4.370.000	3.688.467	0,91
					<u>14.562.586</u>	<u>3,58</u>
Kanada						
Air Canada 2017-1 Class AA Pass-Through Trust	3,30	15.01.2030	Fluggesellschaften	1.620.008	1.426.626	0,35
Frankreich						
BNP Paribas SA ±	1,68	30.06.2027	Banken	5.160.000	4.539.597	1,11
Credit Agricole SA	3,25	14.01.2030	Banken	2.805.000	2.353.278	0,58
					<u>6.892.875</u>	<u>1,69</u>
Irland						
AerCap Ireland Capital DAC	1,15	29.10.2023	Diversifizierte Finanzdienstleister	1.960.000	1.900.288	0,47
AerCap Ireland Capital DAC	3,30	30.01.2032	Diversifizierte Finanzdienstleister	2.545.000	2.108.348	0,52
Avolon Holdings Funding Limited	2,75	21.02.2028	Diversifizierte Finanzdienstleister	1.960.000	1.635.950	0,40
					<u>5.644.586</u>	<u>1,39</u>
Japan						
Mitsubishi UFJ Financial Group Incorporated ±	0,85	15.09.2024	Banken	2.055.000	2.008.576	0,49
Mitsubishi UFJ Financial Group Incorporated ±	5,44	22.02.2034	Banken	3.495.000	3.531.509	0,87
					<u>5.540.085</u>	<u>1,36</u>
Luxemburg						
SES SA	3,60	04.04.2023	Telekommunikation	1.077.000	1.077.000	0,26
Niederlande						
Prosus NV	3,83	08.02.2051	Internet	2.200.000	1.410.402	0,35
Spanien						
Banco Santander SA	3,49	28.05.2030	Banken	4.200.000	3.667.254	0,90
Banco Santander SA ±	4,18	24.03.2028	Banken	1.400.000	1.313.591	0,32
Cellnex Finance Company SA	3,88	07.07.2041	Bau- & Ingenieurwesen	1.895.000	1.391.821	0,34
					<u>6.372.666</u>	<u>1,56</u>
Schweiz						
Credit Suisse AG	3,63	09.09.2024	Banken	3.395.000	3.230.410	0,79
Credit Suisse Group AG ±	9,02	15.11.2033	Banken	1.560.000	1.848.444	0,46
UBS Group AG ±	2,75	11.02.2033	Banken	2.445.000	1.959.124	0,48
					<u>7.037.978</u>	<u>1,73</u>
Vereinigtes Königreich						
AstraZeneca plc	2,13	06.08.2050	Pharmazie	1.295.000	815.912	0,20
AXIS Specialty Finance plc	4,00	06.12.2027	Versicherung	1.175.000	1.144.177	0,28
HSBC Holdings plc	4,30	08.03.2026	Banken	3.640.000	3.520.602	0,86
NatWest Group plc ±	2,36	22.05.2024	Banken	1.645.000	1.636.385	0,40

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

USD INVESTMENT GRADE CREDIT FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Sektor	Nennwert in USD	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>						
Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Fortsetzung)						
Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)						
Royalty Pharma plc	1,75	02.09.2027	Biotechnologie	2.490.000	2.157.841	0,53
Santander UK Group Holdings plc ±	6,83	21.11.2026	Banken	3.285.000	3.327.308	0,82
WPP Finance 2010	3,75	19.09.2024	Werbung	1.910.000	1.864.238	0,46
					14.466.463	3,55
Vereinigte Staaten						
AbbVie Incorporated	3,20	21.11.2029	Pharmazie	1.220.000	1.132.184	0,28
AbbVie Incorporated	4,25	21.11.2049	Pharmazie	2.395.000	2.113.529	0,52
Advance Auto Parts Incorporated	5,95	09.03.2028	Einzelhandel	1.930.000	1.989.543	0,49
Air Lease Corporation	2,88	15.01.2026	Diversifizierte Finanzdienstleister	3.515.000	3.276.627	0,81
Alcon Finance Corporation	5,75	06.12.2052	Gesundheitsprodukte	1.255.000	1.335.815	0,33
American International Group Incorporated	4,75	01.04.2048	Versicherung	1.090.000	978.308	0,24
American Tower Corporation	1,50	31.01.2028	REITs	5.880.000	5.003.251	1,23
Amgen Incorporated	4,20	22.02.2052	Biotechnologie	870.000	738.141	0,18
Amgen Incorporated	5,15	02.03.2028	Biotechnologie	1.560.000	1.592.793	0,39
Amgen Incorporated	5,65	02.03.2053	Biotechnologie	1.725.000	1.795.209	0,44
Amgen Incorporated	5,75	02.03.2063	Biotechnologie	1.725.000	1.789.920	0,44
Anheuser-Busch InBev Worldwide Incorporated	4,60	15.04.2048	Getränke	2.067.000	1.950.264	0,48
Aptiv plc	4,15	01.05.2052	Automobilteile & -zubehör	1.710.000	1.341.637	0,33
AT&T Incorporated	3,65	01.06.2051	Telekommunikation	6.240.000	4.726.390	1,16
Aviation Capital Group LLC	1,95	30.01.2026	Diversifizierte Finanzdienstleister	2.025.000	1.800.758	0,44
Aviation Capital Group LLC	5,50	15.12.2024	Diversifizierte Finanzdienstleister	3.235.000	3.193.420	0,78
Bank of America Corporation ±	1,92	24.10.2031	Banken	1.140.000	909.246	0,22
Bank of America Corporation ±	2,46	22.10.2025	Banken	3.430.000	3.265.194	0,80
Bank of America Corporation ±	2,69	22.04.2032	Banken	4.720.000	3.938.954	0,97
Bank of America Corporation ±	2,97	04.02.2033	Banken	3.025.000	2.547.175	0,63
Bank of America Corporation	3,50	19.04.2026	Banken	1.135.000	1.090.982	0,27
Bank of America Corporation ±	3,82	20.01.2028	Banken	3.030.000	2.894.875	0,71
Belrose Funding Trust	2,33	15.08.2030	Versicherung	2.450.000	1.904.424	0,47
Berkshire Hathaway Finance Corporation	2,85	15.10.2050	Versicherung	2.945.000	2.077.204	0,51
Best Buy Company Incorporated	1,95	01.10.2030	Einzelhandel	5.630.000	4.579.394	1,13
BP Capital Markets America Incorporated	2,94	04.06.2051	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	5.440.000	3.772.050	0,93
Bristol-Myers Squibb Company	2,55	13.11.2050	Pharmazie	2.045.000	1.368.209	0,34
Centene Corporation	2,45	15.07.2028	Gesundheitsdienstleistungen	1.555.000	1.352.850	0,33
Charles Schwab Corporation	4,63	22.03.2030	Diversifizierte Finanzdienstleister	2.950.000	2.823.922	0,69
Charter Communications Operating LLC	3,70	01.04.2051	Medien	1.000.000	639.977	0,16
Charter Communications Operating LLC	3,75	15.02.2028	Medien	1.695.000	1.573.946	0,39
Charter Communications Operating LLC	4,20	15.03.2028	Medien	2.400.000	2.271.484	0,56
Charter Communications Operating LLC	5,25	01.04.2053	Medien	1.710.000	1.385.844	0,34
Citigroup Incorporated ±	1,68	15.05.2024	Banken	5.135.000	5.113.895	1,26
Citigroup Incorporated ±	2,56	01.05.2032	Banken	2.815.000	2.335.479	0,57
Citigroup Incorporated ±	2,67	29.01.2031	Banken	1.100.000	938.859	0,23
Coca-Cola Company	2,60	01.06.2050	Getränke	1.635.000	1.170.501	0,29
Comcast Corporation	2,94	01.11.2056	Medien	2.790.000	1.857.174	0,46
Continental Airlines 2012-2 Class A Pass-Through Trust	4,00	29.10.2024	Fluggesellschaften	124.204	120.022	0,03
Crown Castle Incorporated	2,25	15.01.2031	REITs	2.765.000	2.291.566	0,56
CVS Health Corporation	5,05	25.03.2048	Pharmazie	4.375.000	4.092.840	1,01
Dell International LLC	5,30	01.10.2029	Computer	4.935.000	4.972.219	1,22
Dell International LLC	6,02	15.06.2026	Computer Diversifizierte	3.955.000	4.059.076	1,00
Discover Financial Services ^±	6,13	23.06.2025	Finanzdienstleister	1.640.000	1.513.775	0,37

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

USD INVESTMENT GRADE CREDIT FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Sektor	Nennwert in USD	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amflich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>						
Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Fortsetzung)						
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)						
Elevance Health Incorporated	3,65	01.12.2027	Gesundheitsdienstleistungen	680.000	657.108	0,16
Enstar Finance LLC ±	5,50	15.01.2042	Versicherung	1.325.000	954.349	0,23
Entegris Escrow Corporation	4,75	15.04.2029	Halbleiter	2.365.000	2.235.877	0,55
Equifax Incorporated	2,35	15.09.2031	Gewerbliche Dienste	2.535.000	2.040.344	0,50
Equifax Incorporated	3,10	15.05.2030	Gewerbliche Dienste	1.530.000	1.330.216	0,33
Equitable Financial Life Global Funding	1,40	07.07.2025	Versicherung	4.110.000	3.801.218	0,93
ERP Operating LP	1,85	01.08.2031	REITs	4.860.000	3.896.151	0,96
Exxon Mobil Corporation	3,45	15.04.2051	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	1.205.000	959.442	0,24
Fiserv Incorporated	3,50	01.07.2029	Software	2.765.000	2.566.434	0,63
Five Corners Funding Trust	4,42	15.11.2023	Versicherung	995.000	988.702	0,24
Flowerserve Corporation	3,50	01.10.2030	Maschinen – Diversifiziert	550.000	475.637	0,12
FS KKR Capital Corporation	3,40	15.01.2026	Anlagegesellschaften	2.515.000	2.256.892	0,55
Genting New York LLC	3,30	15.02.2026	Hotels	945.000	850.279	0,21
Genuine Parts Company	1,88	01.11.2030	Einzelhandel	3.630.000	2.889.867	0,71
Goldman Sachs Group Incorporated ±	3,10	24.02.2033	Banken	3.025.000	2.597.779	0,64
Goldman Sachs Group Incorporated	3,85	26.01.2027	Banken	4.110.000	3.964.674	0,97
HCA Incorporated	3,63	15.03.2032	Gesundheitsdienstleistungen	2.470.000	2.177.380	0,53
HCA Incorporated	4,63	15.03.2052	Gesundheitsdienstleistungen	2.220.000	1.843.248	0,45
Hill City Funding Trust	4,05	15.08.2041	Versicherung	2.230.000	1.562.406	0,38
Home Depot Incorporated	3,35	15.04.2050	Einzelhandel	2.665.000	2.062.387	0,51
Hyatt Hotels Corporation	1,80	01.10.2024	Hotels	1.695.000	1.604.731	0,39
Hyundai Capital America	1,80	10.01.2028	Automobilhersteller	1.380.000	1.170.368	0,29
Intel Corporation	5,20	10.02.2033	Halbleiter	2.655.000	2.704.094	0,66
Intercontinental Exchange Incorporated	3,00	15.06.2050	Diversifizierte Finanzdienstleister	1.285.000	900.331	0,22
International Flavors & Fragrances Incorporated	1,83	15.10.2027	Chemie	1.285.000	1.090.682	0,27
Jabil Incorporated	3,60	15.01.2030	Elektronik	2.165.000	1.954.835	0,48
JPMorgan Chase & Company ±	0,56	16.02.2025	Banken	2.785.000	2.669.169	0,66
JPMorgan Chase & Company ±	2,58	22.04.2032	Banken	2.570.000	2.163.046	0,53
JPMorgan Chase & Company	2,95	01.10.2026	Banken	1.650.000	1.558.243	0,38
JPMorgan Chase & Company ±	3,78	01.02.2028	Banken	4.590.000	4.388.747	1,08
KeyBank NA	5,00	26.01.2033	Banken	3.555.000	3.302.743	0,81
Kinder Morgan Energy Partners LP	5,40	01.09.2044	Pipelines	1.450.000	1.342.954	0,33
Lowe's Companies Incorporated	3,00	15.10.2050	Einzelhandel	2.100.000	1.393.712	0,34
Lowe's Companies Incorporated	4,25	01.04.2052	Einzelhandel	1.575.000	1.292.436	0,32
Manufacturers & Traders Trust Company	4,70	27.01.2028	Banken	4.960.000	4.646.362	1,14
Marathon Petroleum Corporation	4,70	01.05.2025	Erdöl & Erdgas – Dienstleistungen	2.405.000	2.400.186	0,59
Marvell Technology Incorporated	4,88	22.06.2028	Halbleiter	1.300.000	1.276.613	0,31
Merck & Company Incorporated	2,75	10.12.2051	Pharmazie	2.595.000	1.836.788	0,45
Micron Technology Incorporated	4,19	15.02.2027	Halbleiter	5.880.000	5.689.878	1,40
Morgan Stanley ±	2,94	21.01.2033	Banken	1.660.000	1.406.289	0,35
Morgan Stanley	3,13	27.07.2026	Banken	2.735.000	2.590.145	0,64
Morgan Stanley ±	3,22	22.04.2042	Banken	1.250.000	963.999	0,24
Morgan Stanley	3,63	20.01.2027	Banken	2.055.000	1.977.813	0,49
Motorola Solutions Incorporated	2,30	15.11.2030	Telekommunikation	1.485.000	1.206.864	0,30
Motorola Solutions Incorporated	4,60	23.02.2028	Telekommunikation	2.621.000	2.586.433	0,64
MPLX LP	4,00	15.03.2028	Pipelines	1.660.000	1.588.270	0,39
NetApp Incorporated	2,70	22.06.2030	Computer Diversifizierte	2.810.000	2.408.049	0,59
Nuveen LLC	4,00	01.11.2028	Finanzdienstleister	1.755.000	1.686.056	0,41
Oglethorpe Power Corporation	3,75	01.08.2050	Strom	1.900.000	1.458.875	0,36
Omega Healthcare Investors Incorporated	3,38	01.02.2031	REITs	1.870.000	1.477.012	0,36
Omega Healthcare Investors Incorporated	5,25	15.01.2026	REITs	2.310.000	2.269.007	0,56
ONEOK Incorporated	6,10	15.11.2032	Pipelines	1.335.000	1.382.053	0,34

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

USD INVESTMENT GRADE CREDIT FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Sektor	Nennwert in USD	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Amtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>						
Unternehmensanleihen und Schuldtitel (Fortsetzung)						
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)						
Oracle Corporation	2,88	25.03.2031	Software	2.020.000	1.728.518	0,42
Oracle Corporation	3,25	15.11.2027	Software	3.255.000	3.059.632	0,75
Oracle Corporation	3,95	25.03.2051	Software	1.940.000	1.459.806	0,36
Oracle Corporation	5,55	06.02.2053	Software	840.000	799.715	0,20
Paramount Global	3,70	01.06.2028	Medien	2.735.000	2.483.843	0,61
PartnerRe Finance II Incorporated ±	7,29	01.12.2066	Versicherung	928.000	798.080	0,20
Peachtree Corners Funding Trust	3,98	15.02.2025	Versicherung	1.125.000	1.092.905	0,27
Penske Truck Leasing Company LP	1,20	15.11.2025	Spedition & Leasing	2.635.000	2.367.825	0,58
Penske Truck Leasing Company LP	3,45	01.07.2024	Spedition & Leasing	740.000	720.351	0,18
Republic Services Incorporated	5,00	01.04.2034	Umweltkontrolle	1.325.000	1.349.943	0,33
S&P Global Incorporated	1,25	15.08.2030	Gewerbliche Dienste	1.790.000	1.436.630	0,35
S&P Global Incorporated	2,30	15.08.2060	Gewerbliche Dienste	1.670.000	966.201	0,24
S&P Global Incorporated	3,90	01.03.2062	Gewerbliche Dienste	420.000	348.561	0,09
Sabine Pass Liquefaction LLC	5,75	15.05.2024	Pipelines	4.025.000	4.034.560	0,99
Sabra Health Care LP	3,20	01.12.2031	REITs	1.825.000	1.338.570	0,33
Sammons Financial Group Incorporated	4,45	12.05.2027	Versicherung	1.350.000	1.277.537	0,31
Santander Holdings USA Incorporated	4,40	13.07.2027	Banken	1.770.000	1.657.093	0,41
Simon Property Group LP	1,75	01.02.2028	REITs	1.000.000	860.184	0,21
Simon Property Group LP	3,25	13.09.2049	REITs	5.135.000	3.494.611	0,86
Smithfield Foods Incorporated	3,00	15.10.2030	Lebensmittel	2.340.000	1.867.063	0,46
State Street Corporation	2,40	24.01.2030	Banken	2.695.000	2.333.987	0,57
SVB Financial Group ^	4,70	15.11.2031	Banken	2.900.000	184.875	0,05
T-Mobile USA Incorporated	3,30	15.02.2051	Telekommunikation	2.530.000	1.798.969	0,44
T-Mobile USA Incorporated	3,50	15.04.2025	Telekommunikation	1.295.000	1.259.025	0,31
T-Mobile USA Incorporated	3,75	15.04.2027	Telekommunikation	2.545.000	2.446.440	0,60
T-Mobile USA Incorporated	4,95	15.03.2028	Telekommunikation	1.420.000	1.433.570	0,35
Toll Brothers Finance Corporation	3,80	01.11.2029	Hausbau Diversifizierte	1.810.000	1.626.042	0,40
Toll Road Investors Partnership II LP (z)	0,00	15.02.2028	Finanzdienstleister	2.500.000	1.769.621	0,43
Truist Financial Corporation ±	1,89	07.06.2029	Banken	2.940.000	2.455.030	0,60
Truist Financial Corporation ±	4,87	26.01.2029	Banken	2.335.000	2.276.776	0,56
Truist Financial Corporation ^±	4,95	01.09.2025	Banken	2.390.000	2.209.033	0,54
Union Pacific Corporation	3,25	05.02.2050	Transport	3.015.000	2.291.405	0,56
United Airlines 2018-1 Class AA Pass- Through Trust	3,50	01.03.2030	Fluggesellschaften	1.251.008	1.121.524	0,28
UnitedHealth Group Incorporated	5,88	15.02.2053	Gesundheitsdienstleistungen	3.310.000	3.720.419	0,91
UnitedHealth Group Incorporated	6,05	15.02.2063	Gesundheitsdienstleistungen	1.520.000	1.730.583	0,43
Unum Group	4,50	15.12.2049	Versicherung	355.000	260.067	0,06
US Bancorp ±	4,65	01.02.2029	Banken	3.840.000	3.753.483	0,92
Verizon Communications Incorporated	3,55	22.03.2051	Telekommunikation	7.270.000	5.546.705	1,36
Verizon Communications Incorporated	4,13	15.08.2046	Telekommunikation	4.735.000	4.043.763	0,99
Warnermedia Holdings Incorporated	3,76	15.03.2027	Unterhaltung	1.430.000	1.346.671	0,33
Warnermedia Holdings Incorporated	5,05	15.03.2042	Unterhaltung	1.805.000	1.509.764	0,37
Warnermedia Holdings Incorporated	5,14	15.03.2052	Unterhaltung	5.750.000	4.658.842	1,14
Western Digital Corporation	3,10	01.02.2032	Computer	2.805.000	2.114.088	0,52
					293.148.408	72,02
Summe Unternehmensanleihen und Schuldtitel					357.579.675	87,84
Staatsanleihen						
Vereinigte Staaten						
United States Treasury Bond	2,00	15.11.2041		2.120.000	1.600.020	0,39
United States Treasury Bond	2,25	15.02.2052		2.135.000	1.592.076	0,39

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

USD INVESTMENT GRADE CREDIT FUND

	Verzinsung in %	Fälligkeits- datum	Nennwert in USD	Markt- wert USD	% des Netto- vermögens
<u>Ämtlich notierte oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</u>					
Staatsanleihen (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)					
United States Treasury Bond	3,00	15.08.2052	1.060.000	931.144	0,23
United States Treasury Bond	4,00	15.11.2052	5.975.000	6.340.969	1,56
United States Treasury Note	1,38	15.11.2031	1.235.000	1.042.417	0,26
United States Treasury Note	1,88	15.02.2032	1.735.000	1.522.734	0,37
United States Treasury Note	2,63	31.05.2027	740.000	709.533	0,17
United States Treasury Note	2,75	31.05.2029	1.215.000	1.157.999	0,29
United States Treasury Note	2,75	15.08.2032	8.210.000	7.726.380	1,90
United States Treasury Note	3,13	31.08.2027	1.600.000	1.565.000	0,38
United States Treasury Note	3,50	31.01.2028	7.885.000	7.843.727	1,93
United States Treasury Note	3,50	15.02.2033	3.510.000	3.515.484	0,86
United States Treasury Note	4,13	15.11.2032	4.395.000	4.618.184	1,14
Summe Staatsanleihen				40.165.667	9,87
Kommunalanleihen					
Vereinigte Staaten					
New Jersey Transportation Trust Fund Authority	4,13	15.06.2042	955.000	843.027	0,21
Summe Kommunalanleihen				843.027	0,21
Summe Wertpapieranlagen				398.588.369	97,92
			Nennwert @		
Bankguthaben					
Termineinlagen					
Kaiman-Inseln					
BBH Grand Cayman (o)	(0,35)		1 JPY	0	0,00
Vereinigte Staaten					
Citibank (o)	4,18		633.019 USD	633.019	0,16
Summe Termineinlagen				633.019	0,16
Summe Bankguthaben				633.019	0,16
<i>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, netto</i>				7.828.987	1,92
Gesamtes Fondsvermögen				407.050.375	100,00

± Variabel verzinsliche Anlage. Der aufgeführte Zins entspricht dem effektiven Zinssatz zum Ende des Berichtszeitraums.

^ Die Anlage erfolgt unbefristet und hat daher kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das angegebene Datum spiegelt den nächsten Call-Termin wider.

(z) Nullkuponanleihe.

@ Nennwert lautet auf angegebene Währung.

(o) Tagesgelder.

Abkürzung: JPY Japanischer Yen
REITs Real Estate Investment Trust (REITs)
USD US-Dollar

Die Wertpapiere wurden auf Grundlage des Landes der Unternehmensgründung/-ansässigkeit aufgelistet.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

	2 Degree Global Equity Fund USD	Alternative Risk Premia Fund USD	China A Focus Fund USD	Climate Focused Emerging Markets Equity Fund USD	Climate Focused Global Equity Fund USD
Aktiva					
Wertpapieranlagen zu Anschaffungskosten.....	93.392.520	25.147.543	14.333.988	1.890.583	956.329
Nicht realisierte Gewinne/(Verluste)	2.208.595	214.350	(760.346)	(219.434)	(71.034)
Wertpapieranlagen zum Marktwert	95.601.115	25.361.893	13.573.642	1.671.149	885.295
Bankguthaben	849.395	6.675.552	309.556	116.542	112.450
Abgesonderte Barsicherheiten.....	106.000	4.971.799	0	0	0
Forderungen aus Nachschusszahlungen auf Futures- Kontrakte	0	134.119	0	0	0
Nicht realisierter Gewinn aus offenen Devisenterminkontrakten	94	418.568	0	0	0
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	0	508.351	0	0	0
Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten	0	569.539	0	0	0
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten.....	0	46.805	0	0	0
Zinsforderungen	0	0	0	0	0
Dividendenforderungen.....	648.487	43.456	0	6.568	2.556
Forderungen aus Anlageverkäufen.....	0	0	57.970	5.425	0
Forderungen aus Anteilsausgaben	0	0	8.409	0	0
Gründungskosten.....	0	52.822	0	0	0
Forderungen gegenüber dem Anlageverwalter.....	0	11.307	0	70.860	38.114
Sonstige Vermögenswerte	2.049	347	0	0	0
Summe Aktiva	97.207.140	38.794.558	13.949.577	1.870.544	1.038.415
Passiva					
Verbindlichkeiten aus Nachschusszahlungen auf Futures- Kontrakte.....	0	0	0	0	0
Dividendenverbindlichkeiten aus Differenzkontrakten	0	23.534	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Anlagekäufen	3.266	0	0	14.009	0
Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen	703.706	0	16.943	0	0
Zahlbare Anlageverwaltungsgebühren	24.622	0	6.868	0	0
Zahlbare Depotbank- und Verwaltungsgebühren	42.560	38.383	17.718	14.676	3.112
Zahlbare Prüfungshonorare und Steuerberatungskosten.....	6.372	8.158	6.920	13.528	13.528
Veräußerte Optionen zum Marktwert.....	0	0	0	0	0
Nicht realisierter Verlust aus offenen Devisenterminkontrakten	0	747.969	0	0	0
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	0	521.130	0	0	0
Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten	0	518.720	0	0	0
Zahlbare Zeichnungssteuer	2.624	933	1.163	0	0
Zahlbare Mehrwertsteueraufwendungen	12.995	31.600	12.995	30.481	30.481
Aufwendungen für Berichte an die Anteilinhaber	17.113	3.907	17.341	17.169	17.169
Zahlbare Rechtskosten	10.782	16.502	16.691	26.831	31.774
Latente Steuerverbindlichkeiten.....	0	0	0	0	0
Sonstige Verbindlichkeiten.....	61.824	58.014	57.493	34.994	38.240
Summe Passiva	885.864	1.968.850	154.132	151.688	134.304
Gesamtes Fondsvermögen	96.321.276	36.825.708	13.795.445	1.718.856	904.111

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Vermögensbilanz zum 31. März 2023
(Fortsetzung)

	Climate Focused U.S. Equity Fund USD	Climate Transition Global Investment Grade Credit Fund USD	Emerging Markets Equity Fund USD	Emerging Markets Equity Income Fund USD	EUR Investment Grade Credit Fund EUR
Aktiva					
Wertpapieranlagen zu Anschaffungskosten.....	958.971	164.046.399	311.230.246	104.741.493	105.715.585
Nicht realisierte Gewinne/(Verluste)	(109.133)	(20.543.600)	2.877.380	(2.981.311)	(11.762.613)
Wertpapieranlagen zum Marktwert	849.838	143.502.799	314.107.626	101.760.182	93.952.972
Bankguthaben	99.939	4.896.898	14.844.062	4.011.743	8.131.028
Abgesonderte Barsicherheiten.....	0	510.000	0	0	0
Forderungen aus Nachschusszahlungen auf Futures- Kontrakte.....	0	0	0	0	149.491
Nicht realisierter Gewinn aus offenen Devisenterminkontrakten	0	873.409	0	0	359.979
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	0	0	0	0	92.515
Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten	0	0	0	0	0
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten.....	0	0	0	0	0
Zinsforderungen	0	1.447.133	0	0	982.330
Dividendenforderungen	893	0	786.124	509.089	0
Forderungen aus Anlageverkäufen.....	0	0	217.886	151.992	0
Forderungen aus Anteilsausgaben	0	0	1.445	21.967	0
Gründungskosten.....	0	21.281	0	0	0
Forderungen gegenüber dem Anlageverwalter.....	42.171	41.045	0	0	10.903
Sonstige Vermögenswerte	0	2.442	4.651	58.305	0
Summe Aktiva	992.841	151.295.007	329.961.794	106.513.278	103.679.218
Passiva					
Verbindlichkeiten aus Nachschusszahlungen auf Futures-Kontrakte	0	0	0	0	0
Dividendenverbindlichkeiten aus Differenzkontrakten	0	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Anlagekäufen	0	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen	0	0	100.001	233.025	0
Zahlbare Anlageverwaltungsgebühren	0	0	238.529	48.049	0
Zahlbare Depotbank- und Verwaltungsgebühren	2.137	81.755	95.161	116.063	51.877
Zahlbare Prüfungshonorare und Steuerberatungskosten	13.098	8.158	6.918	6.922	5.970
Veräußerte Optionen zum Marktwert.....	0	0	0	0	0
Nicht realisierter Verlust aus offenen Devisenterminkontrakten	0	747.481	0	0	3.016
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures- Kontrakten.....	0	0	0	0	47.596
Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten	0	0	0	0	0
Zahlbare Zeichnungssteuer	0	3.695	7.854	2.796	5.221
Zahlbare Mehrwertsteueraufwendungen	30.481	31.600	42.432	37.979	29.599
Aufwendungen für Berichte an die Anteilinhaber	17.169	26.474	6.572	41.639	22.142
Zahlbare Rechtskosten	30.942	19.124	19.661	14.941	16.834
Latente Steuerverbindlichkeiten.....	0	0	1.168.680	0	0
Sonstige Verbindlichkeiten.....	34.167	111.626	109.452	111.879	83.546
Summe Passiva	127.994	1.029.913	1.795.260	613.293	265.801
Gesamtes Fondsvermögen	864.847	150.265.094	328.166.534	105.899.985	103.413.417

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

	EUR Short Duration Credit Fund EUR	Global Equity Enhanced Income Fund USD	Global Factor Enhanced Equity Fund USD	Global Long/ Short Equity Fund USD	Global Small Cap Equity Fund USD
Aktiva					
Wertpapieranlagen zu Anschaffungskosten.....	370.673.218	68.646.468	34.733.332	117.322.298	20.411.256
Nicht realisierte Gewinne/(Verluste)	(18.525.554)	(3.413.389)	894.392	(913.422)	(2.586.721)
Wertpapieranlagen zum Marktwert	352.147.664	65.233.079	35.627.724	116.408.876	17.824.535
Bankguthaben	21.750.948	1.425.340	734.364	13.031.539	648.874
Abgesonderte Barsicherheiten	0	64.000	331.764	0	0
Forderungen aus Nachschusszahlungen auf Futures- Kontrakte	387.051	0	0	0	0
Nicht realisierter Gewinn aus offenen Devisenterminkontrakten	42.669	2.808	0	84.037	0
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	92.655	37.691	33.499	0	0
Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten	0	0	0	245.759	0
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten.....	0	0	0	0	0
Zinsforderungen	3.092.233	0	0	0	0
Dividendenforderungen	0	453.032	101.783	787.641	37.207
Forderungen aus Anlageverkäufen	17.476	0	0	0	892
Forderungen aus Anteilsausgaben	33.502	385.757	0	0	503.821
Gründungskosten	0	15.299	8.967	0	26.590
Forderungen gegenüber dem Anlageverwalter.....	2.448	14.552	24.116	0	25.188
Sonstige Vermögenswerte	2.019	1.050	0	952	0
Summe Aktiva	377.568.665	67.632.608	36.862.217	130.558.804	19.067.107
Passiva					
Verbindlichkeiten aus Nachschusszahlungen auf Futures- Kontrakte	0	16.276	14.239	0	0
Dividendenverbindlichkeiten aus Differenzkontrakten	0	0	0	31.772	0
Verbindlichkeiten aus Anlagekäufen	0	142	0	0	489.637
Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen	7.073.976	187.279	0	82.787	502
Zahlbare Anlageverwaltungsgebühren	0	0	0	47.129	0
Zahlbare Depotbank- und Verwaltungsgebühren	86.594	69.985	43.888	137.032	19.373
Zahlbare Prüfungshonorare und Steuerberatungskosten ...	7.874	9.004	7.892	7.864	6.372
Veräußerte Optionen zum Marktwert	0	119.708	0	0	0
Nicht realisierter Verlust aus offenen Devisenterminkontrakten	1.109.155	0	0	26.625	0
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten ...	134.872	0	0	0	0
Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten	0	0	0	1.862.854	0
Zahlbare Zeichnungssteuer	43.295	8.183	677	6.190	472
Zahlbare Mehrwertsteueraufwendungen	29.621	31.600	31.600	31.600	31.600
Aufwendungen für Berichte an die Anteilinhaber	31.675	11.188	6.033	15.352	12.278
Zahlbare Rechtskosten	21.644	9.983	18.367	18.580	14.499
Latente Steuerverbindlichkeiten	0	0	0	0	0
Sonstige Verbindlichkeiten	88.995	68.233	68.262	100.910	65.949
Summe Passiva	8.627.701	531.581	190.958	2.368.695	640.682
Gesamtes Fondsvermögen	368.940.964	67.101.027	36.671.259	128.190.109	18.426.425

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Vermögensbilanz zum 31. März 2023
(Fortsetzung)

	Small Cap Innovation Fund USD	U.S. All Cap Growth Fund USD	U.S. Large Cap Growth Fund USD	U.S. Select Equity Fund USD	U.S. Short- Term High Yield Bond Fund USD
Aktiva					
Wertpapieranlagen zu Anschaffungskosten.....	8.197.868	365.979.182	4.386.918	5.402.455	28.835.177
Nicht realisierte Gewinne/(Verluste)	(430.404)	116.237.056	1.485.533	(126.658)	(1.016.958)
Wertpapieranlagen zum Marktwert	7.767.464	482.216.238	5.872.451	5.275.797	27.818.219
Bankguthaben	419.822	6.028.816	128.665	438.493	1.658.682
Abgesonderte Barsicherheiten.....	0	0	0	0	0
Forderungen aus Nachschusszahlungen auf Futures- Kontrakte.....	0	0	0	0	0
Nicht realisierter Gewinn aus offenen Devisenterminkontrakten	152	30.310	0	0	183.953
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	0	0	0	0	0
Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten	0	0	0	0	0
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten.....	0	0	0	0	0
Zinsforderungen	0	0	0	0	488.572
Dividendenforderungen	1.275	40.748	7.348	2.279	0
Forderungen aus Anlageverkäufen.....	0	1.289.135	0	120.016	74.838
Forderungen aus Anteilsausgaben	139.745	387.594	0	0	0
Gründungskosten.....	53.027	0	0	0	0
Forderungen gegenüber dem Anlageverwalter.....	31.994	0	17.567	27.686	23.397
Sonstige Vermögenswerte	0	472	0	66.881	0
Summe Aktiva	8.413.479	489.993.313	6.026.031	5.931.152	30.247.661
Passiva					
Verbindlichkeiten aus Nachschusszahlungen auf Futures- Kontrakte.....	0	0	0	0	0
Dividendenverbindlichkeiten aus Differenzkontrakten	0	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Anlagekäufen	0	689.436	9.231	145.554	0
Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen	2.233	252.311	69.101	0	858
Zahlbare Anlageverwaltungsgebühren	0	310.922	0	0	0
Zahlbare Depotbank- und Verwaltungsgebühren	21.189	117.610	23.803	31.341	28.835
Zahlbare Prüfungshonorare und Steuerberatungskosten ...	6.372	6.920	7.469	6.921	6.921
Veräußerte Optionen zum Marktwert.....	0	0	0	0	0
Nicht realisierter Verlust aus offenen Devisenterminkontrakten	0	52	0	0	279
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten ...	0	0	0	0	0
Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten	0	0	0	0	0
Zahlbare Zeichnungssteuer	553	22.069	931	0	2.458
Zahlbare Mehrwertsteueraufwendungen	31.600	12.995	12.995	31.828	42.128
Aufwendungen für Berichte an die Anteilinhaber	13.509	31.534	27.705	0	13.423
Zahlbare Rechtskosten	16.139	15.030	17.675	14.633	16.394
Latente Steuerverbindlichkeiten.....	0	0	0	0	0
Sonstige Verbindlichkeiten.....	79.404	156.470	77.204	65.274	85.083
Summe Passiva	170.999	1.615.349	246.114	295.551	196.379
Gesamtes Fondsvermögen	8.242.480	488.377.964	5.779.917	5.635.601	30.051.282

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

	USD Investment Grade Credit Fund USD	Konsolidiert USD
Aktiva		
Wertpapieranlagen zu Anschaffungskosten.....	458.218.543	2.346.404.184
Nicht realisierte Gewinne/(Verluste)	(59.630.174)	(1.791.857)
Wertpapieranlagen zum Marktwert	398.588.369	2.344.612.327
Bankguthaben	633.019	89.529.023
Abgesonderte Barsicherheiten.....	0	5.983.563
Forderungen aus Nachschusszahlungen auf Futures-Kontrakte.....	0	717.045
Nicht realisierter Gewinn aus offenen Devisenterminkontrakten	4.516.597	6.547.385
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	0	780.719
Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten	0	815.298
Nicht realisierter Gewinn aus Swap-Kontrakten.....	0	46.805
Zinsforderungen	3.591.260	9.953.774
Dividendenforderungen.....	0	3.428.486
Forderungen aus Anlageverkäufen.....	85.102.035	87.039.176
Forderungen aus Anteilsausgaben	449.113	1.934.249
Gründungskosten.....	0	177.986
Forderungen gegenüber dem Anlageverwalter.....	15.367	397.870
Sonstige Vermögenswerte	2.633	141.975
Summe Aktiva	492.898.393	2.552.105.681
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Nachschusszahlungen auf Futures-Kontrakte	0	30.515
Dividendenverbindlichkeiten aus Differenzkontrakten	0	55.306
Verbindlichkeiten aus Anlagekäufen	22.407	1.373.682
Verbindlichkeiten aus Anteilsrücknahmen	85.175.959	94.510.226
Zahlbare Anlageverwaltungsgebühren	0	676.119
Zahlbare Depotbank- und Verwaltungsgebühren	161.499	1.216.562
Zahlbare Prüfungshonorare und Steuerberatungskosten.....	8.890	173.268
Veräußerte Optionen zum Marktwert.....	0	119.708
Nicht realisierter Verlust aus offenen Devisenterminkontrakten	175.488	2.906.212
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	0	719.373
Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten	0	2.381.574
Zahlbare Zeichnungssteuer	10.664	123.972
Zahlbare Mehrwertsteueraufwendungen	31.600	614.930
Aufwendungen für Berichte an die Anteilinhaber	55.262	409.305
Zahlbare Rechtskosten	19.718	390.070
Latente Steuerverbindlichkeiten.....	0	1.168.680
Sonstige Verbindlichkeiten	186.531	1.758.467
Summe Passiva	85.848.018	108.627.969
Gesamtes Fondsvermögen	407.050.375	2.443.477.712

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Vermögensbilanz zum 31. März 2023
(Fortsetzung)

	2 Degree Global Equity Fund	Alternative Risk Premia Fund	China A Focus Fund	Climate Focused Emerging Markets Equity Fund	Climate Focused Global Equity Fund
Anzahl der umlaufenden Anteile					
Anteile der Klasse A (SEK) - thes.	-	-	64.983	-	-
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	100	-	1.285	-	-
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	-	-	56	-	-
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	85	90	-	-	-
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	704.736	-	357	-	-
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	38.161	399.700	28	20.000	10.000
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	73	-	326	-	-
Anteile der Klasse Z (USD) - thes.	100	-	-	-	-

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

	Climate Focused U.S. Equity Fund	Climate Transition Global Investment Grade Credit Fund	Emerging Markets Equity Fund	Emerging Markets Equity Income Fund	EUR Investment Grade Credit Fund
Anzahl der umlaufenden Anteile					
Anteile der Klasse A (EUR) - aussch.	-	-	-	-	93
Anteile der Klasse A (SEK) - thes.	-	-	1.997	-	-
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	-	100	743	5.352	-
Anteile der Klasse A (USD) - brutto aussch.	-	-	-	124.574	-
Anteile der Klasse I (AUD) - aussch.	-	-	54	119.236	-
Anteile der Klasse I (CHF) - thes. (abgesichert)	-	-	-	-	1.034.963
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	-	-	1.447.262	61	81.478
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	-	85	-	-	-
Anteile der Klasse I (EUR) - aussch.	-	-	-	-	91
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	-	-	259.064	-	-
Anteile der Klasse I (GBP) - thes. (abgesichert)	-	1.167.608	-	-	-
Anteile der Klasse I (GBP) - aussch.	-	-	-	80	-
Anteile der Klasse I (SEK) - thes.	-	-	872.164	-	-
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	10.000	2.617	531.811	332.722	-
Anteile der Klasse I (USD) - aussch.	-	279.462	-	-	-
Anteile der Klasse I (USD) - brutto aussch.	-	-	-	82	-
Anteile der Klasse X (GBP) - thes.	-	-	-	203	-
Anteile der Klasse Y (EUR) - brutto aussch.	-	-	-	345	-
Anteile der Klasse Y (GBP) - brutto aussch.	-	-	-	360.814	-
Anteile der Klasse Y (USD) - brutto aussch.	-	-	-	749	-
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	-	-	761	-	-
Anteile der Klasse Z (USD) - thes.	-	-	100	-	-
Anteile der Klasse Z (USD) - aussch.	-	103	-	104	-

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Vermögensbilanz zum 31. März 2023
(Fortsetzung)

	EUR Short Duration Credit Fund	Global Equity Enhanced Income Fund	Global Factor Enhanced Equity Fund	Global Long/ Short Equity Fund	Global Small Cap Equity Fund
Anzahl der umlaufenden Anteile					
Anteile der Klasse A (EUR) - thes.....	92	-	-	-	-
Anteile der Klasse A (EUR) - aussch.....	92	-	-	-	-
Anteile der Klasse A (SGD) - aussch. (abgesichert).....	-	8.377	-	-	-
Anteile der Klasse A (USD) - thes.....	-	-	100	-	-
Anteile der Klasse A (USD) - aussch.....	-	910	-	-	-
Anteile der Klasse AP (USD) - thes.....	-	-	-	1.607	-
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.....	25.127	-	-	-	2.493
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.....	-	-	-	-	89.569
Anteile der Klasse I (USD) - thes.....	-	-	277.315	-	49.700
Anteile der Klasse I (USD) - aussch.....	-	55.318	-	-	-
Anteile der Klasse IP (AUD) - aussch. (abgesichert).....	-	-	-	235.607	-
Anteile der Klasse IP (EUR) - thes. (abgesichert).....	-	-	-	71.736	-
Anteile der Klasse IP (EUR) - aussch.....	-	-	-	11.300	-
Anteile der Klasse IP (GBP) - thes.....	-	-	-	17.190	-
Anteile der Klasse IP (USD) - thes.....	-	-	-	882.044	-
Anteile der Klasse X (EUR) - thes.....	2.438.199	-	-	-	-
Anteile der Klasse X (EUR) - aussch.....	176.495	-	-	-	-
Anteile der Klasse X (GBP) - aussch. (abgesichert).....	399	-	-	-	-
Anteile der Klasse X (GBP) - brutto aussch.....	-	24.382	-	-	-
Anteile der Klasse X (USD) - thes. (abgesichert).....	807.059	-	-	-	-
Anteile der Klasse X (USD) - brutto aussch.....	-	528.994	-	-	-
Anteile der Klasse X1 (EUR) - thes.....	172.951	-	-	-	-
Anteile der Klasse X1 (USD) - thes. (abgesichert).....	100	-	-	-	-
Anteile der Klasse Z (EUR) - aussch.....	93	-	-	-	-
Anteile der Klasse Z (GBP) - brutto aussch.....	-	5.243	-	-	-
Anteile der Klasse Z (USD) - thes.....	-	-	100	-	-
Anteile der Klasse ZP (USD) - thes.....	-	-	-	100	-

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

	Small Cap Innovation Fund	U.S. All Cap Growth Fund	U.S. Large Cap Growth Fund	U.S. Select Equity Fund	U.S. Short- Term High Yield Bond Fund	USD Investment Grade Credit Fund
Anzahl der umlaufenden Anteile						
Anteile der Klasse A (EUR) - thes.	-	-	-	932	-	-
Anteile der Klasse A (EUR) - thes. (abgesichert).....	-	8.378	-	-	-	-
Anteile der Klasse A (GBP) - thes.	-	1.402	-	-	-	-
Anteile der Klasse A (SGD) - thes. (abgesichert).....	136	5.143	-	-	-	-
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	-	95.089	15.398	773	15.198	23.933
Anteile der Klasse A (USD) - aussch.	-	-	-	-	-	1.370
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	-	10.304	1.235	-	-	-
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	-	331	-	-	139	80.774
Anteile der Klasse I (EUR) - aussch. (abgesichert)..	-	-	-	-	149	53.298
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	-	1.946	-	77	-	-
Anteile der Klasse I (GBP) - aussch. (abgesichert)..	-	-	-	-	349.329	1.717
Anteile der Klasse I (JPY) - thes. (abgesichert)	-	-	-	-	-	177.305
Anteile der Klasse I (SGD) - thes. (abgesichert)	-	-	-	-	-	100
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	49.266	628.057	125	30.500	10.124	567.669
Anteile der Klasse I (USD) - aussch.	-	-	-	-	-	172.292
Anteile der Klasse I (USD) - brutto aussch.	-	-	-	-	3.775	-
Anteile der Klasse X (GBP) - thes.	35.750	-	-	-	-	-
Anteile der Klasse Y (EUR) - thes.	-	806.490	-	-	-	-
Anteile der Klasse Y (EUR) - thes. (abgesichert)	-	-	-	-	-	3.076.277
Anteile der Klasse Y (EUR) - brutto aussch. (abgesichert)	-	-	-	-	-	2.516
Anteile der Klasse Y (USD) - brutto aussch.	-	-	-	-	-	156.969
Anteile der Klasse Z (EUR) - thes. (abgesichert)	106	9.651	-	-	-	-
Anteile der Klasse Z (EUR) - aussch. (abgesichert)	-	-	-	-	-	2.616
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	1.950	19.976	257	-	-	-
Anteile der Klasse Z (GBP) - aussch.	-	543	-	-	-	-
Anteile der Klasse Z (USD) - thes.	100	57.697	-	-	-	-
Anteile der Klasse Z (USD) - aussch.	-	78.285	-	1.216	-	104

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens
für das Geschäftsjahr zum 31. März 2023

	2 Degree Global Equity Fund USD	Alternative Risk Premia Fund USD	China A Focus Fund USD	Climate Focused Emerging Markets Equity Fund USD	Climate Focused Global Equity Fund USD
Ertrag					
Dividenden	2.676.586	250.206	264.447	72.774	18.379
Verzinsung	1.696	627.247	0	0	0
Zinsen aus Differenzkontrakten	0	19.245	0	0	0
Sonstige Erträge	329	0	0	0	0
Summe Ertrag	2.678.611	896.698	264.447	72.774	18.379
Aufwand					
Vergütung der Verwaltungsgesellschaft	44.650	26.309	13.629	22.590	22.884
Anlageverwaltungsgebühren	605.971	217.422	207.675	5.886	2.565
Depotbank- und Verwaltungsgebühren	90.709	88.444	37.339	18.323	0
Gebühren für Zahlstelle, Registerstelle und Transferstelle	27.203	30.460	44.384	21.423	0
Bezüge und Aufwendungen des Verwaltungsrats	10.044	7.966	9.222	10.637	8.687
Dividendenaufwand aus Differenzkontrakten	0	344.194	0	0	0
Zinsaufwand auf Swap-Kontrakte	0	40.143	0	0	0
Prüfungshonorare und Steuerberatungskosten	6.867	8.970	7.964	14.032	14.031
Zeichnungssteuer	10.302	3.650	6.794	118	59
Mehrwertsteueraufwendungen	6.038	25.544	6.040	10.717	10.690
Latenter Steueraufwand	0	0	0	0	0
Abschreibung auf Gründungskosten	8.088	15.380	0	5.158	5.659
Rechtskosten	28.331	38.046	35.450	50.216	54.209
Aufwendungen für Berichte an die Anteilinhaber	36.842	7.965	15.555	43.680	38.807
Registrierungsaufwendungen	15.938	11.572	13.347	24.609	17.629
Sonstige steuerliche Aufwendungen	793	255	129	0	0
Sonstige Aufwendungen	19.843	57.782	35.506	31.905	17.003
Summe Aufwand	911.619	924.102	433.034	259.294	192.223
Abzüglich: Gebührenverzicht und/oder Aufwandsrückerstattung	(205.537)	(271.081)	(188.373)	(259.076)	(191.068)
Nettoaufwand	706.082	653.021	244.661	218	1.155
Anlageertrag/(-verlust)	1.972.529	243.677	19.786	72.556	17.224
Realisierter und nicht realisierter Gewinn/(Verlust)					
Realisierter Nettoertrag/(-verlust) aus					
Kapitalanlagen	(12.501.823)	2.943	(1.560.259)	(133.514)	(45.123)
Devisenterminkontrakte	(6.724)	2.113.365	1.337	0	0
Futures-Kontrakte	51.237	(1.454.353)	0	0	0
Geschriebene Optionskontrakte	0	0	0	0	0
Differenzkontrakte	0	730.618	0	0	0
Swap-Kontrakte	0	339.718	0	0	0
sonstigen Devisengeschäften	(39.282)	(117.568)	(30.127)	(1.061)	(88)
Realisierter Nettoertrag/(-verlust)	(12.496.592)	1.614.723	(1.589.049)	(134.575)	(45.211)
Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus					
Kapitalanlagen	3.089.955	224.158	(452.460)	(158.775)	(20.227)
Devisenterminkontrakte	(19)	(270.066)	0	0	0
Futures-Kontrakte	(40.500)	88.922	0	0	0
Geschriebene Optionskontrakte	0	0	0	0	0
Differenzkontrakte	0	228.907	0	0	0
Swap-Kontrakte	0	107.264	0	0	0
sonstigen Devisengeschäften	(3.179)	22.786	(4.676)	3	(6)
Veränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste)	3.046.257	401.971	(457.136)	(158.772)	(20.233)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust)	(9.450.335)	2.016.694	(2.046.185)	(293.347)	(65.444)
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	(7.477.806)	2.260.371	(2.026.399)	(220.791)	(48.220)
Ausschüttungen an Anteilinhaber aus Gewinn/(Verlust)	0	0	0	0	0
Kapitaltransaktionen					
Erlöse aus Anteilsemission	7.997.635	0	1.533.030	0	0
Wiederanlage von Ausschüttungen	0	0	0	0	0
Zahlungsausgänge aus der Rücknahme von Anteilen	(40.661.020)	(16.584)	(2.312.339)	0	0
Nettozunahme/(-abnahme) des Fondsvermögens aus Kapitaltransaktionen	(32.663.385)	(16.584)	(779.309)	0	0
Zunahme/(Abnahme) des gesamten Fondsvermögens	(40.141.191)	2.243.787	(2.805.708)	(220.791)	(48.220)
Fondsvermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	136.462.467	34.581.921	16.601.153	1.939.647	952.331
Währungsberichtigung					
Fondsvermögen zum Ende des Berichtszeitraums	96.321.276	36.825.708	13.795.445	1.718.856	904.111

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens
für das Geschäftsjahr zum 31. März 2023 (Fortsetzung)

	Climate Focused U.S. Equity Fund USD	Climate Transition Global Investment Grade Credit Fund USD	Emerging Markets Equity Fund USD	Emerging Markets Equity Income Fund USD	EUR Investment Grade Credit Fund EUR
Ertrag					
Dividenden	12.921	0	7.228.324	5.195.286	0
Verzinsung	0	4.282.880	0	0	1.944.198
Zinsen aus Differenzkontrakten	0	0	0	0	0
Sonstige Erträge	31.067	0	0	0	0
Summe Ertrag	43.988	4.282.880	7.228.324	5.195.286	1.944.198
Aufwand					
Vergütung der Verwaltungsgesellschaft	22.884	60.273	100.776	70.727	42.239
Anlageverwaltungsgebühren	2.087	440.823	3.342.194	1.204.832	319.631
Depotbank- und Verwaltungsgebühren	994	188.587	224.845	270.582	124.680
Gebühren für Zahlstelle, Registerstelle und Transferstelle	20.425	47.757	53.209	65.050	41.879
Bezüge und Aufwendungen des Verwaltungsrats	8.937	7.966	9.250	16.801	10.979
Dividendenaufwand aus Differenzkontrakten	0	0	0	0	0
Zinsaufwand auf Swap-Kontrakte	0	0	0	0	0
Prüfungshonorare und Steuerberatungskosten	13.601	8.966	7.964	7.964	6.823
Zeichnungssteuer	57	14.649	33.970	16.934	10.455
Mehrwertsteueraufwendungen	10.690	25.521	36.379	31.926	24.344
Latenter Steueraufwand	0	0	0	0	0
Abschreibung auf Gründungskosten	5.659	9.138	0	0	0
Rechtskosten	53.378	50.337	50.323	50.839	50.852
Aufwendungen für Berichte an die Anteilinhaber	38.905	45.869	20.169	46.347	39.292
Registrierungsaufwendungen	22.965	9.029	17.573	17.575	6.597
Sonstige steuerliche Aufwendungen	0	1.123	8.012	6.189	790
Sonstige Aufwendungen	7.585	54.385	256.521	128.885	31.291
Summe Aufwand	208.167	964.423	4.161.185	1.934.651	709.852
Abzüglich: Gebührenverzicht und/oder Aufwandsrückerstattung	(174.179)	(300.956)	(28.952)	(379.788)	(229.741)
Nettoaufwand	33.988	663.467	4.132.233	1.554.863	480.111
Anlageertrag/(-verlust)	10.000	3.619.413	3.096.091	3.640.423	1.464.087
Realisierter und nicht realisierter Gewinn/(Verlust)					
Realisierter Nettoertrag/(-verlust) aus					
Kapitalanlagen	(30.034)	(4.384.345)	(22.897.822)	(7.544.140)	(4.672.118)
Devisenterminkontrakte	0	(5.910.025)	(1.154)	(18.359)	2.206.600
Futures-Kontrakte	0	0	0	0	186.614
Geschriebene Optionskontrakte	0	0	0	0	0
Differenzkontrakte	0	0	0	0	0
Swap-Kontrakte	0	0	0	0	0
sonstigen Devisengeschäften	0	(125.946)	(207.233)	(197.952)	13.870
Realisierter Nettoertrag/(-verlust)	(30.034)	(10.420.316)	(23.106.209)	(7.760.451)	(2.265.034)
Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus					
Kapitalanlagen	(64.010)	(9.764.190)	(21.099.332)	(17.702.213)	(6.732.675)
Devisenterminkontrakte	0	333.511	(255)	(274)	(105.055)
Futures-Kontrakte	0	0	0	0	(40.912)
Geschriebene Optionskontrakte	0	0	0	0	0
Differenzkontrakte	0	0	0	0	0
Swap-Kontrakte	0	0	0	0	0
sonstigen Devisengeschäften	0	28.641	63.193	(5.477)	1.249
Veränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste)	(64.010)	(9.402.038)	(21.036.394)	(17.707.964)	(6.877.393)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust)	(94.044)	(19.822.354)	(44.142.603)	(25.468.415)	(9.142.427)
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	(84.044)	(16.202.941)	(41.046.512)	(21.827.992)	(7.678.340)
Ausschüttungen an Anteilinhaber aus Gewinn/(Verlust)	0	(615.533)	(3)	(3.197.557)	(201)
Kapitaltransaktionen					
Erlöse aus Anteilsemission	0	63.226.057	25.090.725	5.772.436	2.027.900
Wiederanlage von Ausschüttungen	0	615.525	0	438.186	201
Zahlungsausgänge aus der Rücknahme von Anteilen	0	(20.675.790)	(94.334.718)	(72.931.800)	(3.993.876)
Nettozunahme/(-abnahme) des Fondsvermögens aus Kapitaltransaktionen	0	43.165.792	(69.243.993)	(66.721.178)	(1.965.775)
Zunahme/(Abnahme) des gesamten Fondsvermögens	(84.044)	26.347.318	(110.290.508)	(91.746.727)	(9.644.316)
Fondsvermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	948.891	123.917.776	438.457.042	197.646.712	113.057.733
Währungsberichtigung					
Fondsvermögen zum Ende des Berichtszeitraums	864.847	150.265.094	328.166.534	105.899.985	103.413.417

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens
für das Geschäftsjahr zum 31. März 2023 (Fortsetzung)

	EUR Short Duration Credit Fund EUR	Global Equity Enhanced Income Fund USD	Global Factor Enhanced Equity Fund USD	Global Long/ Short Equity Fund USD	Global Small Cap Equity Fund USD
Ertrag					
Dividenden	0	2.078.810	771.225	4.614.223	205.238
Verzinsung	4.122.055	925	2.206	0	0
Zinsen aus Differenzkontrakten	0	0	0	307.477	0
Sonstige Erträge	1.317	0	0	0	0
Summe Ertrag	4.123.372	2.079.735	773.431	4.921.700	205.238
Aufwand					
Vergütung der Verwaltungsgesellschaft	79.176	26.431	19.845	56.989	26.657
Anlageverwaltungsgebühren	353.679	195.344	57.176	1.201.234	147.288
Depotbank- und Verwaltungsgebühren	183.721	103.213	107.821	317.060	38.383
Gebühren für Zahlstelle, Registerstelle und Transferstelle	45.304	47.091	34.854	44.150	32.433
Bezüge und Aufwendungen des Verwaltungsrats	9.116	9.615	10.123	9.063	11.303
Dividendenaufwand aus Differenzkontrakten	0	0	0	313.375	0
Zinsaufwand auf Swap-Kontrakte	0	0	0	0	0
Prüfungshonorare und Steuerberatungskosten	9.359	11.821	8.373	8.470	6.863
Zeichnungssteuer	141.317	27.964	3.656	15.551	1.675
Mehrwertsteueraufwendungen	24.344	25.544	25.521	25.547	25.521
Latenter Steueraufwand	0	0	0	0	0
Abschreibung auf Gründungskosten	0	10.452	7.164	0	15.961
Rechtskosten	42.388	35.001	43.481	50.872	49.888
Aufwendungen für Berichte an die Anteilinhaber	34.323	50.845	0	22.979	29.724
Registrierungsaufwendungen	15.139	14.689	11.388	17.679	17.685
Sonstige steuerliche Aufwendungen	1.753	10.386	301	1.171	144
Sonstige Aufwendungen	41.714	40.017	16.317	43.368	32.791
Summe Aufwand	981.333	608.413	346.020	2.127.508	436.316
Abzüglich: Gebührenverzicht und/oder Aufwandsrückerstattung	(340.867)	(345.252)	(256.821)	(225.123)	(271.676)
Nettoaufwand	640.466	263.161	89.199	1.902.385	164.640
Anlagertrag/(-verlust)	3.482.906	1.816.574	684.232	3.019.315	40.598
Realisierter und nicht realisierter Gewinn/(Verlust)					
Realisierter Nettoertrag/(-verlust) aus					
Kapitalanlagen	(8.033.519)	660.908	1.070.991	(15.969.554)	(1.034.005)
Devisenterminkontrakte	(764.258)	2.994	(4.685)	(1.585.430)	(837)
Futures-Kontrakte	446.212	(462.771)	14.116	0	0
Geschriebene Optionskontrakte	0	(109.811)	0	0	0
Differenzkontrakte	0	0	0	9.995.556	0
Swap-Kontrakte	0	0	0	0	0
sonstigen Devisengeschäften	(21.500)	(13.167)	(5.533)	(11.752)	(5.421)
Realisierter Nettoertrag/(-verlust)	(8.373.065)	78.153	1.074.889	(7.571.180)	(1.040.263)
Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus					
Kapitalanlagen	(10.061.024)	(6.803.198)	(4.363.924)	259.752	(243.132)
Devisenterminkontrakte	(1.100.824)	1.265	(761)	(126.457)	(146)
Futures-Kontrakte	(297.635)	6.038	(48.061)	0	0
Geschriebene Optionskontrakte	0	13.867	0	0	0
Differenzkontrakte	0	0	0	(1.407.713)	0
Swap-Kontrakte	0	0	0	0	0
sonstigen Devisengeschäften	2.732	1.535	(684)	(2.310)	1.282
Veränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste)	(11.456.751)	(6.780.493)	(4.413.430)	(1.276.728)	(241.996)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust)	(19.829.816)	(6.702.340)	(3.338.541)	(8.847.908)	(1.282.259)
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	(16.346.910)	(4.885.766)	(2.654.309)	(5.828.593)	(1.241.661)
Ausschüttungen an Anteilinhaber aus Gewinn/(Verlust)	(43.440)	(3.576.502)	0	(170.691)	0
Kapitaltransaktionen					
Erlöse aus Anteilsemission	227.007.565	22.831.480	3.534.000	16.381.303	1.287.017
Wiederanlage von Ausschüttungen	169	36.122	0	37	0
Zahlungsausgänge aus der Rücknahme von Anteilen	(128.582.931)	(17.223.682)	(10.280.307)	(46.798.201)	(842.535)
Nettozunahme/(-abnahme) des Fondsvermögens aus Kapitaltransaktionen	98.424.803	5.643.920	(6.746.307)	(30.416.861)	444.482
Zunahme/(Abnahme) des gesamten Fondsvermögens	82.034.453	(2.818.348)	(9.400.616)	(36.416.145)	(797.179)
Fondsvermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	286.906.511	69.919.375	46.071.875	164.606.254	19.223.604
Währungsberichtigung					
Fondsvermögen zum Ende des Berichtszeitraums	368.940.964	67.101.027	36.671.259	128.190.109	18.426.425

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens
für das Geschäftsjahr zum 31. März 2023 (Fortsetzung)

	Small Cap Innovation Fund USD	U.S. All Cap Growth Fund USD	U.S. Large Cap Growth Fund USD	U.S. Select Equity Fund USD	U.S. Short- Term High Yield Bond Fund USD
Ertrag					
Dividenden	19.910	2.197.968	428.810	979.842	0
Verzinsung	0	0	0	0	1.898.091
Zinsen aus Differenzkontrakten	0	0	0	0	0
Sonstige Erträge	0	0	0	0	0
Summe Ertrag	19.910	2.197.968	428.810	979.842	1.898.091
Aufwand					
Vergütung der Verwaltungsgesellschaft	26.657	230.371	43.531	47.458	28.315
Anlageverwaltungsgebühren	51.382	4.623.837	811.788	871.599	194.951
Depotbank- und Verwaltungsgebühren	51.907	215.682	53.796	74.165	68.672
Gebühren für Zahlstelle, Registerstelle und Transferstelle	59.432	101.170	49.916	37.239	43.738
Bezüge und Aufwendungen des Verwaltungsrats	10.718	10.825	16.029	9.987	9.704
Dividendenaufwand aus Differenzkontrakten	0	0	0	0	0
Zinsaufwand auf Swap-Kontrakte	0	0	0	0	0
Prüfungshonorare und Steuerberatungskosten	6.867	7.964	8.512	7.964	7.136
Zeichnungssteuer	1.737	98.928	10.087	9.041	4.025
Mehrwertsteueraufwendungen	25.547	7.564	6.040	25.785	36.075
Latenter Steueraufwand	0	0	0	27.288	0
Abschreibung auf Gründungskosten	625	0	0	0	0
Rechtskosten	42.353	43.077	50.423	45.040	49.549
Aufwendungen für Berichte an die Anteilinhaber	48.958	42.844	25.164	11.524	5.424
Registrierungsaufwendungen	11.390	6.885	12.924	12.061	19.388
Sonstige steuerliche Aufwendungen	78	9.622	6.163	178.358	277
Sonstige Aufwendungen	15.657	75.971	32.920	43.715	30.865
Summe Aufwand	353.308	5.474.740	1.127.293	1.401.224	498.119
Abzüglich: Gebührenverzicht und/oder Aufwandsrückerstattung	(294.725)	(103.613)	(95.625)	(195.546)	(206.536)
Nettoaufwand	58.583	5.371.127	1.031.668	1.205.678	291.583
Anlageertrag/(-verlust)	(38.673)	(3.173.159)	(602.858)	(225.836)	1.606.508
Realisierter und nicht realisierter Gewinn/(Verlust)					
Realisierter Nettoertrag/(-verlust) aus					
Kapitalanlagen	(1.425.114)	(28.242.159)	19.523.253	13.850.109	(1.670.585)
Devisenterminkontrakte	(2.673)	(215.388)	(1.296)	(3.117)	(2.126.973)
Futures-Kontrakte	0	0	0	0	0
Geschriebene Optionskontrakte	0	0	0	0	0
Differenzkontrakte	0	0	0	0	0
Swap-Kontrakte	0	0	0	0	0
sonstigen Devisengeschäften	(1.424)	(66.500)	(45.766)	(8)	9.566
Realisierter Nettoertrag/(-verlust)	(1.429.211)	(28.524.047)	19.476.191	13.846.984	(3.787.992)
Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus					
Kapitalanlagen	44.729	(105.046.532)	(65.480.058)	(32.552.470)	(491.143)
Devisenterminkontrakte	(150)	5.312	(80)	(185)	227.734
Futures-Kontrakte	0	0	0	0	0
Geschriebene Optionskontrakte	0	0	0	0	0
Differenzkontrakte	0	0	0	0	0
Swap-Kontrakte	0	0	0	0	0
sonstigen Devisengeschäften	12	287	0	1	4
Veränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste)	44.591	(105.040.933)	(65.480.138)	(32.552.654)	(263.405)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust)	(1.384.620)	(133.564.980)	(46.003.947)	(18.705.670)	(4.051.397)
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	(1.423.293)	(136.738.139)	(46.606.805)	(18.931.506)	(2.444.889)
Ausschüttungen an Anteilinhaber aus Gewinn/(Verlust)	0	0	0	0	(1.572.752)
Kapitaltransaktionen					
Erlöse aus Anteilsemission	3.799.628	70.529.312	1.736.598	5.340.904	2.807.343
Wiederanlage von Ausschüttungen	0	0	0	0	1.130.540
Zahlungsausgänge aus der Rücknahme von Anteilen	(2.051.932)	(253.395.223)	(148.048.031)	(172.147.622)	(25.258.780)
Nettozunahme/(-abnahme) des Fondsvermögens aus Kapitaltransaktionen	1.747.696	(182.865.911)	(146.311.433)	(166.806.718)	(21.320.897)
Zunahme/(Abnahme) des gesamten Fondsvermögens	324.403	(319.604.050)	(192.918.238)	(185.738.224)	(25.338.538)
Fondsvermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	7.918.077	807.982.014	198.698.155	191.373.825	55.389.820
Währungsberichtigung					
Fondsvermögen zum Ende des Berichtszeitraums	8.242.480	488.377.964	5.779.917	5.635.601	30.051.282

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Aufwands- und Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens
für das Geschäftsjahr zum 31. März 2023 (Fortsetzung)

	USD Investment Grade Credit Fund USD	Konsolidiert USD
Ertrag		
Dividenden	0	27.014.949
Verzinsung	15.892.838	29.023.885
Zinsen aus Differenzkontrakten	0	326.722
Sonstige Erträge	0	32.768
Summe Ertrag	15.892.838	56.398.324
Aufwand		
Vergütung der Verwaltungsgesellschaft	151.626	1.169.056
Anlageverwaltungsgebühren	850.447	15.735.754
Depotbank- und Verwaltungsgebühren	384.603	2.656.324
Gebühren für Zahlstelle, Registerstelle und Transferstelle	88.945	939.680
Bezüge und Aufwendungen des Verwaltungsrats	12.584	220.390
Dividendenaufwand aus Differenzkontrakten	0	657.569
Zinsaufwand auf Swap-Kontrakte	0	40.143
Prüfungshonorare und Steuerberatungskosten	9.663	190.845
Zeichnungssteuer	45.192	462.460
Mehrwertsteueraufwendungen	25.544	442.941
Latenter Steueraufwand	0	27.288
Abschreibung auf Gründungskosten	0	83.284
Rechtskosten	48.567	966.489
Aufwendungen für Berichte an die Anteilinhaber	52.199	660.470
Registrierungsaufwendungen	16.725	313.689
Sonstige steuerliche Aufwendungen	3.220	228.870
Sonstige Aufwendungen	52.040	1.069.111
Summe Aufwand	1.741.355	25.864.363
Abzüglich: Gebührenverzicht und/oder Aufwandsrückerstattung	(278.952)	(4.867.168)
Nettoaufwand	1.462.403	20.997.195
Anlageertrag/(-verlust)	14.430.435	35.401.129
Realisierter und nicht realisierter Gewinn/(Verlust)		
Realisierter Nettoertrag/(-verlust) aus		
Kapitalanlagen	(24.960.792)	(100.523.986)
Devisenterminkontrakte	(23.649.601)	(29.906.367)
Futures-Kontrakte	0	(1.192.683)
Geschriebene Optionskontrakte	0	(109.811)
Differenzkontrakte	0	10.726.174
Swap-Kontrakte	0	339.718
sonstigen Devisengeschäften	2.191	(865.017)
Realisierter Nettoertrag/(-verlust)	(48.608.202)	(121.531.972)
Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus		
Kapitalanlagen	(24.185.305)	(302.299.012)
Devisenterminkontrakte	1.887.752	801.258
Futures-Kontrakte	0	(346.198)
Geschriebene Optionskontrakte	0	13.867
Differenzkontrakte	0	(1.178.806)
Swap-Kontrakte	0	107.264
sonstigen Devisengeschäften	(212)	105.346
Veränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste)	(22.297.765)	(302.796.281)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust)	(70.905.967)	(424.328.253)
Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit	(56.475.532)	(388.927.124)
Ausschüttungen an Anteilinhaber aus Gewinn/(Verlust)	(1.852.474)	(11.030.964)
Kapitaltransaktionen		
Erlöse aus Anteilsemission	122.632.404	593.040.309
Wiederanlage von Ausschüttungen	2.606	2.223.401
Zahlungsausgänge aus der Rücknahme von Anteilen	(212.596.158)	(1.257.653.467)
Nettozunahme/(-abnahme) des Fondsvermögens aus Kapitaltransaktionen	(89.961.148)	(662.389.757)
Zunahme/(Abnahme) des gesamten Fondsvermögens	(148.289.154)	(1.062.347.845)
Fondsvermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	555.339.529	3.513.050.684
Währungsberichtigung		(7.225.127)
Fondsvermögen zum Ende des Berichtszeitraums	407.050.375	2.443.477.712

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

	31. März 2023 in Währung	31. März 2022 in Währung	31. März 2021 in Währung
2 Degree Global Equity Fund¹			
Fondsvermögen (USD)	96.321.276	136.462.467	-
Gesamtes Fondsvermögen			
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	9.553	9.980	-
Anteile der Klasse I (CHF) - thes.	-	9.246	-
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	7.810	8.426	-
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	75.068.479	103.811.738	-
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	3.679.484	10.018	-
Anteile der Klasse X (GBP) - thes.	-	7.184	-
Anteile der Klasse Z (CHF) - thes.	-	9.246	-
Anteile der Klasse Z (EUR) - thes. (abgesichert)	-	8.426	-
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	7.775	7.588	-
Anteile der Klasse Z (USD) - thes.	9.641	10.018	-
Nettoinventarwert je Anteil			
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	95,53	99,80	-
Anteile der Klasse I (CHF) - thes.	-	100,50	-
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	91,88	99,13	-
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	106,52	103,94	-
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	96,42	100,18	-
Anteile der Klasse X (GBP) - thes.	-	95,79	-
Anteile der Klasse Z (CHF) - thes.	-	100,50	-
Anteile der Klasse Z (EUR) - thes. (abgesichert)	-	99,13	-
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	106,51	103,94	-
Anteile der Klasse Z (USD) - thes.	96,41	100,18	-
Alternative Risk Premia Fund			
Fondsvermögen (USD)	36.825.708	34.581.921	34.317.774
Gesamtes Fondsvermögen			
Anteile der Klasse I (CHF) - thes. (abgesichert)	-	8.302	8.323
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	7.908	7.580	7.590
Anteile der Klasse I (GBP) - thes. (abgesichert)	-	6.484	6.448
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	36.816.367	34.554.065	34.290.263
Nettoinventarwert je Anteil			
Anteile der Klasse I (CHF) - thes. (abgesichert)	-	83,86	84,07
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	87,87	84,22	84,33
Anteile der Klasse I (GBP) - thes. (abgesichert)	-	85,31	84,84
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	92,11	86,45	85,79
China A Focus Fund			
Fondsvermögen (USD)	13.795.445	16.601.153	22.399.656
Gesamtes Fondsvermögen			
Anteile der Klasse A (SEK) - thes.	135.496.703	145.911.449	185.962.845
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	466.802	762.213	814.782
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	20.730	22.912	55.169
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	103.034	62.332	17.175
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	11.289	70.908	14.438
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	91.316	108.248	137.208
Nettoinventarwert je Anteil			
Anteile der Klasse A (SEK) - thes.	2.085,11	2.143,55	2.273,44
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	363,27	412,23	470,70
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	370,18	409,15	437,85
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	288,61	305,55	330,29
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	403,17	454,54	515,64
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	280,11	296,57	320,58

¹ Der Teilfonds nahm seine Geschäftstätigkeit am 20. Juli 2021 auf.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

	31. März 2023 in Währung	31. März 2022 in Währung	31. März 2021 in Währung
Climate Focused Emerging Markets Equity Fund¹			
Fondsvermögen (USD)	1.718.856	1.939.647	-
Gesamtes Fondsvermögen			
Anteile der Klasse I (USD) - thes.....	1.718.856	1.939.647	-
Nettoinventarwert je Anteil			
Anteile der Klasse I (USD) - thes.....	85,94	96,98	-
Climate Focused Global Equity Fund²			
Fondsvermögen (USD)	904.111	952.331	-
Gesamtes Fondsvermögen			
Anteile der Klasse I (USD) - thes.....	904.111	952.331	-
Nettoinventarwert je Anteil			
Anteile der Klasse I (USD) - thes.....	90,41	95,23	-
Climate Focused U.S. Equity Fund²			
Fondsvermögen (USD)	864.847	948.891	-
Gesamtes Fondsvermögen			
Anteile der Klasse I (USD) - thes.....	864.847	948.891	-
Nettoinventarwert je Anteil			
Anteile der Klasse I (USD) - thes.....	86,48	94,89	-
Climate Transition Global Investment Grade Credit Fund³			
Fondsvermögen (USD)	150.265.094	123.917.776	46.726.257
Gesamtes Fondsvermögen			
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	8.542	9.200	-
Anteile der Klasse I (CHF) - aussch. (abgesichert).....	-	9.375	10.111
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	7.085	7.797	-
Anteile der Klasse I (EUR) - aussch. (abgesichert).....	-	8.584	9.233
Anteile der Klasse I (GBP) - thes. (abgesichert)	101.465.135	64.505.899	7.135
Anteile der Klasse I (GBP) - aussch. (abgesichert).....	-	7.581	3.754.922
Anteile der Klasse I (USD) - thes.....	225.350	9.228	-
Anteile der Klasse I (USD) - aussch.	24.846.966	39.086.556	41.477.400
Anteile der Klasse Z (CHF) - aussch. (abgesichert).....	-	9.375	10.111
Anteile der Klasse Z (EUR) - aussch. (abgesichert)	-	8.584	9.233
Anteile der Klasse Z (GBP) - aussch. (abgesichert)	-	7.573	7.981
Anteile der Klasse Z (USD) - aussch.	9.153	9.846	10.390
Nettoinventarwert je Anteil			
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	85,42	92,00	-
Anteile der Klasse I (CHF) - aussch. (abgesichert).....	-	93,75	101,11
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	83,35	91,73	-
Anteile der Klasse I (EUR) - aussch. (abgesichert).....	-	94,33	101,46
Anteile der Klasse I (GBP) - thes. (abgesichert)	86,90	94,20	99,10
Anteile der Klasse I (GBP) - aussch. (abgesichert).....	-	95,96	102,42
Anteile der Klasse I (USD) - thes.....	86,11	92,28	-
Anteile der Klasse I (USD) - aussch.	88,91	97,48	103,90
Anteile der Klasse Z (CHF) - aussch. (abgesichert).....	-	93,75	101,11
Anteile der Klasse Z (EUR) - aussch. (abgesichert)	-	94,33	101,46
Anteile der Klasse Z (GBP) - aussch. (abgesichert)	-	95,86	102,32
Anteile der Klasse Z (USD) - aussch.	88,86	97,49	103,90

¹ Der Teilfonds nahm seine Geschäftstätigkeit am 23. Februar 2022 auf.

² Der Teilfonds nahm seine Geschäftstätigkeit am 29. Dezember 2021 auf.

³ Der Teilfonds wurde am 23. August 2021 von Global Investment Grade Credit Fund in Climate Transition Global Investment Grade Credit Fund umbenannt.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Emerging Markets Equity Fund	31 . März 2023 <i>in Währung</i>	31 . März 2022 <i>in Währung</i>	31 . März 2021 <i>in Währung</i>
Fondsvermögen (USD)	328.166.534	438.457.042	437.715.035
Gesamtes Fondsvermögen			
Anteile der Klasse A (SEK) - thes.	1.655.912	71.682	-
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	77.525	141.129	290.791
Anteile der Klasse I (AUD) - aussch.	10.418	4.502	5.640
Anteile der Klasse I (CHF) - thes. (abgesichert)	-	9.854	12.724
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	153.250.573	175.831.452	183.974.900
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	24.121.449	25.217.590	36.727.992
Anteile der Klasse I (SEK) - thes.	734.266.150	853.111.913	-
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	61.115.720	119.878.173	170.976.992
Anteile der Klasse Z (CHF) - thes. (abgesichert)	-	9.844	12.717
Anteile der Klasse Z (EUR) - thes.	-	9.455	11.350
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	76.389	7.901	9.580
Anteile der Klasse Z (USD) - thes.	9.596	10.445	13.291
Nettoinventarwert je Anteil			
Anteile der Klasse A (SEK) - thes.	829,20	823,93	-
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	104,34	114,46	146,79
Anteile der Klasse I (AUD) - aussch.	192,93	187,57	234,99
Anteile der Klasse I (CHF) - thes. (abgesichert)	-	100,55	129,84
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	105,89	112,98	135,61
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	93,11	95,16	115,38
Anteile der Klasse I (SEK) - thes.	841,89	830,07	-
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	114,92	125,08	159,14
Anteile der Klasse Z (CHF) - thes. (abgesichert)	-	100,45	129,77
Anteile der Klasse Z (EUR) - thes.	-	102,77	123,37
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	100,38	102,61	124,42
Anteile der Klasse Z (USD) - thes.	95,96	104,45	132,91

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Emerging Markets Equity Income Fund	31 . März 2023 <i>in Währung</i>	31 . März 2022 <i>in Währung</i>	31 . März 2021 <i>in Währung</i>
Fondsvermögen (USD)	105.899.985	197.646.712	163.462.960
Gesamtes Fondsvermögen			
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	670.713	886.403	965.523
Anteile der Klasse A (USD) - brutto aussch.	11.767.260	16.637.421	21.290.831
Anteile der Klasse I (AUD) - aussch.	16.850.432	19.910.354	22.724.830
Anteile der Klasse I (CHF) - aussch. (abgesichert).....	-	10.657	11.649
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	7.669	8.569	8.585
Anteile der Klasse I (EUR) - aussch.	-	10.184	10.356
Anteile der Klasse X (GBP) - thes.	-	8.760	-
Anteile der Klasse I (GBP) - aussch.	7.978	8.567	8.783
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	45.296.773	109.838.636	63.614.422
Anteile der Klasse I (USD) - brutto aussch.	9.684	11.104	12.165
Anteile der Klasse X (GBP) - thes.	21.770	24.542	25.373
Anteile der Klasse Y (EUR) - brutto aussch.	28.511	33.299	759.940
Anteile der Klasse Y (GBP) - brutto aussch.	29.796.020	41.957.824	42.943.486
Anteile der Klasse Y (USD) - brutto aussch.	60.751	71.699	79.265
Anteile der Klasse Z (CHF) - aussch. (abgesichert).....	-	10.657	11.648
Anteile der Klasse Z (EUR) - aussch.	-	10.184	10.356
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	-	10.878	11.969
Anteile der Klasse Z (GBP) - aussch.	-	8.568	8.782
Anteile der Klasse Z (USD) - aussch.	9.897	11.274	12.164
Nettoinventarwert je Anteil			
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	125,32	143,92	154,04
Anteile der Klasse A (USD) - brutto aussch.	94,46	113,31	126,75
Anteile der Klasse I (AUD) - aussch.	141,32	148,18	157,54
Anteile der Klasse I (CHF) - aussch. (abgesichert).....	-	107,65	118,87
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	125,72	140,47	140,73
Anteile der Klasse I (EUR) - aussch.	-	109,50	112,57
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	-	100,69	-
Anteile der Klasse I (GBP) - aussch.	99,72	109,83	114,06
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	136,14	155,17	164,82
Anteile der Klasse I (USD) - brutto aussch.	118,10	140,56	155,96
Anteile der Klasse X (GBP) - thes.	107,24	114,68	115,86
Anteile der Klasse Y (EUR) - brutto aussch.	82,64	96,52	107,90
Anteile der Klasse Y (GBP) - brutto aussch.	82,58	92,40	97,45
Anteile der Klasse Y (USD) - brutto aussch.	81,11	96,63	106,97
Anteile der Klasse Z (CHF) - aussch. (abgesichert).....	-	107,65	118,86
Anteile der Klasse Z (EUR) - aussch.	-	109,50	112,56
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	-	118,24	119,69
Anteile der Klasse Z (GBP) - aussch.	-	109,84	114,05
Anteile der Klasse Z (USD) - aussch.	95,16	111,62	121,64
EUR Investment Grade Credit Fund			
Fondsvermögen (EUR)	103.413.417	113.057.733	103.492.609
Gesamtes Fondsvermögen			
Anteile der Klasse A (EUR) - aussch.	7.898	8.651	9.237
Anteile der Klasse I (CHF) - thes. (abgesichert)	94.968.205	104.841.752	111.506.914
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	7.711.078	10.644.498	2.653.813
Anteile der Klasse I (EUR) - aussch.	6.830	7.479	7.987
Anteile der Klasse Z (EUR) - aussch.	-	8.654	9.241
Nettoinventarwert je Anteil			
Anteile der Klasse A (EUR) - aussch.	84,93	94,03	100,40
Anteile der Klasse I (CHF) - thes. (abgesichert)	91,76	101,30	107,74
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	94,64	103,43	109,63
Anteile der Klasse I (EUR) - aussch.	75,06	83,10	88,74
Anteile der Klasse Z (EUR) - aussch.	-	94,07	100,45

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

	31 . März 2023 in Währung	31 . März 2022 in Währung	31 . März 2021 in Währung
EUR Short Duration Credit Fund			
Fondsvermögen (EUR)	368.940.964	286.906.511	332.293.014
Gesamtes Fondsvermögen			
Anteile der Klasse A (EUR) - thes.	8.373	8.859	9.202
Anteile der Klasse A (EUR) - aussch.	8.343	8.859	9.202
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	29.300.595	50.744.512	69.610.003
Anteile der Klasse I (EUR) - aussch.	-	1.023	11.191.627
Anteile der Klasse I (GBP) - thes. (abgesichert)	-	1.198	1.231
Anteile der Klasse X (EUR) - thes.	231.238.793	203.719.403	216.830.180
Anteile der Klasse X (EUR) - aussch.	16.304.608	8.053.045	6.718.264
Anteile der Klasse X (GBP) - aussch. (abgesichert)	36.640	7.521	7.735
Anteile der Klasse X (USD) - thes. (abgesichert)	82.223.171	10.458	10.696
Anteile der Klasse X1 (EUR) - thes.	16.336.951	24.319.800	27.879.263
Anteile der Klasse X1 (USD) - thes. (abgesichert)	10.154	10.429	10.674
Anteile der Klasse Z (EUR) - thes.	-	8.962	9.252
Anteile der Klasse Z (EUR) - aussch.	8.500	8.925	9.241
Nettoinventarwert je Anteil			
Anteile der Klasse A (EUR) - thes.	91,01	96,29	100,02
Anteile der Klasse A (EUR) - aussch.	90,68	96,29	100,02
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	1.166,10	1.227,67	1.268,82
Anteile der Klasse I (EUR) - aussch.	-	1.023,44	1.058,41
Anteile der Klasse I (GBP) - thes. (abgesichert)	-	1.198,24	1.230,96
Anteile der Klasse X (EUR) - thes.	94,84	99,70	102,89
Anteile der Klasse X (EUR) - aussch.	92,38	97,55	100,94
Anteile der Klasse X (GBP) - aussch. (abgesichert)	91,83	97,67	100,45
Anteile der Klasse X (USD) - thes. (abgesichert)	101,88	104,58	106,96
Anteile der Klasse X1 (EUR) - thes.	94,46	99,40	102,68
Anteile der Klasse X1 (USD) - thes. (abgesichert)	101,54	104,29	106,74
Anteile der Klasse Z (EUR) - thes.	-	97,41	100,57
Anteile der Klasse Z (EUR) - aussch.	91,40	97,01	100,45
Global Equity Enhanced Income Fund			
Fondsvermögen (USD)	67.101.027	69.919.375	47.053.402
Gesamtes Fondsvermögen			
Anteile der Klasse A (SGD) - aussch. (abgesichert)	725.029	1.026.449	-
Anteile der Klasse A (USD) - aussch.	96.633	15.085	11.910
Anteile der Klasse I (USD) - aussch.	5.987.620	9.931.075	11.954
Anteile der Klasse X (GBP) - brutto aussch.	2.505.738	2.511.413	7.304
Anteile der Klasse X (USD) - brutto aussch.	56.734.607	55.524.340	47.018.536
Anteile der Klasse Z (GBP) - brutto aussch.	523.828	300.338	-
Nettoinventarwert je Anteil			
Anteile der Klasse A (SGD) - aussch. (abgesichert)	86,55	97,46	-
Anteile der Klasse A (USD) - aussch.	106,19	119,72	119,10
Anteile der Klasse I (USD) - aussch.	108,24	121,00	119,54
Anteile der Klasse X (GBP) - brutto aussch.	102,77	109,53	101,44
Anteile der Klasse X (USD) - brutto aussch.	107,25	121,73	119,83
Anteile der Klasse Z (GBP) - brutto aussch.	99,91	104,83	-

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

	31 . März 2023 in Währung	31 . März 2022 in Währung	31 . März 2021 in Währung
Global Factor Enhanced Equity Fund			
Fondsvermögen (USD)	36.671.259	46.071.875	42.821.626
Gesamtes Fondsvermögen			
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	12.790	13.544	12.516
Anteile der Klasse I (CHF) - thes. (abgesichert)	-	12.833	11.997
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	-	12.071	11.279
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	-	10.263	9.037
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	36.644.404	45.964.184	42.719.408
Anteile der Klasse Z (CHF) - thes. (abgesichert)	-	12.833	11.997
Anteile der Klasse Z (EUR) - thes. (abgesichert)	-	12.071	11.279
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	-	10.263	9.037
Anteile der Klasse Z (USD) - thes.	12.849	13.586	12.537
Nettoinventarwert je Anteil			
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	127,90	135,44	125,16
Anteile der Klasse I (CHF) - thes. (abgesichert)	-	130,95	122,42
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	-	131,21	122,60
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	-	133,28	117,37
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	132,14	139,73	128,93
Anteile der Klasse Z (CHF) - thes. (abgesichert)	-	130,95	122,42
Anteile der Klasse Z (EUR) - thes. (abgesichert)	-	131,21	122,60
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	-	133,28	117,37
Anteile der Klasse Z (USD) - thes.	128,49	135,86	125,37
Global Long/ Short Equity Fund			
Fondsvermögen (USD)	128.190.109	164.606.254	137.871.723
Gesamtes Fondsvermögen			
Anteile der Klasse AP (USD) - thes.	171.194	177.943	165.633
Anteile der Klasse IP (AUD) - aussch. (abgesichert)	22.092.868	17.909.002	-
Anteile der Klasse IP (CHF) - thes. (abgesichert)	-	11.544	10.811
Anteile der Klasse IP (EUR) - thes. (abgesichert)	6.741.032	5.744.557	5.241.267
Anteile der Klasse IP (EUR) - aussch.	1.136.893	1.153.617	1.004.344
Anteile der Klasse IP (GBP) - thes.	1.604.858	4.130.485	3.632.215
Anteile der Klasse IP (USD) - thes.	102.714.024	137.910.508	125.317.248
Anteile der Klasse ZP (CHF) - thes. (abgesichert)	-	11.544	10.811
Anteile der Klasse ZP (EUR) - thes. (abgesichert)	-	10.833	10.105
Anteile der Klasse ZP (GBP) - thes.	-	9.362	8.250
Anteile der Klasse ZP (USD) - thes.	11.924	12.297	11.373
Nettoinventarwert je Anteil			
Anteile der Klasse AP (USD) - thes.	106,53	110,73	103,07
Anteile der Klasse IP (AUD) - aussch. (abgesichert)	93,77	99,66	-
Anteile der Klasse IP (CHF) - thes. (abgesichert)	-	119,01	111,45
Anteile der Klasse IP (EUR) - thes. (abgesichert)	93,97	99,77	93,14
Anteile der Klasse IP (EUR) - aussch.	100,61	102,09	88,88
Anteile der Klasse IP (GBP) - thes.	93,36	90,44	79,53
Anteile der Klasse IP (USD) - thes.	116,45	120,14	110,87
Anteile der Klasse ZP (CHF) - thes. (abgesichert)	-	119,01	111,45
Anteile der Klasse ZP (EUR) - thes. (abgesichert)	-	119,04	111,04
Anteile der Klasse ZP (GBP) - thes.	-	120,02	105,77
Anteile der Klasse ZP (USD) - thes.	119,24	122,97	113,73
Global Small Cap Equity Fund			
Fondsvermögen (USD)	18.426.425	19.223.604	6.654.837
Gesamtes Fondsvermögen			
Anteile der Klasse I (CHF) - thes. (abgesichert)	-	11.066	12.121
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	272.335	284.626	290.160
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	10.272.669	9.954.779	9.222
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	5.459.048	5.819.870	6.289.038
Nettoinventarwert je Anteil			
Anteile der Klasse I (CHF) - thes. (abgesichert)	-	112,92	123,68
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	109,24	114,17	116,39
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	114,69	114,82	118,23
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	109,84	117,10	126,54

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

	31 . März 2023 in Wahrung	31 . Marz 2022 in Wahrung	31 . Marz 2021 in Wahrung
Small Cap Innovation Fund			
Fondsvermogen (USD)	8.242.480	7.918.077	8.156.348
Gesamtes Fondsvermogen			
Anteile der Klasse A (SGD) - thes. (abgesichert).....	9.037	11.283	-
Anteile der Klasse I (CHF) - thes. (abgesichert).....	-	11.244	13.835
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert).....	-	10.648	49.794
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.....	-	9.134	10.554
Anteile der Klasse I (USD) - thes.....	4.815.259	5.892.899	7.879.222
Anteile der Klasse X (GBP) - thes.....	2.557.555	1.438.750	6.768
Anteile der Klasse Z (EUR) - thes. (abgesichert).....	9.548	12.135	14.952
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.....	198.998	49.763	107.699
Anteile der Klasse Z (USD) - thes.....	9.774	11.942	14.482
Nettoinventarwert je Anteil			
Anteile der Klasse A (SGD) - thes. (abgesichert).....	66,45	82,96	-
Anteile der Klasse I (CHF) - thes. (abgesichert).....	-	114,73	141,17
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert).....	-	114,49	141,06
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.....	-	117,10	135,31
Anteile der Klasse I (USD) - thes.....	97,74	119,42	144,82
Anteile der Klasse X (GBP) - thes.....	71,54	81,71	94,00
Anteile der Klasse Z (EUR) - thes. (abgesichert).....	90,08	114,48	141,06
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.....	102,05	117,09	135,30
Anteile der Klasse Z (USD) - thes.....	97,74	119,42	144,82
U.S. All Cap Growth Fund			
Fondsvermogen (USD)	488.377.964	807.982.014	1.316.273.942
Gesamtes Fondsvermogen			
Anteile der Klasse A (EUR) - thes. (abgesichert).....	1.044.820	1.783.900	2.706.757
Anteile der Klasse A (GBP) - thes.....	736.499	1.076.813	1.097.025
Anteile der Klasse A (SGD) - thes. (abgesichert).....	581.828	697.112	524.261
Anteile der Klasse A (USD) - thes.....	38.344.639	60.969.576	122.586.417
Anteile der Klasse I (CHF) - thes. (abgesichert).....	-	399.546	29.462
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.....	4.334.687	45.777.663	79.083.698
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert).....	35.844	122.188	12.677.904
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.....	1.148.860	1.932.115	3.025.213
Anteile der Klasse I (USD) - thes.....	286.500.762	427.618.105	736.160.442
Anteile der Klasse Y (EUR) - thes.....	73.188.968	133.230.571	134.038.792
Anteile der Klasse Z (EUR) - thes. (abgesichert).....	1.223.071	988.629	24.227.016
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.....	11.450.043	18.314.365	20.609.597
Anteile der Klasse Z (GBP) - aussch.....	311.166	913.877	1.143.313
Anteile der Klasse Z (USD) - thes.....	25.305.904	44.169.984	52.952.900
Anteile der Klasse Z (USD) - aussch.....	34.377.292	43.833.727	72.105.897
Nettoinventarwert je Anteil			
Anteile der Klasse A (EUR) - thes. (abgesichert).....	124,71	156,14	168,94
Anteile der Klasse A (GBP) - thes.....	525,32	593,94	602,43
Anteile der Klasse A (SGD) - thes. (abgesichert).....	113,13	137,96	147,43
Anteile der Klasse A (USD) - thes.....	403,25	485,50	516,78
Anteile der Klasse I (CHF) - thes. (abgesichert).....	-	137,49	147,31
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.....	420,68	492,36	490,25
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert).....	108,29	134,42	144,00
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.....	590,37	661,91	665,76
Anteile der Klasse I (USD) - thes.....	456,17	544,64	574,89
Anteile der Klasse Y (EUR) - thes.....	90,75	105,97	105,30
Anteile der Klasse Z (EUR) - thes. (abgesichert).....	126,73	157,40	168,90
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.....	573,19	642,88	646,88
Anteile der Klasse Z (GBP) - aussch.....	573,05	642,67	646,67
Anteile der Klasse Z (USD) - thes.....	438,60	523,85	553,16
Anteile der Klasse Z (USD) - aussch.....	439,13	524,49	553,83

Die begleitenden Erluterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfugung.

	31. März 2023 in Währung	31. März 2022 in Währung	31. März 2021 in Währung
U.S. Large Cap Growth Fund			
Fondsvermögen (USD)	5.779.917	198.698.155	218.836.912
Gesamtes Fondsvermögen			
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	5.107.055	8.104.001	8.682.512
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	429.928	130.326.700	140.423.906
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	-	12.448	11.896
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	47.111	46.211.661	45.366.798
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	128.608	149.860	70.340
Nettoinventarwert je Anteil			
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	331,67	397,84	378,01
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	348,12	405,28	360,21
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	-	135,30	129,30
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	376,89	448,30	422,39
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	500,42	559,18	502,43
U.S. Select Equity Fund			
Fondsvermögen (USD)	5.635.601	191.373.825	206.472.842
Gesamtes Fondsvermögen			
Anteile der Klasse A (EUR) - thes.	152.801	167.219	78.599
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	121.740	453.977	192.496
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	-	14.564	13.872
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	11.586	12.218	10.914
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	5.127.355	153.458.495	171.282.369
Anteile der Klasse Z (EUR) - thes. (abgesichert)	-	14.230	13.553
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	-	12.207	10.909
Anteile der Klasse Z (USD) - aussch.¹	206.501	37.207.983	34.844.489
Nettoinventarwert je Anteil			
Anteile der Klasse A (EUR) - thes.	163,95	181,76	162,06
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	157,49	178,10	168,56
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	-	163,64	155,87
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	150,47	158,68	141,74
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	168,11	188,77	177,00
Anteile der Klasse Z (EUR) - thes. (abgesichert)	-	154,67	147,32
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	-	158,53	141,67
Anteile der Klasse Z (USD) - aussch.¹	169,82	190,96	178,83
U.S. Short-Term High Yield Bond Fund			
Fondsvermögen (USD)	30.051.282	55.389.820	81.373.121
Gesamtes Fondsvermögen			
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	1.922.851	343.808	396.550
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	13.509	13.857	-
Anteile der Klasse I (EUR) - aussch. (abgesichert)	5.723	5.876	6.005
Anteile der Klasse I (GBP) - aussch. (abgesichert)	21.417.361	21.399.144	23.692.637
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	1.390.734	3.291.189	22.572.779
Anteile der Klasse I (USD) - brutto aussch.	298.489	23.611.171	25.695.000
Anteile der Klasse X (GBP) - thes.	-	-	20.337
Anteile der Klasse Z (EUR) - aussch. (abgesichert)	-	9.164	9.391
Nettoinventarwert je Anteil			
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	126,52	126,96	126,33
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	97,19	99,69	-
Anteile der Klasse I (EUR) - aussch. (abgesichert)	38,41	41,09	42,59
Anteile der Klasse I (GBP) - aussch. (abgesichert)	61,31	64,57	66,44
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	137,37	137,15	135,79
Anteile der Klasse I (USD) - brutto aussch.	79,07	108,98	112,73
Anteile der Klasse X (GBP) - thes.	-	-	114,25
Anteile der Klasse Z (EUR) - aussch. (abgesichert)	-	99,61	103,20

¹ Der Name der Anteilsklasse wurde am 23. Januar 2022 von Klasse X (USD) – aussch. in Klasse Z (USD) – aussch. geändert.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

USD Investment Grade Credit Fund	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
	<i>in Währung</i>	<i>in Währung</i>	<i>in Währung</i>
Fondsvermögen (USD)	407.050.375	555.339.529	593.456.161
Gesamtes Fondsvermögen			
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	2.674.034	4.019.095	4.834.521
Anteile der Klasse A (USD) - aussch.	116.477	9.451	9.954
Anteile der Klasse I (CHF) - aussch. (abgesichert)	-	8.970	9.568
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	6.807.633	27.810	9.756
Anteile der Klasse I (EUR) - aussch. (abgesichert)	4.421.602	48.816.444	55.510.571
Anteile der Klasse I (GBP) - aussch. (abgesichert)	141.996	158.425	532.161
Anteile der Klasse I (JPY) - thes. (abgesichert)	1.752.847.868	1.773.638.060	1.378.924.321
Anteile der Klasse I (SGD) - thes. (abgesichert)	9.677	10.402	10.837
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	65.480.619	60.015.909	79.052.398
Anteile der Klasse I (USD) - aussch.	16.596.888	18.666.199	66.846.167
Anteile der Klasse X (EUR) - thes. (abgesichert)	-	8.001	8.415
Anteile der Klasse Y (EUR) - thes. (abgesichert)	259.360.914	346.559.398	288.969.851
Anteile der Klasse Y (EUR) - brutto aussch. (abgesichert)	192.248	218.439	235.724
Anteile der Klasse Y (GBP) - brutto aussch. (abgesichert)	-	6.324	101.159
Anteile der Klasse Y (USD) - brutto aussch.	14.899.497	20.025.136	25.070.368
Anteile der Klasse Z (EUR) - aussch. (abgesichert)	211.085	100.108	9.005
Anteile der Klasse Z (GBP) - aussch. (abgesichert)	-	7.203	7.579
Anteile der Klasse Z (USD) - aussch.	8.844	9.455	9.960
Nettoinventarwert je Anteil			
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	111,73	120,12	125,84
Anteile der Klasse A (USD) - aussch.	85,02	93,57	99,54
Anteile der Klasse I (CHF) - aussch. (abgesichert)	-	90,61	97,63
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	84,28	92,70	97,56
Anteile der Klasse I (EUR) - aussch. (abgesichert)	82,96	95,11	102,22
Anteile der Klasse I (GBP) - aussch. (abgesichert)	82,70	92,43	98,53
Anteile der Klasse I (JPY) - thes. (abgesichert)	9.886,06	10.992,08	11.535,93
Anteile der Klasse I (SGD) - thes. (abgesichert)	96,77	104,02	108,37
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	115,35	123,39	128,58
Anteile der Klasse I (USD) - aussch.	96,33	106,07	113,00
Anteile der Klasse X (EUR) - thes. (abgesichert)	-	93,03	97,85
Anteile der Klasse Y (EUR) - thes. (abgesichert)	84,31	92,55	97,28
Anteile der Klasse Y (EUR) - brutto aussch. (abgesichert)	76,41	86,82	93,69
Anteile der Klasse Y (GBP) - brutto aussch. (abgesichert)	-	75,28	82,31
Anteile der Klasse Y (USD) - brutto aussch.	94,92	104,92	112,12
Anteile der Klasse Z (EUR) - aussch. (abgesichert)	80,69	91,09	97,88
Anteile der Klasse Z (GBP) - aussch. (abgesichert)	-	92,34	98,43
Anteile der Klasse Z (USD) - aussch.	85,04	93,61	99,60

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Jahresabschlusses.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

1. ORGANISATION

Der Allspring (Lux) Worldwide Fund (der „Fonds“) wurde am 20. März 2008 mit unbefristeter Dauer als *société anonyme* nach dem Recht des Großherzogtums Luxemburg gegründet und erfüllt die Voraussetzungen einer offenen *Société d'Investissement à Capital Variable* gemäß Teil I des Gesetzes des Großherzogtums Luxemburg vom 17. Dezember 2010 betreffend Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, in dessen jeweils gültigen Fassung. Der Fonds ist im *Registre de Commerce et des Sociétés* von Luxemburg unter der Nummer B 137,479 eingetragen.

Der Fonds hat eine „Umbrella-Struktur“, die es ihm ermöglicht, sein Kapital auf mehrere Portfolios aus Wertpapieren und anderen gesetzlich zugelassenen Vermögenswerten mit bestimmten Anlagezielen und diversen Risiko- oder anderen Merkmalen aufzuteilen (jeweils ein „Teilfonds“, zusammen die „Teilfonds“).

Der Global Equity Fund und der USD Government Money Market Fund wurden während des Geschäftsjahres zum 31. März 2022 aufgelöst. Zum 31. März 2023 hielten diese Teilfonds 76.026 USD bzw. 57.848 USD.

Der Global Equity Absolute Return Fund, der Global Multi-Asset Income Fund und der Global Low Volatility wurden während des Geschäftsjahres zum 31. März 2021 aufgelöst. Zum 31. März 2023 hielten diese Teilfonds 5.515 USD, 9.729 USD bzw. 57.332 USD.

2. WESENTLICHE BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSGRUNDSÄTZE

Der beiliegende Abschluss wurde gemäß den luxemburgischen rechtlichen und aufsichtsrechtlichen Anforderungen für Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren und den allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen erstellt. Der Halbjahresabschluss wird in USD, der Basiswährung jedes Teilfonds, erstellt. Die Basiswährung jedes Teilfonds, mit Ausnahme des EUR Investment Grade Credit Fund und des EUR Short Duration Credit Fund, ist USD. Die Basiswährung des EUR Investment Grade Credit Fund und des EUR Short Duration Credit Fund ist EUR. Der Nettoinventarwert („NIW“) je Anteil zum 31. März 2023 wurde auf Grundlage der zuletzt verfügbaren Marktpreise der Anlagen, in denen die jeweiligen Teilfonds zum 31. März 2023 investiert waren, berechnet.

Die Abschlüsse aller Teilfonds mit Ausnahme des China A Focus Fund, des Climate Focused Emerging Market Equity Fund, des Climate Focused Global Equity Fund und des Climate Focused U.S. Equity Fund wurden auf der Grundlage der Fortsetzung des Geschäftsbetriebs erstellt. Der Abschluss für den China A Focus Fund wird auf Grundlage der Genehmigung des Verwaltungsrats des Fonds (der „Verwaltungsrat“) vom 23. November 2022 zur Liquidation des Teilfonds auf Liquidationsbasis erstellt. Die Abschlüsse für den Climate Focused Emerging Market Equity Fund, den Climate Focused Global Equity Fund und den Climate Focused U.S. Aktienfonds werden aufgrund der entsprechenden Genehmigung des Verwaltungsrats vom 23. März 2023 auf Liquidationsbasis erstellt. Einzelheiten hierzu sind Anmerkung 15 zu entnehmen.

Bilanzierung von Anlagen

Anlagen werden generell an jedem Geschäftstag zum regulären Handelsschluss der New York Stock Exchange („NYSE“) (generell 16:00 Uhr Ortszeit in New York) bewertet.

Börsennotierte Aktien und Futures-Kontrakte werden zum offiziellen Schlusskurs oder, sofern nicht vorhanden, zum letzten verfügbaren Verkaufskurs bewertet.

Nicht börsennotierte Wertpapiere, für die außerbörsliche Kursnotierungen ohne Weiteres verfügbar sind (darunter börsennotierte Wertpapiere, als deren Primärmarkt der Freiverkehrsmarkt gilt), werden zu einem Kurs bewertet, der dem zuletzt verfügbaren Kurs einer anerkannten Plattform zur Kursstellung oder eines anerkannten Händlers entspricht.

Optionen, die an einer ausländischen oder inländischen Börse oder einem Markt notiert sind, werden zum Schlussmittelkurs bewertet. Nicht börsennotierte Optionen und Swap-Kontrakte werden zum geschätzten Kurs, der von einem unabhängigen Kursstellungsdienst bereitgestellt wird, oder, sofern kein zuverlässiger Kurs zur Verfügung steht, zu dem von einem unabhängigen Händler bereitgestellten Geldkurs bewertet.

Devisenterminkontrakte werden zu dem Terminkurs verbucht, der an jedem Geschäftstag von einer unabhängigen Plattform zur Kursstellung für Fremdwährungen bereitgestellt wird.

Viele Wertpapiermärkte und -börsen außerhalb der USA schließen vor Handelsschluss der NYSE und spiegeln daher unter Umständen Transaktionen oder Ereignisse, die sich nach Handelsschluss der Hauptbörse, an der Nicht-US-Wertpapiere gehandelt werden, aber vor Handelsschluss der NYSE ereignen, nicht vollständig wider. Wenn davon auszugehen ist, dass sich derlei Transaktionen oder Ereignisse auf den Wert von Wertpapieren wesentlich auswirken werden, dann finden die vom Verwaltungsrat genehmigten Verfahrensweisen bezüglich der Bewertung zum beizulegenden Zeitwert Anwendung. Bei diesen Verfahrensweisen werden verschiedene Faktoren berücksichtigt, u. a. Kursbewegungen an den US-Wertpapiermärkten nach Handelsschluss der Nicht-US-Wertpapierbörsen. Je nach Marktaktivität können derlei Bewertungen zum beizulegenden Zeitwert häufig stattfinden. Dies kann zu Nettoinventarwerten (NIW) führen, die höher oder niedriger sind als die auf dem zuletzt verfügbaren Verkaufskurs oder Geldkurs basierten NIW.

Schuldtitel werden zum geschätzten Geldkurs, der von einem unabhängigen Kursstellungsdienst bereitgestellt wird (z. B. unter Berücksichtigung verschiedener Faktoren wie Renditen, Fälligkeiten oder Kreditratings), oder, sofern kein zuverlässiger Kurs zur Verfügung steht, zu dem von einem unabhängigen Händler bereitgestellten Geldkurs bewertet.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Kurzfristige Wertpapiere mit einer Restlaufzeit von maximal 60 Tagen werden generell zu den fortgeführten Anschaffungskosten bewertet, was in etwa dem beizulegenden Zeitwert entspricht. Die Methode der fortgeführten Anschaffungskosten bedeutet, dass ein Wertpapier zu den Anschaffungskosten unter Berücksichtigung der Abschreibung des Agios und Zuschreibung des Disagios während des Zeitraums bis zur Fälligkeit bewertet wird.

Wertpapiere, die nicht auf die Basiswährung des jeweiligen Teilfonds lauten, werden zu Kursen, die von einer unabhängigen Plattform zur Kursstellung für Währungen festgestellt werden, in die entsprechende Währung umgerechnet.

Anlagen, die mit keiner der vorstehend dargelegten Methoden bewertet werden, werden gemäß den Grundsätzen und Verfahrensweisen des Fonds zur Kursstellung und Bewertung von Anlagen, die vom Verwaltungsrat in gutem Glauben festgelegt und von ihm genehmigt wurden, zum beizulegenden Zeitwert bewertet.

Kassenbestände, Wechsel und Zahlungsaufforderungen, Forderungen, transitorische Aktiva, Bardividenden, Bankzinsen, Dividenden sowie Anleihen werden zu ihrem Nennwert bewertet.

Futures-Kontrakte

Bestimmte Teilfonds dürfen in Futures-Kontrakte investieren und können im Rahmen der gewöhnlichen Verfolgung ihrer Anlageziele dem Zinsrisiko, Aktienpreisrisiko oder Fremdwährungsrisiko ausgesetzt sein. Ein Teilfonds kann Futures-Kontrakte kaufen und verkaufen, um Engagements in oder Schutz vor Änderungen der Zinssätze, des Werts von Wertpapieren und der Wechselkurse zu erlangen. Das Hauptrisiko in Zusammenhang mit dem Einsatz von Futures-Kontrakten besteht in der imperfekten Korrelation zwischen Änderungen am Marktwert von durch den Teilfonds gehaltenen Wertpapieren und dem Preis des Kontrakts sowie der Möglichkeit illiquider Märkte. Die gesamten Kapitalbeträge der Futures-Kontrakte werden im Abschluss nicht aufgezeichnet. Wertschwankungen in den Kontrakten werden in der Vermögensbilanz als nicht realisierter Vermögenswert oder nicht realisierte Verbindlichkeit und in der Aufwands- und Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens als Nettoveränderung der nicht realisierten Wertsteigerung oder Wertminderung bis zur Auflösung des Futures-Kontrakts ausgewiesen. Bei Auflösung werden sie als realisierte Nettogewinne oder -verluste auf Futures-Kontrakte verbucht. Nachschusszahlungen auf Terminkontrakte werden in der Vermögensbilanz als Forderung bzw. Verbindlichkeit für Nachschusszahlungen auf Terminkontrakte ausgewiesen. In Zusammenhang mit Futures-Kontrakten besteht lediglich ein minimales Kontrahentenrisiko für den Teilfonds, da sie börsengehandelt sind und die Clearingstelle der Börse als Kontrahent aller börsengehandelter Futures den Kontrakt vor einem Ausfall sichert.

Devisenterminkontrakte

Bestimmte Teilfonds können in Devisenterminkontrakte investieren und im normalen Verlauf der Verfolgung ihres Anlageziels dem Wechselkursrisiko ausgesetzt sein. Ein Devisenterminkontrakt ist ein Vertrag zwischen zwei Parteien über den Kauf oder Verkauf einer bestimmten Währung zu einem bestimmten, vorab festgelegten Kurs und Datum. Der Teilfonds geht Devisenterminkontrakte zur Erleichterung von Transaktionen in Wertpapieren, die nicht auf US-Dollar oder Euro lauten, und zur Minderung des Risikos für den Teilfonds, das sich aus beeinträchtigenden Kursschwankungen zwischen Währungen ergibt, ein. Devisenterminkontrakte werden auf Tagesbasis zum Terminkurs verbucht und zum Marktwert bewertet. Bei Auflösung der Kontrakte werden die aus diesen Transaktionen erzielten Gewinne und Verluste als realisierte Nettogewinne oder -verluste aus Devisenterminkontrakten verbucht. Der Teilfonds könnte Risiken ausgesetzt sein, wenn einer der Kontrahenten nicht dazu in der Lage ist, die Bedingungen seiner Kontrakte zu erfüllen oder wenn der Wert der ausländischen Währung eine nachteilige Änderung erfährt. Das maximale Verlustrisiko des Teilfonds aufgrund des Kontrahentenausfallrisikos sind die nicht realisierten Gewinne auf die Devisenterminkontrakte. Dieses Risiko kann durch einen Globalverrechnungsvertrag (Master Netting Arrangement) zwischen dem Teilfonds und dem Kontrahenten gemindert werden. Die nicht realisierte Wertsteigerung und nicht realisierte Wertminderung der Devisenterminkontrakte werden in der Vermögensbilanz als Vermögenswert bzw. Verbindlichkeit und in der Aufwands- und Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens als nicht realisierte Nettowertsteigerung/Nettowertminderung bis zur Auflösung des Futures-Kontrakts ausgewiesen. Bei Auflösung werden sie als realisierte Nettogewinne oder -verluste auf Devisenterminkontrakte verbucht.

Differenzkontrakte

Bestimmte Teilfonds können zur Erlangung eines Engagements in einem Basiswert Differenzkontrakte kaufen oder verkaufen und im normalen Verlauf der Verfolgung ihres Anlageziels einem Aktienrisiko ausgesetzt sein. Ein Differenzkontrakt ist eine Vereinbarung, bei der eine Partei der anderen Partei einen Betrag zahlt, der sich aus der Differenz zwischen dem Eröffnungskurs und dem Schlusskurs des Basiswertes ergibt. Der Käufer des Differenzkontrakts zahlt dem Verkäufer die positive Differenz, der Verkäufer des Differenzkontrakts zahlt dem Käufer die negative Differenz. Der Wert des Differenzkontrakts wird täglich auf Basis von Kursnotierungen eines unabhängigen Kurstdienstes oder eines unabhängigen Broker-Dealers zum Marktkurs bewertet. Jede Wertänderung wird bis zum Vertragsabschluss als unrealisierte Wertsteigerung oder Wertminderung erfasst und dann als realisierter Nettogewinn oder -verlust verbucht. Während der Laufzeit des Differenzkontrakts für einen Basiswert aufgelaufene Zinsen oder verbuchte Dividenden werden als Ertrag aus einem Kaufvertrag und als Aufwand für einen Verkaufsvertrag erfasst. Der Teilfonds kann Risiken ausgesetzt sein, wenn der Kontrahent seine Leistungsverpflichtung nicht erfüllt oder wenn es im Zuge der Kursschwankungen des Basiswertes zu nachteiligen Änderungen kommt.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Optionen

Bestimmte Teilfonds können gedeckte Call-Optionen oder besicherte Put-Optionen auf einzelne Wertpapiere und/oder Indizes schreiben und dadurch im Rahmen der regulären Verfolgung ihrer Anlageziele einem Aktienkursrisiko unterliegen. Wenn ein Teilfonds eine Option schreibt, wird ein Betrag in Höhe der erhaltenen Prämie als Verbindlichkeit ausgewiesen und anschließend an den laufenden Marktwert der Verkaufsoption angepasst. Erhaltene Prämien für nicht ausgeübte verfallende Verkaufsoptionen werden am Fälligkeitstermin als realisierte Nettogewinne ausgewiesen. Bei ausgeübten Optionen wird die Differenz zwischen der erhaltenen Prämie und des beim Abschluss eines Deckungskaufs gezahlten Betrags, einschließlich Maklerprovisionen, als realisierter Nettoverlust behandelt. Wird eine Call-Option ausgeübt, wird die Prämie bei der Berechnung des realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Verkauf den Erlösen aus dem Verkauf des zugrunde liegenden Wertpapiers zugeschlagen. Wenn eine Put-Option ausgeübt wird, verringert die Prämie die Kosten des gekauften Wertpapiers. Als Schreiber einer Option trägt der Teilfonds das Marktrisiko, dass sich der Kurs des Wertpapiers und/oder des Index, das bzw. der der Verkaufsoption zugrunde liegt, ungünstig verändert.

Ein Teilfonds kann auch Käufe von Call- oder Put-Optionen tätigen. Die bezahlten Prämien werden in der Vermögensbilanz als Anlagen ausgewiesen und anschließend an den laufenden Marktwert der Optionen angepasst. Für verfallende gekaufte Optionen bezahlte Prämien werden am Fälligkeitstermin realisierte Verluste verbucht. Wird eine gekaufte Option ausgeübt oder geschlossen, so wird die gezahlte Prämie dem gezahlten Betrag hinzugerechnet oder mit den für den Basiswert erhaltenen Erlösen verrechnet, um den realisierten Nettogewinn oder -verlust zu bestimmen. Das mit gekauften Optionen verbundene Verlustrisiko ist auf die gezahlte Prämie beschränkt.

An Börsen gehandelte Optionen unterliegen der Regulierung und die Bedingungen der Optionen sind standardisiert. Bei gekauften Optionen, die im Freiverkehr gehandelt werden, ist der Teilfonds einem Kontrahentenrisiko ausgesetzt, wenn der Kontrahent seine Verpflichtungen nicht erfüllt. Dieses Risiko kann durch eine Master-Saldierungsvereinbarung zwischen dem Teilfonds und dem Kontrahenten sowie durch Verlangen von Sicherheiten vom Kontrahenten zur Deckung des Engagements des Teilfonds im Kontrahenten abgemildert werden.

Total Return Swaps

Bestimmte Teilfonds können Total-Return-Swap-Kontrakte zur Absicherung oder zu spekulativen Zwecken abschließen. Total Return Swaps sind Vereinbarungen zwischen den Teilfonds und einem Kontrahenten über den Austausch periodischer Zahlungen, deren Höhe auf Referenzwerten basiert, bei denen es sich um Vermögenswerte oder andere Bezugsgrößen handeln kann. Ein Zahlungsstrom basiert in der Regel auf einer Nicht-Vermögensreferenz (z. B. einem Zinssatz), der andere Zahlungsstrom auf der Gesamtrendite eines Referenzvermögenswerts (z. B. eines Wertpapiers, eines Wertpapierkorbs oder eines Wertpapierindex). Abhängig davon, ob die Gesamtrendite des dem Geschäft zugrunde liegenden Wertpapiers oder Index die gegenüberstehende Verpflichtung zur Zahlung von Zinsen übersteigt oder unterschreitet, erhält die Gesellschaft eine Zahlung vom Kontrahenten oder leistet eine Zahlung an ihn.

Der Teilfonds ist dem Risiko ausgesetzt, dass der Kontrahent seine Leistungsverpflichtung nicht erfüllt oder es zu nachteiligen Zinsentwicklungen oder Kursentwicklungen der zugrundeliegenden Wertpapiere oder Indizes kommt. Neben dem Kontrahentenrisiko unterliegen die Teilfonds einem Liquiditätsrisiko, wenn kein Markt für die Kontrakte besteht, sowie dem Marktrisikofaktor des jeweiligen zugrunde liegenden Finanzinstruments oder Index.

Wertpapiertransaktionen und Erfassung von Erträgen

Wertpapiertransaktionen werden am Handelstag erfasst. Der realisierte Nettogewinn oder -verlust basiert auf dem durchschnittlichen Anschaffungswert der Wertpapiere.

Dividendenerträge werden Ex-Dividende verbucht. Zinserträge werden täglich berechnet und Anleihenabschläge und Prämien werden täglich amortisiert. Erträge werden nach Abzug von Quellensteuern verbucht, wenn die Rückerstattung dieser Steuern nicht gewährleistet ist.

Devisen

Transaktionen in anderen Währungen als der Basiswährung des jeweiligen Teilfonds werden zum am Tag der Transaktion geltenden Wechselkurs in die Basiswährung des jeweiligen Teilfonds umgerechnet. Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf andere Währungen als die Basiswährung des jeweiligen Teilfonds lauten, werden zu den Wechselkursen am Ende des Berichtszeitraums in die Basiswährung des jeweiligen Teilfonds umgerechnet. Die konsolidierten Zahlen des Fonds werden in US-Dollar ausgewiesen und enthalten die Gesamtsumme des Abschlusses jedes Teilfonds. Bei der Ermittlung der Ergebnisse für den Abrechnungszeitraum in der Aufwands- und Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens wird eine Währungsberichtigung berücksichtigt. Bei allen Teilfonds mit Ausnahme des Global Factor Enhanced Equity Fund werden die Transaktionen zu den Schlusswechselkursen der NYSE umgerechnet. Beim Global Factor Enhanced Equity Fund werden die Transaktionen zu den Schlusswechselkursen der London Stock Exchange („LSE“) umgerechnet.

Die im Abschluss verwendete Referenzwährung des Fonds ist der US-Dollar. Zum 31. März 2023 galt für alle Teilfonds mit Ausnahme des EUR Investment Grade Credit Fund, des EUR Short Duration Credit Fund und des Global Factor Enhanced Equity Fund der folgende USD-Wechselkurs:

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Währung		USD Devisenkurs zum Schluss der NYSE	Währung		USD Devisenkurs zum Schluss der NYSE
AED	VAE-Dirham	3,6725	JPY	Japanischer Yen	132,7750
AUD	Australischer Dollar	1,4960	KRW	Südkoreanischer Won	1.301,8500
BRL	Brasilianischer Real	5,0685	MXN	Mexikanischer Peso	18,0200
CAD	Kanadischer Dollar	1,3515	MYR	Malaysischer Ringgit	4,4125
CHF	Schweizer Franken	0,9150	NOK	Norwegische Krone	10,4698
CLP	Chilenischer Peso	794,8900	NZD	Neuseeländischer Dollar	1,5992
CNH	Chinesischer Yuan Renminbi (Offshore)	6,8731	PHP	Philippinischer Peso	54,3650
CNY	Chinesischer Yuan	6,8719	PLN	Polnischer Zloty	4,3165
CZK	Tschechische Krone	21,6574	QAR	Katar-Rial	3,6400
DKK	Dänische Krone	6,8694	RUB	Russischer Rubel	77,6500
EUR	Euro	0,9221	SAR	Saudi-Riyal	3,7537
GBP	Britisches Pfund	0,8106	SEK	Schwedische Krone	10,3790
HKD	Hongkong-Dollar	7,8499	SGD	Singapur-Dollar	1,3308
HUF	Ungarischer Forint	350,3459	THB	Thailändischer Baht	34,1950
IDR	Indonesische Rupiah	14.994,5000	TRY	Türkische Lira	19,1795
ILS	Israelischer Schekel	3,5961	TWD	Taiwan-Dollar	30,4475
INR	Indische Rupie	82,1825	ZAR	Südafrikanischer Rand	17,8050

Zum 31. März 2023 galten für den EUR Investment Grade Credit Fund und den EUR Short Duration Credit Fund folgende Euro-Wechselkurse:

Währung		EUR Devisenkurs zum Schluss der NYSE
CHF	Schweizer Franken	0,9925
GBP	Britisches Pfund	0,8787
USD	US-Dollar	1,0865

Zum 31. März 2023 galten für den Global Factor Enhanced Equity Fund folgende USD-Wechselkurse:

Währung		USD Devisenkurs zum Schluss der LSE	Währung		USD Devisenkurs zum Schluss der LSE
AUD	Australischer Dollar	1,4931	ILS	Israelischer Schekel	3,6007
CAD	Kanadischer Dollar	1,3534	JPY	Japanischer Yen	133,0900
CHF	Schweizer Franken	0,9136	NOK	Norwegische Krone	10,4731
DKK	Dänische Krone	6,8566	NZD	Neuseeländischer Dollar	1,5983
EUR	Euro	0,9204	SEK	Schwedische Krone	10,3696
GBP	Britisches Pfund	0,8088	SGD	Singapur-Dollar	1,3296
HKD	Hongkong-Dollar	7,8500			

Gründungskosten

Die anfänglichen Kosten und Aufwendungen für die Gründung des Fonds wurden vom Fonds getragen und abgeschrieben. Die Gründungskosten aller neuen Teilfonds werden von dem jeweiligen Teilfonds getragen und über einen Zeitraum von höchstens fünf Jahren abgeschrieben.

3. MANAGEMENTGEBÜHREN UND GESCHÄFTE MIT VERBUNDENEN PERSONEN

Vergütung der Verwaltungsgesellschaft

Allspring Global Investments Luxembourg S.A. (die „Verwaltungsgesellschaft“ und „Hauptvertriebsstelle“), eine direkte, hundertprozentige Tochtergesellschaft von Allspring Global Investments Holdings, LLC, einer Holdinggesellschaft im indirekten Besitz bestimmter Privatfonds von GTCR LLC und Reverence Capital Partners, L.P., wurde zur Verwaltungsgesellschaft des Fonds ernannt. Der Fonds zahlt der Verwaltungsgesellschaft eine monatliche Gebühr, die 0,04 % p. a. des Nettovermögens des Fonds nicht überschreitet. Die Gebühr unterliegt einer monatlichen Mindestgebühr von 1.700 EUR je Teilfonds.

Eine Liste der von der Verwaltungsgesellschaft verwalteten Fonds kann auf einfache Anfrage am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft angefordert werden.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Anlageverwaltungsgebühren

Die Verwaltungsgesellschaft erhält ferner monatlich eine nachträglich zahlbare Gebühr für das Anlagemanagement von jedem Teilfonds, die folgende Prozentsätze per annum des Nettovermögens einer jeden Anteilsklassen nicht übersteigt:

	Klasse A	Klasse AP	Klasse I	Klasse IP	Klasse Z	Klasse ZP
2 Degree Global Equity Fund	1,05 %	-	0,55 %	-	0,55 %	-
Alternative Risk Premia Fund	-	-	0,60	-	-	-
China A Focus Fund	1,50	-	0,85	-	0,85	-
Climate Focused Emerging Markets Equity Fund	-	-	0,35	-	-	-
Climate Focused Global Equity Fund	-	-	0,30	-	-	-
Climate Focused U.S. Equity Fund	-	-	0,25	-	-	-
Climate Transition Global Investment Grade Credit Fund	0,80	-	0,30	-	0,30	-
Emerging Markets Equity Fund	1,70	-	0,95	-	0,95	-
Emerging Markets Equity Income Fund	1,70	-	0,95	-	0,95	-
EUR Investment Grade Credit Fund	0,80	-	0,30	-	-	-
EUR Short Duration Credit Fund	0,70	-	0,20	-	0,20	-
Global Equity Enhanced Income Fund	1,20	-	0,60	-	0,60	-
Global Factor Enhanced Equity Fund	0,25	-	0,15	-	0,15	-
Global Long/ Short Equity Fund	-	1,50 %	-	0,75 %	-	0,75 %
Global Small Cap Equity Fund	-	-	0,85	-	-	-
Small Cap Innovation Fund	1,55	-	0,85	-	0,85	-
U.S. All Cap Growth Fund	1,60	-	0,80	-	0,80	-
U.S. Large Cap Growth Fund	1,50	-	0,70	-	0,70	-
U.S. Select Equity Fund	1,55	-	0,85	-	0,85	-
U.S. Short-Term High Yield Bond Fund	1,00	-	0,50	-	-	-
USD Investment Grade Credit Fund	0,80	-	0,30	-	0,30	-

Anteile der Klasse X können von privaten Anlegern und Anteile der Klasse Y können von institutionellen Anlegern erworben werden, vorausgesetzt, dass sie oder ihre Finanzvermittler eine Vereinbarung mit der Hauptvertriebsstelle, der Verwaltungsgesellschaft oder dem Anlageverwalter abgeschlossen haben, die ihnen ausdrücklich Zugang zu den Anteilen der Klasse X bzw. den Anteilen der Klasse Y gewährt. Weitere Anteile der Klasse X und der Klasse Y können in einem oder verschiedenen Teilfonds begeben werden, die mit 1, 2, 3 usw. nummeriert werden und die Bezeichnungen X1, X2, X3 usw. bzw. Y1, Y2, Y3 usw. für die erste, zweite und dritte aufgelegte Anteilsklasse X bzw. Y tragen. Die Anlageverwaltungsgebühren für diese Klassen tragen einer alternativen Gebührenstruktur Rechnung, und die Gebühren werden in einer gesonderten Vereinbarung festgelegt und können Performancegebühren enthalten.

Allspring Funds Management, LLC (der „Anlageverwalter“) verwaltet die Anlage und Wiederanlage der Vermögenswerte jedes Teilfonds gemäß den Anlagezielen und -beschränkungen jedes Teilfonds unter der Gesamtverantwortung des Verwaltungsrats. Hierfür erhält er von der Verwaltungsgesellschaft eine Vergütung.

Der Anlageverwalter hat einige seiner Funktionen an Allspring Global Investments, LLC und Allspring Global Investments (UK) Limited als Unteranlageverwalter der Teilfonds übertragen (jeweils ein „Unteranlageverwalter“, zusammen die „Unteranlageverwalter“). Die Unteranlageverwalter unterstützen den Anlageberater bei der täglichen Vermögensverwaltung der betreffenden Teilfonds. Die Gebühren der Unteranlageverwalter sind vom Anlageverwalter zu tragen.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Performancegebühren

Die Anteilsklasse AP, die Anteilsklasse IP und die Anteilsklasse ZP des Global Long/Short Equity Fund können jeweils eine Performancegebühr an die Verwaltungsgesellschaft zahlen. Die Verwaltungsgesellschaft kann die Performancegebühren ganz oder teilweise an den Anlageverwalter weitergeben. Der Anlageverwalter kann seinerseits die von der Verwaltungsgesellschaft erhaltenen Performancegebühren ganz oder teilweise an den Untieranlageverwalter weitergeben. Die Performancegebühren werden für alle Anteilsklassen in US-Dollar, der Basiswährung des Teilfonds, berechnet, auch für die Anteilsklassen, die nicht auf US-Dollar lauten. Bei dieser Methode zur Berechnung der Performancegebühr kann für nicht abgesicherte, nicht auf die Basiswährung lautende Klassen eine Performancegebühr anfallen, wenn der Nettoinventarwert dieser Anteilsklasse niedriger ist als der Nettoinventarwert einer vergleichbaren Anteilsklasse, die in der Basiswährung eines Teilfonds berechnet wird, und während des Zeitraums der Performancegebühr im Verhältnis zu dieser an Wert verloren hat. Umgekehrt kann für eine nicht abgesicherte, nicht auf die Basiswährung lautende Anteilsklasse keine Performancegebühr anfallen, wenn der NIW dieser Anteilsklasse während des Zeitraums der Performancegebühr im Vergleich zum NIW einer auf die Basiswährung lautenden Anteilsklasse gestiegen ist. Die Performancegebühren entsprechen 20 % des Anstiegs des NIW je Anteil (vor dem Abzug der Performancegebühren), in USD berechnet, zum Ende eines jeden Geschäftsjahres, sofern der NIW je Anteil nach Abzug der Hurdle Rate über der High Watermark liegt. Die High Watermark ist der höchste NIW je Anteil zum Ende eines Geschäftsjahres, der seit Auflegung des Teilfonds für die betreffende Klasse erreicht wurde, wenn die Performancegebühr gezahlt wird. Die erste High Watermark ist der erste NIW je Anteil für die betreffende Klasse. Die angewandte Hurdle Rate für den Global Long/Short Equity Fund beträgt 50 % MSCI World Index / 50 % 3-Monats-Libor. Beide Indizes werden in USD angegeben. Die Performancegebühr ist auf 10 % des NIW je Anteil zum Ende des Geschäftsjahres und Zeitpunkt der Zahlung der Performancegebühr beschränkt.

Die Performancegebühren werden täglich berechnet und fallen täglich an. Sie werden jährlich rückwirkend zum Ende des Geschäftsjahres ausgezahlt. Erfolgt eine Rücknahme an einem anderen Datum als dem Ende des Geschäftsjahres, werden die Performancegebühren (sofern bis zum Tag der Rückgabe aufgelaufen) für die zurückgegebenen Anteile entsprechend angepasst und vierteljährlich an die Verwaltungsgesellschaft ausgezahlt. Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2023 hat der Global Long/Short Equity Fund keine Performancegebühren gezahlt.

Transaktionen mit verbundenen Personen

Die Verwaltungsgesellschaft fungiert auch als Hauptvertriebsstelle des Fonds. Die Hauptvertriebsstelle hat mit Allspring Funds Distributor, LLC und Allspring Global Investments (UK) Limited (jeweils eine „verbundene Untervertriebsstelle“, zusammen die „verbundenen Untervertriebsstellen“) Untervertriebsvereinbarungen oder Marketing-Supportvereinbarungen geschlossen, gemäß derer jede verbundene Untervertriebsstelle als nicht-ausschließliche Untervertriebsstelle oder Marketingvertreter zur Verkaufsförderung, Vermarktung und zum Verkauf der Anteile eines oder mehrerer Teilfonds ernannt wurde:

Die verbundenen Untervertriebsstellen haben in Bezug auf die von ihnen zur Verkaufsförderung, Vermarktung und zum Verkauf der Anteile erbrachten Dienstleistungen ein Anrecht auf eine Vergütung von der Hauptvertriebsstelle.

Die Verwaltungsratsmitglieder, die auch leitende Angestellte und/oder Geschäftsführer des Anlageverwalters und/oder seiner verbundenen Unternehmen sind, erhalten keine separate Vergütung vom Fonds. Richard Goddard, Jürgen Meisch und Yves Wagner, die Verwaltungsratsmitglieder ohne Verbindung mit dem Anlageverwalter und/oder dessen verbundenen Unternehmen sind, erhalten jeweils eine feste Vergütung ohne variables Element. Die abgegrenzte Gesamtvergütung der Verwaltungsratsmitglieder bezüglich des Fonds belief sich für das Geschäftsjahr zum 31. März 2023 auf 229.433 USD.

Keine der Transaktionen des Fonds wurde durch einen Broker ausgeführt, bei dem es sich um eine mit dem Fonds, der Verwaltungsgesellschaft/Hauptvertriebsstelle, dem Anlageverwalter, den Unteranlageverwaltern oder den Verwaltungsratsmitgliedern des Fonds verbundene Partei handelt. Sämtliche Transaktionen mit verbundenen Parteien wurden im Zuge der ordentlichen Geschäftstätigkeit und unter handelsüblichen Bedingungen eingegangen.

4. DEPOTBANK- UND VERWALTUNGSgebÜHREN

Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. wurde als Depotbank und Verwaltungsstelle des Fonds bestellt. Die Depotbankgebühren sind in den Depotbank- und Verwaltungsgebühren enthalten. Die Depotbankgebühr wird auf Grundlage einer vorab vereinbarten Gebührenstruktur ermittelt. Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. hat gemäß Verwahrstellenvertrag Anspruch auf eine jährliche Verwahr- und Dienstleistungsgebühr, deren Sätze nach dem jeweiligen Anlageland unterschiedlich hoch ausfallen. Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. hat für seine Dienstleistungen gemäß Verwaltungsvertrag Anspruch auf eine Gebühr, die gemäß der vereinbarten Gebührenstruktur erhoben wird, und hat ferner Anspruch auf Rückerstattung von Spesen und Auslagen. Die Depotbank- und Verwaltungsgebühren fallen an jedem Bewertungstag auf Grundlage des NIW des vorherigen Tages sowie der Anzahl der pro Monat verarbeiteten Transaktionen an und werden am Ende eines jeden Monats gezahlt.

5. GEBÜHREN FÜR ZAHLSTELLE, REGISTERSTELLE UND TRANSFERSTELLE

Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. fungiert außerdem als Register-, Transfer- und Zahlstelle des Fonds. Im Rahmen dieser Dienstleistungen ist Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C. für die Führung des Anteilinhaberregisters und für die Verteilung von Dokumenten (Abschlüsse, Berichte und Mitteilungen) an die Anteilinhaber zuständig und wird vom Fonds bezahlt. Die Register-, Transfer- und Zahlstellengebühren sind monatlich rückwirkend gemäß den entsprechenden Vereinbarungen zu zahlen.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

6. GEBÜHRENVERZICHT UND AUFWANDSRÜCKERSTATTUNG

Ein etwaiger Gebührenverzicht und/oder eine Aufwandsrückerstattung beziehen sich auf Beträge, die für den Berichtszeitraum über den maximalen Gesamtkostenquoten (TER) eines jeden Teilfonds liegen. Derlei Beträge werden den jeweiligen Teilfonds vom Anlageverwalter zurückerstattet, wenn die tatsächliche TER einer jeden Anteilsklasse die im Folgenden aufgeführten Sätze überschreitet:

	Klasse A	Klasse AP	Klasse I	Klasse IP	Klasse Z	Klasse ZP
2 Degree Global Equity Fund	1,20 %	-	0,65 %	-	0,65 %	-
Alternative Risk Premia Fund	-	-	0,70	-	-	-
China A Focus Fund	1,80	-	1,15	-	1,15	-
Climate Focused Emerging Markets Equity Fund	-	-	0,45	-	-	-
Climate Focused Global Equity Fund	-	-	0,40	-	-	-
Climate Focused U.S. Equity Fund	-	-	0,35	-	-	-
Climate Transition Global Investment Grade Credit Fund	0,95	-	0,45	-	0,45	-
Emerging Markets Equity Fund	1,94	-	1,15	-	1,19	-
Emerging Markets Equity Income Fund	2,00	-	1,25	-	1,25	-
EUR Investment Grade Credit Fund	0,95	-	0,45	-	-	-
EUR Short Duration Credit Fund	0,85	-	0,35	-	0,35	-
Global Equity Enhanced Income Fund	1,40	-	0,70	-	0,70	-
Global Factor Enhanced Equity Fund	0,40	-	0,25	-	0,25	-
Global Long/ Short Equity Fund	-	1,75 %	-	1,00 %	-	1,00 %
Global Small Cap Equity Fund	-	-	0,95	-	-	-
Small Cap Innovation Fund	1,80	-	0,95	-	0,95	-
U.S. All Cap Growth Fund	1,84	-	1,00	-	1,04	-
U.S. Large Cap Growth Fund	1,74	-	0,90	-	0,94	-
U.S. Select Equity Fund	1,85	-	1,15	-	1,15	-
U.S. Short-Term High Yield Bond Fund	1,30	-	0,80	-	-	-
USD Investment Grade Credit Fund	0,95	-	0,45	-	0,45	-

Die Gesamtkostenobergrenzen für Anteile der Klasse X und Anteile der Klasse Y werden in gesonderten Vereinbarungen festgelegt.

7. DERIVATGESCHÄFTE

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2023 gingen die Teilfonds Verkaufsoptionen, Devisenterminkontrakte, Futures-Kontrakte, Differenzkontrakte und Total Return Basket Swaps ein.

Zum 31. März 2023 wies der Global Equity Enhanced Income Fund die folgenden ausstehenden Verkaufsoptionen auf:

Gattungsbezeichnung	Makler	Anzahl Kontrakte	Nomineller Betrag USD	Ausübungspreis USD	Verpflichtung USD	Ablaufdatum	Marktwert USD
Call							
WDAXE Index	Morgan Stanley & Company	(5)	(181)	18.057	0	31.03.2023	0
MXEA Index	Morgan Stanley & Company	(24)	(575)	2.250	0	31.03.2023	0
MXEF Index	Morgan Stanley & Company	(12)	(108)	1.120	0	31.03.2023	0
RUTW Index	Morgan Stanley & Company	(20)	(11.979)	2.030	0	31.03.2023	0
SPXW Index	Morgan Stanley & Company	„1.	(94)	4.385	0	31.03.2023	0
SPXW Index	Morgan Stanley & Company	(9)	(10.521)	4.215	0	31.03.2023	0
WDAXA Index	Morgan Stanley & Company	(14)	(3.522)	17.406	89.574	06.04.2023	(752)
MXEA Index	Morgan Stanley & Company	„1.	(439)	2.160	16.538	06.04.2023	(66)
MXEA Index	Morgan Stanley & Company	(7)	(1.078)	2.200	43.674	06.04.2023	(33)
MXEF Index	Morgan Stanley & Company	(18)	(611)	1.100	49.003	06.04.2023	0
RUTW Index	Morgan Stanley & Company	(13)	(8.377)	1.935	25.240	06.04.2023	(302)
SPXW Index	Morgan Stanley & Company	(14)	(1.456)	4.325	23.673	06.04.2023	(523)
WSX Index	Morgan Stanley & Company	(43)	(5.397)	4.772	223.072	06.04.2023	(1.749)
MXEA Index	Morgan Stanley & Company	(20)	(779)	2.180	189.203	14.04.2023	(1.800)
MXEF Index	Morgan Stanley & Company	(10)	(240)	1.060	36.183	14.04.2023	(525)

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Gattungsbezeichnung	Makler	Anzahl Kontrakte	Nomineller Betrag USD	Ausübungspreis USD	Verpflichtung USD	Ablaufdatum	Marktwert USD
NDXP Index	Morgan Stanley & Company	„1.	(3.479)	13.550	327.833	14.04.2023	(7.265)
RUTW Index	Morgan Stanley & Company	(4)	(256)	1.985	10.594	14.04.2023	(160)
SPXW Index	Morgan Stanley & Company	(9)	(1.071)	4.350	87.015	14.04.2023	(900)
SPXW Index	Morgan Stanley & Company	(12)	(15.408)	4.150	1.934.998	14.04.2023	(40.560)
WSX Index	Morgan Stanley & Company	(18)	(2.744)	4.690	380.783	14.04.2023	(8.667)
CAC Index	Morgan Stanley & Company	(26)	(6.937)	7.971	926.201	21.04.2023	(27.238)
MXEA Index	Morgan Stanley & Company	(7)	(138)	2.220	38.120	21.04.2023	(420)
MXEF Index	Morgan Stanley & Company	(17)	(6.953)	1.025	356.321	21.04.2023	(7.905)
NDX Index	Morgan Stanley & Company	„1.	(3.519)	13.675	292.355	21.04.2023	(7.315)
RUT Index	Morgan Stanley & Company	„1.	(49)	1.965	6.483	21.04.2023	(117)
SPX Index	Morgan Stanley & Company	(20)	(1.879)	4.340	428.376	21.04.2023	(5.750)
UKX Index	Morgan Stanley & Company	(12)	(2.700)	9.499	373.681	21.04.2023	(7.661)
							(119.708)

Zum 31. März 2023 verfügte der Global Equity Enhanced Income Fund über abgesonderte Wertpapiere als Sicherheiten für offene Verkaufsoptionen in Höhe von 38.617.042 USD (vor Sicherheitsabschlag). Diese Wertpapiere sind im Anlagenspiegel ausgewiesen.

Zum 31. März 2023 wiesen folgende Teilfonds ausstehende Devisenterminkontrakte auf:

Art des Kontrakts	Zweck	Kontrahent	Fälligkeitsdatum	Zum Kauf/Verkauf	Kosten	Marktwert	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
2 Degree Global Equity Fund							
Kauf	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	7.536 EUR	8.088 USD	8.182 USD	94 USD
Alternative Risk Premia Fund							
Kauf	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	7.843 EUR	8.416 USD	8.515 USD	99 USD
	Wirtschaftliche Absicherung	Barclays Bank PLC	19.04.2023	6.606.000 BRL	1.281.022 USD	1.300.243 USD	19.221 USD
	Wirtschaftliche Absicherung	Barclays Bank PLC	19.04.2023	1.184.649.000 CLP	1.464.102 USD	1.487.694 USD	23.592 USD
	Wirtschaftliche Absicherung	Barclays Bank PLC	19.04.2023	19.996.000 CZK	893.805 USD	923.286 USD	29.481 USD
	Wirtschaftliche Absicherung	Barclays Bank PLC	19.04.2023	2.957.000 GBP	3.503.389 USD	3.648.892 USD	145.503 USD
	Wirtschaftliche Absicherung	Barclays Bank PLC	19.04.2023	600.368.000 HUF	1.656.257 USD	1.705.053 USD	48.796 USD
	Wirtschaftliche Absicherung	Barclays Bank PLC	19.04.2023	460.277.000 JPY	3.382.086 USD	3.474.763 USD	92.677 USD
	Wirtschaftliche Absicherung	Barclays Bank PLC	19.04.2023	35.629.000 MXN	1.969.689 USD	1.971.375 USD	1.686 USD
	Wirtschaftliche Absicherung	Barclays Bank PLC	19.04.2023	6.716.000 PLN	1.510.532 USD	1.554.494 USD	43.962 USD
	Wirtschaftliche Absicherung	Barclays Bank PLC	19.04.2023	1.913.000 SEK	179.353 USD	184.471 USD	5.118 USD
	Wirtschaftliche Absicherung	Barclays Bank PLC	19.04.2023	2.739.000 ZAR	147.146 USD	153.631 USD	6.485 USD
Verkauf	Wirtschaftliche Absicherung	Barclays Bank PLC	19.04.2023	(7.646.000) AUD	5.062.137 USD	5.113.714 USD	(51.577) USD
	Wirtschaftliche Absicherung	Barclays Bank PLC	19.04.2023	(6.659.000) CAD	4.834.718 USD	4.928.157 USD	(93.439) USD
	Wirtschaftliche Absicherung	Barclays Bank PLC	19.04.2023	(6.871.000) CHF	7.336.622 USD	7.521.802 USD	(185.180) USD
	Wirtschaftliche Absicherung	Barclays Bank PLC	19.04.2023	(11.543.000) EUR	12.216.653 USD	12.528.818 USD	(312.165) USD
	Wirtschaftliche Absicherung	Barclays Bank PLC	19.04.2023	(3.858.768.000) IDR	249.776 USD	257.236 USD	(7.460) USD
	Wirtschaftliche Absicherung	Barclays Bank PLC	19.04.2023	(135.918.000) INR	1.654.208 USD	1.652.260 USD	1.948 USD
	Wirtschaftliche Absicherung	Barclays Bank PLC	19.04.2023	(790.113.000) KRW	602.161 USD	607.474 USD	(5.313) USD
	Wirtschaftliche Absicherung	Barclays Bank PLC	19.04.2023	(54.366.000) NOK	5.127.410 USD	5.196.277 USD	(68.867) USD
	Wirtschaftliche Absicherung	Barclays Bank PLC	19.04.2023	(1.799.000) NZD	1.100.994 USD	1.124.962 USD	(23.968) USD

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Art des Kontrakts	Zweck	Kontrahent	Fälligkeitsdatum	Zum Kauf/Verkauf	Kosten	Marktwert	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
Climate Transition Global Investment Grade Credit Fund							
Kauf	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	7.035 EUR	7.549 USD	7.638 USD	89 USD
	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	100.896.112 GBP	123.643.817 USD	124.517.137 USD	873.320 USD
Verkauf	Wirtschaftliche Absicherung	BNP Paribas SA	26.04.2023	(614.000) CAD	447.151 USD	454.456 USD	(7.305) USD
	Wirtschaftliche Absicherung	State Street Bank	26.04.2023	(36.350.000) EUR	38.812.742 USD	39.470.023 USD	(657.281) USD
	Wirtschaftliche Absicherung	State Street Bank	26.04.2023	(5.800.000) GBP	7.075.259 USD	7.158.154 USD	(82.895) USD
EUR Investment Grade Credit Fund							
Kauf	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	96.140.027 CHF	96.628.095 EUR	96.964.027 EUR	335.932 EUR
Verkauf	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	(993.094) CHF	998.589 EUR	1.001.606 EUR	(3.017) EUR
	Wirtschaftliche Absicherung	State Street Bank	26.04.2023	(1.150.000) GBP	1.314.873 EUR	1.307.760 EUR	7.113 EUR
	Wirtschaftliche Absicherung	State Street Bank	26.04.2023	(1.000.000) USD	936.232 EUR	919.297 EUR	16.935 EUR
EUR Short Duration Credit Fund							
Kauf	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	36.586 GBP	41.770 EUR	41.607 EUR	(163) EUR
	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	87.185.703 USD	81.250.130 EUR	80.158.674 EUR	(1.091.456) EUR
Verkauf	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	(4.671.474) USD	4.282.216 EUR	4.294.961 EUR	(12.745) EUR
	Wirtschaftliche Absicherung	State Street Bank	26.04.2023	(3.900.000) GBP	4.459.427 EUR	4.435.013 EUR	24.414 EUR
	Wirtschaftliche Absicherung	State Street Bank	26.04.2023	(800.000) USD	748.902 EUR	735.438 EUR	13.464 EUR
Global Equity Enhanced Income Fund							
Kauf	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	708.686 SGD	530.052 USD	532.860 USD	2.808 USD
Global Long/ Short Equity Fund							
Kauf	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	21.757.225 AUD	14.580.460 USD	14.554.019 USD	(26.441) USD
	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	6.638.270 EUR	7.123.386 USD	7.207.239 USD	83.853 USD
Small Cap Innovation Fund							
Kauf	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	9.279 EUR	9.957 USD	10.074 USD	117 USD
	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	8.791 SGD	6.575 USD	6.610 USD	35 USD
U.S. All Cap Growth Fund							
Kauf	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	2.241.602 EUR	2.405.919 USD	2.433.730 USD	27.811 USD
	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	633.365 SGD	473.728 USD	476.227 USD	2.499 USD
Verkauf	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	(9.260) EUR	10.013 USD	10.054 USD	(41) USD
	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	(68.428) SGD	51.440 USD	51.451 USD	(11) USD
U.S. Short-Term High Yield Bond Fund							
Kauf	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	19.154 EUR	20.555 USD	20.796 USD	241 USD
	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	21.331.904 GBP	26.142.362 USD	26.325.967 USD	183.605 USD
Verkauf	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	(113) EUR	122 USD	123 USD	(1) USD
	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	(72.957) GBP	89.867 USD	90.038 USD	(171) USD

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

USD Investment Grade Credit Fund

Kauf	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	354.104.975 EUR	379.982.006 USD	384.455.423 USD	4.473.417 USD
	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	141.638 GBP	173.587 USD	174.797 USD	1.210 USD
Verkauf	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	1.759.682.707 JPY	13.420.206 USD	13.295.641 USD	(124.565) USD
	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	9.587 SGD	7.170 USD	7.208 USD	38 USD
	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	(85.987.457) EUR	93.345.024 USD	93.357.469 USD	(12.445) USD
	Währungsabsicherung	Brown Brothers Harriman	24.04.2023	(29.385.090) JPY	225.479 USD	222.025 USD	3.454 USD

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Zum 31. März 2023 verfügten der Alternative Risk Premia Fund und der Climate Transition Global Investment Grade Credit Fund über abgesonderte Barmittel in Höhe von 290.000 USD bzw. 510.000 USD für offene Devisenterminkontrakte. Diese Beträge sind in der Vermögensbilanz als abgesonderte Barsicherheiten erfasst.

Zum 31. März 2023 verfügten die folgenden Teilfonds über offene Futures-Kontrakte:

Art des Kontrakts	Gattungsbezeichnung	Fälligkeitsdatum	Engagementsbestand	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust)
Alternative Risk Premia Fund				
4 Short	Euro-Bund Futures	08.06.2023	(589.274) USD	(14.164) USD
108 Short	Australian 10 Year Bond Futures	15.06.2023	(8.871.490) USD	(248.841) USD
2 Short	S&P/TSX 60 Index Futures	15.06.2023	(357.884) USD	5.313 USD
6 Short	MSCI Emerging Markets Index Futures	16.06.2023	(298.650) USD	(10.950) USD
1 Short	NASDAQ 100 E-Mini Futures	16.06.2023	(266.035) USD	(23.239) USD
2 Short	S&P 500 E-Mini Futures	16.06.2023	(413.775) USD	(18.286) USD
57 Short	Long Gilt Futures	28.06.2023	(7.267.076) USD	(189.391) USD
4 Long	CAC40 10 Euro Futures	21.04.2023	318.149 USD	5.609 USD
3 Long	TOPIX Index Futures	08.06.2023	452.683 USD	6.598 USD
3 Long	SPI 200 Futures	15.06.2023	360.512 USD	(7.420) USD
1 Long	DAX Index Futures	16.06.2023	428.296 USD	6.371 USD
3 Long	E-Mini Russell 2000 Index Futures	16.06.2023	272.025 USD	(4.395) USD
7 Long	Euro STOXX 50 Futures	16.06.2023	323.474 USD	9.072 USD
4 Long	FTSE 100 Index Futures	16.06.2023	376.939 USD	(4.444) USD
79 Long	10 Year U.S. Treasury Note	21.06.2023	9.078.828 USD	306.953 USD
45 Long	Canadian 10 Year Bond Futures	21.06.2023	4.200.666 USD	168.435 USD
EUR Investment Grade Credit Fund				
12 Short	Euro-BOBL Futures	08.06.2023	(1.414.560) EUR	(31.920) EUR
5 Short	10 Year U.S. Treasury Note	21.06.2023	(528.887) EUR	(15.676) EUR
23 Long	Euro-Bund Futures	08.06.2023	3.124.320 EUR	18.170 EUR
63 Long	Euro-Schatz Futures	08.06.2023	6.658.785 EUR	74.345 EUR
EUR Short Duration Credit Fund				
13 Short	Long Gilt Futures	28.06.2023	(1.529.046) EUR	(40.982) EUR
66 Long	Euro-BOBL Futures	08.06.2023	7.780.080 EUR	(93.890) EUR
87 Long	Euro-Schatz Futures	08.06.2023	9.195.465 EUR	92.655 EUR
Global Equity Enhanced Income Fund				
50 Long	S&P 500 E-Mini Futures	16.06.2023	1.034.438 USD	37.691 USD
Global Factor Enhanced Equity Fund				
36 Long	MSCI World Index Futures	16.06.2023	1.006.740 USD	33.499 USD

Zum 31. März 2023 verfügten der Alternative Risk Premia Fund, der Global Equity Enhanced Income Fund und der Global Factor Enhanced Equity Fund über abgesonderte Barmittel in Höhe von 1.981.799 USD, 64.000 USD bzw. 331.764 USD für offene Futures-Kontrakte. Diese Beträge sind in der Vermögensbilanz als abgesonderte Barsicherheiten erfasst.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Zum 31. März 2023 wiesen die folgenden Teilfonds ausstehende Differenzkontrakte auf:

Währung	Wertpapier	Long/Short	Aktien	Marktwert USD	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/ (-minderung)
Alternative Risk Premia Fund					
USD	A O Smith Corporation	Long	325	22.474	878
USD	A10 Networks Incorporated	Long	152	2.354	134
USD	AAR Corporation	Long	497	27.111	1.337
USD	ABB Limited	Long	1.787	61.476	3.424
USD	AbbVie Incorporated	Long	177	28.208	575
USD	ABN AMRO Bank NV	Long	1.424	22.581	694
USD	ACADIA Pharmaceuticals Incorporated	Long	672	12.647	(632)
USD	Adaptive Biotechnologies Corporation	Long	822	7.258	658
USD	Adecco Group AG	Long	130	4.735	290
USD	AdvanSix Incorporated	Long	342	13.088	1.125
USD	Aflac Incorporated	Long	259	16.711	295
USD	Akamai Technologies Incorporated	Long	186	14.564	588
USD	Allstate Corporation	Long	55	6.095	89
USD	Alpha Metallurgical Resources Incorporated	Long	96	14.976	1.162
USD	Alto Ingredients Incorporated	Long	8.296	12.444	(913)
USD	A-Mark Precious Metals Incorporated	Long	765	26.507	3.726
USD	Ambac Financial Group Incorporated	Long	490	7.585	235
USD	American Axle & Manufacturing Holdings Incorporated	Long	1.159	9.052	568
USD	American Financial Group Incorporated	Long	693	84.200	1.275
USD	American Vanguard Corporation	Long	904	19.780	551
USD	Ameriprise Financial Incorporated	Long	12	3.678	224
USD	AMERISAFE Incorporated	Long	371	18.160	(434)
USD	Amgen Incorporated	Long	116	28.043	815
USD	Amneal Pharmaceuticals Incorporated	Long	5.482	7.620	(219)
USD	Amphastar Pharmaceuticals Incorporated	Long	881	33.038	273
USD	Ampol Limited	Long	164	3.344	97
USD	Andersons Incorporated	Long	387	15.991	832
USD	Angi Incorporated	Long	10.566	23.985	1.374
USD	Anima Holding SpA	Long	1.889	7.676	157
USD	APA Corporation	Long	145	5.229	461
USD	Apartment Investment and Management Company	Long	396	3.045	202
USD	Apogee Enterprises Incorporated	Long	535	23.139	1.017
USD	Appen Limited	Long	7.079	13.461	1.193
USD	Aramark	Long	1.795	64.261	4.290
USD	Arch Capital Group Limited	Long	64	4.344	145
USD	Arcturus Therapeutics Holdings Incorporated	Long	273	6.544	2.353
USD	Arlo Technologies Incorporated	Long	4.744	28.749	2.989
USD	Arrow Electronics Incorporated	Long	650	81.166	4.706
USD	Artis Real Estate Investment Trust	Long	800	4.505	(104)
USD	Artivion Incorporated	Long	1.243	16.283	1.330
USD	Aryzta AG	Long	20.296	34.519	2.691

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Währung	Wertpapier	Long/Short	Aktien	Marktwert USD	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/ (-minderung)
Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)					
USD	Assurant Incorporated	Long	458	54.992	4.067
USD	Atara Biotherapeutics Incorporated	Long	3.747	10.866	(300)
USD	AtriCure Incorporated	Long	52	2.155	128
USD	Atrion Corporation	Long	23	14.442	21
USD	Auto Trader Group plc	Long	12.683	96.742	5.184
USD	AutoZone Incorporated	Long	15	36.872	1.005
USD	Avantax Incorporated	Long	1.466	38.585	2.741
USD	Avaya Holdings Corporation	Long	20.389	4	(16)
USD	Avid Technology Incorporated	Long	460	14.711	1.371
USD	Axsome Therapeutics Incorporated	Long	263	16.222	(400)
USD	Azbil Corporation	Long	500	13.695	780
USD	Babcock International Group plc	Long	3.641	13.451	(218)
USD	Baloise Holding AG	Long	25	3.893	207
USD	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	Long	2.082	4.524	230
USD	BancFirst Corporation	Long	71	5.900	(60)
USD	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Long	8.767	62.678	4.126
USD	BARK Incorporated	Long	11.249	16.311	2.587
USD	Barrett Business Services Incorporated	Long	281	24.908	705
USD	Bath & Body Works Incorporated	Long	948	34.678	1.668
USD	Bausch Health Companies Incorporated	Long	4.700	38.080	2.435
USD	Bayerische Motoren Werke AG	Long	119	12.164	691
USD	Bechtle AG	Long	434	20.783	2.181
USD	Becton Dickinson & Company	Long	110	27.229	996
USD	Benchmark Electronics Incorporated	Long	89	2.108	92
USD	Berkshire Hills Bancorp Incorporated	Long	397	9.949	290
USD	Best Buy Company Incorporated	Long	49	3.835	7
USD	Bilfinger SE	Long	638	27.056	1.002
USD	BioMerieux	Long	407	42.904	467
USD	Bio-Techne Corporation	Long	52	3.858	85
USD	BlackBerry Limited	Long	11.100	50.921	10.780
USD	BlueLinx Holdings Incorporated	Long	93	6.320	(551)
USD	BM Technologies Incorporated	Long	12	42	9
USD	Booz Allen Hamilton Holding Corporation	Long	554	51.350	1.258
USD	BRC Incorporated	Long	480	2.467	29
USD	Brightsphere Investment Group Incorporated	Long	1.385	32.658	1.496
USD	Bristol-Myers Squibb Company	Long	577	39.992	1.194
USD	Broadcom Incorporated	Long	6	3.849	(13)
USD	Brookline Bancorp Incorporated	Long	194	2.037	(4)
USD	Brown-Forman Corporation	Long	46	2.956	87
USD	BRP Incorporated	Long	200	15.651	43
USD	Bunge Limited	Long	168	16.047	81
USD	Bureau Veritas SA	Long	1.006	28.905	535
USD	Cadence Design Systems Incorporated	Long	254	53.363	767

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Währung	Wertpapier	Long/Short	Aktien	Marktwert USD	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/ (-minderung)
Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)					
USD	Calavo Growers Incorporated	Long	881	25.346	4.819
USD	Caleres Incorporated	Long	86	1.860	(46)
USD	Cal-Maine Foods Incorporated	Long	306	18.632	1.876
USD	Campbell Soup Company	Long	1.911	105.067	1.720
USD	Canadian Utilities Limited	Long	700	19.506	663
USD	Capcom Company Limited	Long	200	7.158	210
USD	Cardiovascular Systems Incorporated	Long	477	9.473	48
USD	Carrefour SA	Long	1.102	22.280	1.544
USD	Carriage Services Incorporated	Long	566	17.274	(600)
USD	Cars.com Incorporated	Long	231	4.458	446
USD	Catalyst Pharmaceuticals Incorporated	Long	1.485	24.621	267
USD	Cboe Global Markets Incorporated	Long	204	27.385	1.752
USD	CellSource Company Limited	Long	200	4.710	(153)
USD	Centerra Gold Incorporated	Long	5.600	36.173	630
USD	Central Pacific Financial Corporation	Long	151	2.703	(106)
USD	Centrus Energy Corporation	Long	135	4.347	(49)
USD	CF Industries Holdings Incorporated	Long	404	29.286	(32)
USD	CGI Incorporated	Long	800	77.100	3.332
USD	CH Robinson Worldwide Incorporated	Long	439	43.623	1.493
USD	Check Point Software Technologies Limited	Long	154	20.020	(156)
USD	Chemed Corporation	Long	12	6.453	138
USD	Chewy Incorporated	Long	1.532	57.266	(950)
USD	Chico's FAS Incorporated	Long	2.621	14.416	(524)
USD	Chimerix Incorporated	Long	7.382	9.301	(148)
USD	Chiyoda Corporation	Long	3.000	8.894	474
USD	Chuy's Holdings Incorporated	Long	238	8.532	231
USD	Cia de Distribucion Integral Logista Holdings SA	Long	408	10.181	219
USD	Cineplex Incorporated	Long	1.500	9.800	1.246
USD	City Developments Limited	Long	4.200	23.306	1.013
USD	City Holding Company	Long	207	18.812	(195)
USD	CK Hutchison Holdings Limited	Long	4.000	24.747	(101)
USD	CK Infrastructure Holdings Limited	Long	5.500	29.925	315
USD	Clariant AG	Long	2.302	38.189	2.065
USD	Clearwater Paper Corporation	Long	414	13.836	75
USD	Clearway Energy Incorporated	Long	361	10.841	354
USD	Clorox Company	Long	216	34.180	387
USD	CMS Energy Corporation	Long	354	21.729	(181)
USD	Cochlear Limited	Long	47	7.482	397
USD	Codexis Incorporated	Long	660	2.732	185
USD	Cognizant Technology Solutions Corporation	Long	1.055	64.281	2.353
USD	Cognyte Software Limited	Long	9.802	33.229	1.568
USD	Coherus Biosciences Incorporated	Long	2.219	15.178	1.287
USD	Colgate-Palmolive Company	Long	123	9.243	255

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Währung	Wertpapier	Long/Short	Aktien	Marktwert USD	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/ (-minderung)
Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)					
USD	Community Health Systems Incorporated	Long	1.672	8.193	(468)
USD	CommVault Systems Incorporated	Long	105	5.958	77
USD	Computershare Limited	Long	1.360	19.754	1.082
USD	Consensus Cloud Solutions Incorporated	Long	696	23.727	1.169
USD	Consolidated Edison Incorporated	Long	382	36.546	(474)
USD	Corcept Therapeutics Incorporated	Long	1.183	25.624	899
USD	Corus Entertainment Incorporated	Long	3.100	3.945	269
USD	CorVel Corporation	Long	21	3.996	26
USD	Cosmo Energy Holdings Company Limited	Long	100	3.240	444
USD	Cowell e Holdings Incorporated	Long	9.000	21.529	2.997
USD	CRA International Incorporated	Long	59	6.361	(91)
USD	Cracker Barrel Old Country Store Incorporated	Long	114	12.950	6
USD	CRH plc	Long	220	11.114	260
USD	Cross Country Healthcare Incorporated	Long	296	6.607	(107)
USD	Crown Holdings Incorporated	Long	178	14.722	902
USD	CSG Systems International Incorporated	Long	420	22.554	218
USD	Cybozu Incorporated	Long	1.200	26.771	(1.175)
USD	Daiki Aluminium Industry Company Limited	Long	300	3.248	58
USD	Daito Trust Construction Company Limited	Long	200	19.926	765
USD	Danske Bank A/S	Long	2.207	44.402	(142)
USD	Deciphera Pharmaceuticals Incorporated	Long	559	8.637	(50)
USD	Delek Group Limited	Long	84	9.353	2.252
USD	Delta Air Lines Incorporated	Long	111	3.876	198
USD	Demae-Can Company Limited	Long	5.500	18.227	746
USD	Denny's Corporation	Long	615	6.863	117
USD	DENTSPLY SIRONA Incorporated	Long	350	13.748	802
USD	Designer Brands Incorporated	Long	289	2.526	(52)
USD	Deterra Royalties Limited	Long	6.332	20.376	1.861
USD	Diebold Nixdorf Incorporated	Long	3.985	4.782	598
USD	Digital Brothers SpA	Long	530	11.953	364
USD	Dollar Tree Incorporated	Long	92	13.207	227
USD	Dollarama Incorporated	Long	500	29.882	1.167
USD	Domino's Pizza Enterprises Limited	Long	1.155	38.773	3.115
USD	Domino's Pizza Group plc	Long	8.333	29.382	2.226
USD	Domino's Pizza Incorporated	Long	123	40.574	1.561
USD	Donnelley Financial Solutions Incorporated	Long	609	24.884	2.138
USD	Dorian LPG Limited	Long	1.452	28.953	(799)
USD	Downer EDI Limited	Long	4.407	10.168	231
USD	Dropbox Incorporated	Long	3.034	65.595	3.337
USD	DTE Energy Company	Long	438	47.979	499
USD	Dynex Capital Incorporated	Long	110	1.333	61
USD	Eagers Automotive Limited	Long	507	4.603	128
USD	Eagle Pharmaceuticals Incorporated	Long	248	7.036	417

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Währung	Wertpapier	Long/Short	Aktien	Marktwert USD	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/ (-minderung)
Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)					
USD	Eastman Chemical Company	Long	389	32.808	1.249
USD	EchoStar Corporation	Long	680	12.437	(177)
USD	Ecovyst Incorporated	Long	1.481	16.365	1.525
USD	Edgio Incorporated	Long	669	529	0
USD	Elior Group	Long	7.317	25.737	577
USD	Empire Co Limited	Long	700	18.765	1.168
USD	Employers Holdings Incorporated	Long	553	23.055	(265)
USD	en Japan Incorporated	Long	200	3.452	(57)
USD	Enanta Pharmaceuticals Incorporated	Long	401	16.216	(517)
USD	Encore Capital Group Incorporated	Long	351	17.708	1.537
USD	Encore Wire Corporation	Long	41	7.599	302
USD	ENEOS Holdings Incorporated	Long	3.000	10.526	208
USD	Energy Recovery Incorporated	Long	154	3.550	251
USD	Enerpac Tool Group Corporation	Long	101	2.576	(188)
USD	Enghouse Systems Limited	Long	500	14.151	806
USD	Epiroc AB	Long	246	4.194	304
USD	Equitable Holdings Incorporated	Long	173	4.392	220
USD	Erie Indemnity Company	Long	293	67.876	(372)
USD	Esker SA	Long	85	12.115	(1.378)
USD	Ethan Allen Interiors Incorporated	Long	985	27.048	532
USD	Eurazeo SE	Long	95	6.762	413
USD	Everest Re Group Limited	Long	41	14.679	416
USD	EverQuote Incorporated	Long	2.556	35.528	3.860
USD	Evolus Incorporated	Long	472	3.993	24
USD	Exelon Corporation	Long	1.215	50.896	85
USD	EXOR NV	Long	705	58.134	2.049
USD	Extra Space Storage Incorporated	Long	15	2.444	39
USD	Fair Isaac Corporation	Long	124	87.134	2.497
USD	Fairfax Financial Holdings Limited	Long	100	66.506	1.353
USD	Federated Hermes Incorporated	Long	63	2.529	(22)
USD	Ferrexpo plc	Long	1.835	2.670	(47)
USD	Ferrotec Holdings Corporation	Long	1.200	30.006	1.696
USD	FibroGen Incorporated	Long	782	14.592	(1.048)
USD	Financial Products Group Company Limited	Long	4.300	37.630	3.707
USD	Fingerprint Cards AB	Long	22.560	7.214	597
USD	First Commonwealth Financial Corporation	Long	697	8.664	(160)
USD	Flowers Foods Incorporated	Long	311	8.525	115
USD	Ford Motor Company	Long	381	4.801	541
USD	Fox Corporation	Long	566	19.272	351
USD	Fresh Del Monte Produce Incorporated	Long	94	2.830	19
USD	Frontdoor Incorporated	Long	543	15.139	804
USD	Fuji Electric Company Limitd	Long	1.100	43.439	2.094
USD	Fuji Soft Incorporated	Long	500	29.025	(559)

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Währung	Wertpapier	Long/Short	Aktien	Marktwert USD	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/ (-minderung)
Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)					
USD	Fujikura Limited	Long	3.400	24.152	1.559
USD	Fujitsu Limited	Long	200	27.026	(479)
USD	Furukawa Electric Company Limited	Long	200	3.725	239
USD	Future Corporation	Long	800	11.058	796
USD	Galenica AG	Long	203	17.173	1.114
USD	Gannett Company Incorporated	Long	4.116	7.697	(494)
USD	Gartner Incorporated	Long	147	47.888	2.590
USD	GEA Group AG	Long	204	9.306	81
USD	General Mills Incorporated	Long	252	21.536	1.212
USD	Genworth Financial Incorporated	Long	1.601	8.037	80
USD	Geron Corporation	Long	8.912	19.339	(2.584)
USD	Getinge AB	Long	2.256	55.020	5.418
USD	Gildan Activewear Incorporated	Long	1.000	33.222	1.781
USD	Gilead Sciences Incorporated	Long	51	4.231	179
USD	Globe Life Incorporated	Long	155	17.053	383
USD	GLOBERIDE Incorporated	Long	700	13.132	665
USD	GMO GlobalSign Holdings	Long	1.100	34.004	460
USD	GoDaddy Incorporated	Long	260	20.207	863
USD	Gossamer Bio Incorporated	Long	840	1.058	42
USD	Gran Tierra Energy Incorporated	Long	10.987	9.659	1.583
USD	Grand Canyon Education Incorporated	Long	290	33.031	1.270
USD	Greif Incorporated	Long	219	13.878	694
USD	Grieg Seafood ASA	Long	601	4.698	731
USD	Grifols SA	Long	354	3.504	312
USD	Groupon Incorporated	Long	752	3.166	113
USD	Guidewire Software Incorporated	Long	161	13.210	1.001
USD	Gulf Keystone Petroleum Limited	Long	3.611	6.495	(1.067)
USD	GungHo Online Entertainment Incorporated	Long	200	3.664	(149)
USD	H&R Block Incorporated	Long	142	5.006	(31)
USD	Hanmi Financial Corporation	Long	375	6.964	(278)
USD	Hargreaves Lansdown plc	Long	5.588	55.357	1.480
USD	Hasbro Incorporated	Long	418	22.442	2.220
USD	Haverty Furniture Companies Incorporated	Long	804	25.656	(346)
USD	Healius Limited	Long	2.541	5.396	278
USD	Healthcare Services Group Incorporated	Long	743	10.305	899
USD	HEICO Corporation	Long	55	9.407	325
USD	Heritage Financial Corporation	Long	76	1.626	(73)
USD	Heron Therapeutics Incorporated	Long	5.911	8.926	(3.369)
USD	Hershey Company	Long	31	7.887	306
USD	Hibbett Incorporated	Long	249	14.686	(314)
USD	Hikma Pharmaceuticals plc	Long	204	4.228	80
USD	Hilton Worldwide Holdings Incorporated	Long	26	3.663	74
USD	Hope Bancorp Incorporated	Long	217	2.131	(139)

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Währung	Wertpapier	Long/Short	Aktien	Marktwert USD	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/ (-minderung)
Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)					
USD	HSBC Holdings plc	Long	842	5.723	131
USD	Hub Group Incorporated	Long	43	3.609	107
USD	Huber + Suhner AG	Long	191	16.402	550
USD	Husqvarna AB	Long	1.935	16.795	948
USD	Idemitsu Kosan Company Limited	Long	2.100	45.975	686
USD	IDT Corporation	Long	175	5.964	124
USD	IGM Financial Incorporated	Long	700	20.920	140
USD	Iida Group Holdings Company Limited	Long	2.600	42.449	736
USD	IMAX Corporation	Long	386	7.403	691
USD	Imperial Brands plc	Long	1.310	30.124	(504)
USD	Ingles Markets Incorporated	Long	331	29.360	(288)
USD	Innoviva Incorporated	Long	236	2.655	14
USD	Inogen Incorporated	Long	90	1.123	(21)
USD	Inpex Corporation	Long	1.700	17.990	929
USD	Inseego Corporation	Long	8.401	4.893	(106)
USD	Intercept Pharmaceuticals Incorporated	Long	1.626	21.837	(2.618)
USD	Interface Incorporated	Long	202	1.640	81
USD	International Business Machines Corporation	Long	49	6.423	252
USD	International Money Express Incorporated	Long	509	13.122	1.222
USD	International Paper Company	Long	96	3.462	118
USD	Invesco Limited	Long	3.927	64.403	3.731
USD	Ipsen SA	Long	414	45.586	(1.007)
USD	IQVIA Holdings Incorporated	Long	73	14.519	517
USD	IRESS Limited	Long	3.344	22.370	2.993
USD	iRhythm Technologies Incorporated	Long	53	6.574	476
USD	Iron Mountain Incorporated	Long	55	2.910	101
USD	Isuzu Motors Limited	Long	3.700	44.219	1.052
USD	Itochu Techno-Solutions Corporation	Long	800	19.712	353
USD	J M Smucker Company	Long	282	44.378	821
USD	Jack Henry & Associates Incorporated	Long	498	75.059	(642)
USD	Jacobs Solutions Incorporated	Long	28	3.290	97
USD	Japan Display Incorporated	Long	120.100	36.348	1.729
USD	Japan Post Insurance Company Limited	Long	400	6.234	(44)
USD	Jardine Matheson Holdings Limited	Long	100	4.864	231
USD	JB Hunt Transport Services Incorporated	Long	254	44.567	2.489
USD	Jeronimo Martins SGPS SA	Long	144	3.380	191
USD	JFE Holdings Incorporated	Long	2.600	33.000	2.075
USD	John B Sanfilippo & Son Incorporated	Long	365	35.376	(391)
USD	Johnson Matthey plc	Long	3.233	79.261	2.284
USD	Juniper Networks Incorporated	Long	1.561	53.730	3.793
USD	K+S AG	Long	729	15.524	436
USD	Kajima Corporation	Long	500	6.034	143
USD	Kakaku.com Incorporated	Long	3.000	41.182	15

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Währung	Wertpapier	Long/Short	Aktien	Marktwert USD	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/ (-minderung)
Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)					
USD	Kaman Corporation	Long	160	3.658	182
USD	Karyopharm Therapeutics Incorporated	Long	5.617	21.850	2.022
USD	KeePer Technical Laboratory Company Limited	Long	500	18.695	1.134
USD	Kellogg Company	Long	593	39.707	1.150
USD	Keppel Corporation Limited	Long	6.900	29.275	2.065
USD	Kforce Incorporated	Long	325	20.553	575
USD	Kiniksa Pharmaceuticals Limited	Long	1.859	20.003	(669)
USD	Kinnevik AB	Long	3.563	53.277	4.710
USD	Knight-Swift Transportation Holdings Incorporated	Long	522	29.535	1.827
USD	Kobe Bussan Company Limited	Long	1.200	33.507	1.419
USD	Kongsberg Gruppen ASA	Long	484	19.565	646
USD	Koninklijke BAM Groep NV	Long	9.841	23.455	481
USD	Koninklijke KPN NV	Long	3.715	13.127	122
USD	Kose Corporation	Long	100	11.886	818
USD	Koshidaka Holdings Company Limited	Long	3.300	23.969	1.190
USD	L3Harris Technologies Incorporated	Long	25	4.906	(20)
USD	Landis+Gyr Group AG	Long	246	18.934	1.133
USD	Lands' End Incorporated	Long	239	2.323	268
USD	Laureate Education Incorporated	Long	2.306	27.119	669
USD	Leidos Holdings Incorporated	Long	201	18.504	96
USD	Lendlease Corporation Limited	Long	3.136	15.262	511
USD	Leopalace21 Corporation	Long	22.000	59.425	4.520
USD	Liberty Global plc	Long	1.526	31.100	458
USD	Liberty Global plc	Long	938	18.291	253
USD	Link Administration Holdings Limited	Long	3.258	4.626	157
USD	Link and Motivation Incorporated	Long	2.500	9.937	342
USD	Lixil Corporation	Long	600	9.904	95
USD	LL Flooring Holdings Incorporated	Long	1.232	4.682	419
USD	Loblaw Companies Limited	Long	200	18.227	1.186
USD	Loyalty Ventures Incorporated	Long	2.542	51	(503)
USD	LPL Financial Holdings Incorporated	Long	150	30.360	(486)
USD	Lumen Technologies Incorporated	Long	1.850	4.903	296
USD	Macnica Fuji Electronics Holdings Incorporated	Long	1.000	28.485	2.049
USD	MacroGenics Incorporated	Long	3.424	24.550	1.644
USD	Madriral Pharmaceuticals Incorporated	Long	36	8.721	(492)
USD	Management Solutions Company Limited	Long	200	5.018	620
USD	Marathon Oil Corporation	Long	126	3.019	280
USD	Marcus & Millichap Incorporated	Long	151	4.849	193
USD	Marcus Corporation	Long	1.402	22.432	1.682
USD	MarketAxess Holdings Incorporated	Long	14	5.478	66
USD	Marten Transport Limited	Long	1.126	23.590	957
USD	Masco Corporation	Long	701	34.854	(287)
USD	Mazda Motor Corporation	Long	10.600	97.774	7.155

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Währung	Wertpapier	Long/Short	Aktien	Marktwert USD	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/ (-minderung)
Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)					
USD	MBIA Incorporated	Long	727	6.732	204
USD	Medibank Private Limited	Long	23.576	53.203	3.040
USD	MedPeer Incorporated	Long	900	7.554	(529)
USD	Meitec Corporation	Long	600	10.743	306
USD	Metro Incorporated	Long	100	5.501	337
USD	Mettler-Toledo International Incorporated	Long	18	27.544	999
USD	Micronics Japan Company Limited	Long	1.300	13.167	535
USD	Mitsubishi HC Capital Incorporated	Long	10.500	54.219	376
USD	Mitsubishi Heavy Industries Limited	Long	2.000	73.682	5.745
USD	Mitsui Chemicals Incorporated	Long	300	7.746	418
USD	Mitsui OSK Lines Limited	Long	600	15.047	(428)
USD	Modine Manufacturing Company	Long	1.221	28.144	1.453
USD	Monadelphous Group Limited	Long	3.272	27.561	3.107
USD	Movado Group Incorporated	Long	443	12.745	(1.692)
USD	Mr Cooper Group Incorporated	Long	69	2.827	103
USD	MRC Global Incorporated	Long	1.414	13.744	1.188
USD	Mueller Industries Incorporated	Long	153	11.242	274
USD	Myriad Genetics Incorporated	Long	110	2.555	(57)
USD	N-able Incorporated	Long	423	5.584	520
USD	National Beverage Corporation	Long	395	20.824	877
USD	NatWest Group plc	Long	1.711	5.583	175
USD	NBT Bancorp Incorporated	Long	263	8.866	(287)
USD	NCC AB	Long	523	4.639	15
USD	Nelnet Incorporated	Long	26	2.389	52
USD	Nemetschek SE	Long	454	31.340	4.819
USD	NETGEAR Incorporated	Long	148	2.739	148
USD	Nexon Company Limited	Long	1.200	28.655	1.628
USD	NextGen Healthcare Incorporated	Long	1.350	23.504	284
USD	NIB Holdings Limited	Long	4.033	19.105	728
USD	Nippon Express Holdings Incorporated	Long	1.000	60.340	3.448
USD	Nippon Gas Company Limited	Long	600	8.707	(13)
USD	NiSource Incorporated	Long	960	26.842	134
USD	Nisshinbo Holdings Incorporated	Long	3.700	28.344	1.625
USD	NN Group NV	Long	225	8.170	54
USD	Nomura Real Estate Holdings Incorporated	Long	500	11.072	315
USD	Nordex SE	Long	783	11.508	472
USD	North West Company Incorporated	Long	200	5.592	326
USD	Northwest Bancshares Incorporated	Long	507	6.099	(314)
USD	Norwegian Air Shuttle ASA	Long	52.890	54.080	2.395
USD	NOW Incorporated	Long	334	3.724	264
USD	Nu Skin Enterprises Incorporated	Long	206	8.098	(14)
USD	Nufarm Limited	Long	3.732	14.328	993
USD	NVR Incorporated	Long	3	16.717	233

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Währung	Wertpapier	Long/Short	Aktien	Marktwert USD	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/ (-minderung)
Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)					
USD	OCI NV	Long	458	15.526	1.594
USD	OFG Bancorp	Long	586	14.615	(498)
USD	Oil Refineries Limited	Long	60.161	16.467	(3.597)
USD	Old Dominion Freight Line Incorporated	Long	71	24.200	526
USD	OneSpan Incorporated	Long	1.486	26.005	(45)
USD	Oracle Corporation	Long	125	11.615	745
USD	OraSure Technologies Incorporated	Long	4.652	28.145	(419)
USD	O'Reilly Automotive Incorporated	Long	24	20.376	790
USD	Orica Limited	Long	7.628	78.800	1.630
USD	Origin Energy Limited	Long	8.356	46.535	1.919
USD	Orion OYJ	Long	2.156	96.369	(5.034)
USD	Orora Limited	Long	6.980	16.062	884
USD	Otsuka Corporation	Long	1.100	39.066	1.476
USD	Otter Tail Corporation	Long	266	19.224	375
USD	Oxford Industries Incorporated	Long	64	6.758	(641)
USD	PACCAR Incorporated	Long	94	6.881	268
USD	Pacific Metals Company Limited	Long	1.400	20.505	1.368
USD	Pan American Silver Corporation	Long	900	16.422	352
USD	Pandora A/S	Long	995	95.508	9.707
USD	Park National Corporation	Long	49	5.810	(136)
USD	Parkland Corporation	Long	1.100	26.371	3.163
USD	Patterson Companies Incorporated	Long	471	12.609	217
USD	Paychex Incorporated	Long	82	9.396	401
USD	PCCW Limited	Long	35.000	17.471	34
USD	PDF Solutions Incorporated	Long	502	21.285	1.145
USD	PDL BioPharma Incorporated	Long	1.963	4.809	(39)
USD	PennyMac Financial Services Incorporated	Long	156	9.299	446
USD	Perdoceo Education Corporation	Long	1.393	18.708	181
USD	Perella Weinberg Partners	Long	3.416	31.086	(752)
USD	Persol Holdings Company Limited	Long	2.600	52.351	1.999
USD	PetIQ Incorporated	Long	1.784	20.409	(285)
USD	PetMed Express Incorporated	Long	943	15.314	(613)
USD	PEXA Group Limited	Long	433	3.929	449
USD	Pharma Foods International Company Limited	Long	300	3.223	87
USD	Pharma Mar SA	Long	129	6.186	(149)
USD	Pharming Group NV	Long	26.394	35.205	8.004
USD	Photronics Incorporated	Long	477	7.909	(43)
USD	PJT Partners Incorporated	Long	296	21.368	(704)
USD	PKSHA Technology Incorporated	Long	1.000	13.726	285
USD	Platinum Asset Management	Long	1.824	2.107	75
USD	Plus Alpha Consulting Company Limited	Long	300	6.862	139
USD	Plus500 Limited	Long	544	11.355	49
USD	PowerCell Sweden AB	Long	1.860	21.160	354

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Währung	Wertpapier	Long/Short	Aktien	Marktwert USD	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/ (-minderung)
Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)					
USD	PPL Corporation	Long	1.045	29.041	543
USD	Praxis Precision Medicines Incorporated	Long	8.749	7.078	(2.021)
USD	PROG Holdings Incorporated	Long	1.381	32.854	1.243
USD	Provention Bio Incorporated	Long	856	20.630	86
USD	Proximus SADP	Long	1.750	16.923	1.013
USD	Prysmian SpA	Long	1.605	67.395	5.395
USD	PTC Therapeutics Incorporated	Long	60	2.906	(3)
USD	Qantas Airways Limited	Long	6.043	26.973	1.823
USD	QIAGEN NV	Long	95	4.327	(17)
USD	Quanex Building Products Corporation	Long	1.012	21.788	1.842
USD	Quantum-Si Incorporated	Long	8.207	14.444	410
USD	QuinStreet Incorporated	Long	1.059	16.806	1.091
USD	Randstad NV	Long	576	34.194	(873)
USD	Ratos AB	Long	7.903	24.148	1.067
USD	Red Electrica Corporation SA	Long	780	13.725	524
USD	Repsol SA	Long	1.687	25.942	1.107
USD	REV Group Incorporated	Long	175	2.098	105
USD	REX American Resources Corporation	Long	144	4.117	(266)
USD	Rheinmetall AG	Long	195	57.769	5.537
USD	Ricoh Company Limited	Long	400	3.000	72
USD	Rigel Pharmaceuticals Incorporated	Long	16.407	21.657	(1.477)
USD	Rightmove plc	Long	2.979	20.736	713
USD	RingCentral Incorporated	Long	202	6.195	493
USD	RioCan Real Estate Investment Trust	Long	600	9.052	180
USD	Robert Half International Incorporated	Long	53	4.270	273
USD	Rocket Companies Incorporated	Long	1.568	14.206	1.051
USD	Root Incorporated	Long	1.627	7.338	1.383
USD	Royalty Pharma plc	Long	339	12.214	220
USD	RPM International Incorporated	Long	36	3.141	71
USD	Ruth's Hospitality Group Incorporated	Long	862	14.154	(129)
USD	S&T Bancorp Incorporated	Long	389	12.234	(389)
USD	Safety Insurance Group Incorporated	Long	387	28.839	178
USD	Sage Group plc	Long	11.469	110.062	7.103
USD	SanBio Company Limited	Long	2.900	15.043	(400)
USD	Sangamo Therapeutics Incorporated	Long	1.496	2.633	(254)
USD	Sankyo Company Limited	Long	200	8.350	385
USD	Sapporo Holdings Limited	Long	200	5.140	73
USD	Saras SpA	Long	22.238	34.554	993
USD	Schneider National Incorporated	Long	716	19.153	601
USD	Scholastic Corporation	Long	491	16.802	(4.345)
USD	Scout24 SE	Long	575	34.200	2.386
USD	SCSK Corporation	Long	1.500	21.963	(66)
USD	Sealed Air Corporation	Long	345	15.839	421

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Währung	Wertpapier	Long/Short	Aktien	Marktwert USD	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/ (-minderung)
Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)					
USD	SEI Investments Company	Long	1.280	73.664	2.560
USD	Selectquote Incorporated	Long	22.272	48.330	13.140
USD	Sembcorp Industries Limited	Long	8.800	29.040	2.800
USD	Sembcorp Marine Limited	Long	131.686	11.819	1.511
USD	Serco Group plc	Long	5.769	10.917	286
USD	Shenandoah Telecommunications Company	Long	188	3.576	(64)
USD	Shibaura Machine Company Limited	Long	1.500	35.832	2.675
USD	Shyft Group Incorporated	Long	97	2.207	29
USD	SI-BONE Incorporated	Long	647	12.726	168
USD	Sims Limited	Long	548	5.715	402
USD	Sinclair Broadcast Group Incorporated	Long	1.489	25.551	5.807
USD	Sino Land Company Limited	Long	44.000	59.502	2.540
USD	Sirius XM Holdings Incorporated	Long	5.608	22.264	1.458
USD	SMA Solar Technology AG	Long	129	13.893	4.000
USD	Smith & Wesson Brands Incorporated	Long	2.265	27.882	2.424
USD	Snap-on Incorporated	Long	83	20.492	814
USD	Sodexo SA	Long	188	18.362	1.242
USD	Sonova Holding AG	Long	114	33.629	3.694
USD	South32 Limited	Long	2.274	6.664	548
USD	Southside Bancshares Incorporated	Long	198	6.574	(184)
USD	Spark New Zealand Limited	Long	13.783	43.667	1.428
USD	SpartanNash Company	Long	1.538	38.142	308
USD	Square Enix Holdings Company Limited	Long	500	24.028	285
USD	St Barbara Limited	Long	42.473	18.973	217
USD	Standard Chartered plc	Long	688	5.214	27
USD	Standex International Corporation	Long	51	6.244	425
USD	Steelcase Incorporated	Long	2.241	18.869	2.824
USD	StoneX Group Incorporated	Long	393	40.687	3.431
USD	Stride Incorporated	Long	169	6.633	96
USD	Subaru Corporation	Long	300	4.789	223
USD	Sumitomo Corporation	Long	1.200	21.258	996
USD	SunCoke Energy Incorporated	Long	2.457	22.064	835
USD	Supernus Pharmaceuticals Incorporated	Long	111	4.022	72
USD	Swatch Group AG	Long	144	9.131	427
USD	Swatch Group AG	Long	40	13.776	669
USD	Swedish Orphan Biovitrum AB	Long	301	7.013	30
USD	Swire Pacific Limited	Long	1.500	11.527	50
USD	Swiss Re AG	Long	201	20.649	1.282
USD	Sylvamo Corporation	Long	352	16.284	341
USD	Synopsys Incorporated	Long	10	3.863	107
USD	Tabcorp Holdings Limited	Long	38.338	25.562	551
USD	TaskUS Incorporated	Long	212	3.061	51
USD	Technology One Limited	Long	866	8.510	346

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Währung	Wertpapier	Long/Short	Aktien	Marktwert USD	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/ (-minderung)
Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)					
USD	Teladoc Health Incorporated	Long	808	20.927	1.228
USD	Tele2 AB	Long	6.904	68.716	2.056
USD	Teleflex Incorporated	Long	59	14.945	943
USD	Tennant Company	Long	149	10.211	478
USD	Teradyne Incorporated	Long	342	36.768	345
USD	Theravance Biopharma Incorporated	Long	2.347	25.465	962
USD	Thryv Holdings Incorporated	Long	350	8.071	(4)
USD	TIS Incorporated	Long	200	5.289	85
USD	Titan International Incorporated	Long	1.193	12.503	84
USD	Titan Machinery Incorporated	Long	265	8.069	376
USD	Toho Company Limited	Long	1.000	38.339	1.359
USD	Tokyo Steel Manufacturing Company Limited	Long	900	9.295	31
USD	TomTom NV	Long	4.071	33.396	910
USD	Tootsie Roll Industries Incorporated	Long	432	19.401	(69)
USD	Torex Gold Resources Incorporated	Long	1.700	28.289	2.765
USD	Tosoh Corporation	Long	300	4.077	117
USD	TPI Composites Incorporated	Long	2.135	27.862	3.523
USD	Tradeweb Markets Incorporated	Long	481	38.009	1.914
USD	TransMedics Group Incorporated	Long	393	29.762	271
USD	TravelCenters of America Incorporated	Long	36	3.114	76
USD	Trend Micro Incorporated	Long	1.200	58.873	1.434
USD	Tricida Incorporated	Long	1.689	19	(2)
USD	Trigano SA	Long	10	1.303	95
USD	Triumph Group Incorporated	Long	330	3.825	281
USD	TrueBlue Incorporated	Long	1.070	19.046	877
USD	TTM Technologies Incorporated	Long	493	6.651	463
USD	Tullow Oil plc	Long	4.281	1.665	216
USD	Tupperware Brands Corporation	Long	3.654	9.135	658
USD	UACJ Corporation	Long	200	3.999	256
USD	Ubisoft Entertainment SA	Long	1.910	50.908	4.313
USD	Ulta Beauty Incorporated	Long	49	26.738	1.737
USD	Unisys Corporation	Long	1.485	5.762	401
USD	United Arrows Limited	Long	600	8.715	559
USD	United Natural Foods Incorporated	Long	82	2.161	206
USD	Unitil Corporation	Long	401	22.873	561
USD	Upland Software Incorporated	Long	1.174	5.048	59
USD	USS Company Limited	Long	2.100	36.434	990
USD	Valeo	Long	199	4.083	388
USD	Vector Group Limited	Long	235	2.822	9
USD	Venture Corporation Limited	Long	4.700	62.554	4.499
USD	Veradigm Incorporated	Long	1.704	22.237	85
USD	Verint Systems Incorporated	Long	849	31.617	1.172
USD	VeriSign Incorporated	Long	232	49.029	3.051

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Währung	Wertpapier	Long/Short	Aktien	Marktwert USD	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/ (-minderung)
Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)					
USD	Veritiv Corporation	Long	70	9.460	988
USD	Vertex Pharmaceuticals Incorporated	Long	56	17.644	903
USD	Vital Farms Incorporated	Long	673	10.297	821
USD	Vodafone Group plc	Long	11.940	13.171	(366)
USD	voestalpine AG	Long	607	20.640	145
USD	Volvo AB	Long	352	7.571	551
USD	W R Berkley Corporation	Long	87	5.417	50
USD	Wabash National Corporation	Long	1.148	28.229	804
USD	Warrior Met Coal Incorporated	Long	208	7.636	674
USD	Waters Corporation	Long	145	44.896	1.322
USD	Wayfair Incorporated	Long	1.383	47.492	4.121
USD	Weis Markets Incorporated	Long	264	22.353	544
USD	Wendel SE	Long	578	61.118	1.891
USD	West Pharmaceutical Services Incorporated	Long	47	16.284	682
USD	Western Union Company	Long	5.557	61.961	500
USD	Westshore Terminals Investment Corporation	Long	600	12.004	422
USD	WideOpenWest Incorporated	Long	621	6.601	584
USD	Workhorse Group Incorporated	Long	6.912	9.193	(346)
USD	World Wrestling Entertainment Incorporated	Long	147	13.415	951
USD	WW Grainger Incorporated	Long	81	55.794	1.209
USD	Yamaha Motor Company Limited	Long	600	15.702	1.434
USD	Yamato Kogyo Company Limited	Long	400	16.170	58
USD	Yangzijiang Financial Holding Limited	Long	32.900	9.325	496
USD	Yara International ASA	Long	329	14.299	486
USD	Yokogawa Electric Corporation	Long	400	6.513	284
USD	Yum! Brands Incorporated	Long	29	3.830	93
USD	Zeta Global Holdings Corporation	Long	864	9.357	1.115
USD	ZOZO Incorporated	Long	900	20.585	158
USD	3D Systems Corporation	Short	(505)	(5.414)	(470)
USD	A2A SpA	Short	(15.214)	(24.279)	(584)
USD	ABC-Mart Incorporated	Short	(400)	(22.135)	(896)
USD	Accolade Incorporated	Short	(2.349)	(33.779)	(5.708)
USD	Adevinta ASA	Short	(6.109)	(43.368)	647
USD	Adidas AG	Short	(72)	(12.764)	(1.831)
USD	Advance Residence Investment Corporation	Short	(8)	(19.101)	(470)
USD	Advanced Micro Devices Incorporated	Short	(425)	(41.654)	(510)
USD	Aeon Company Limited	Short	(2.000)	(38.802)	(835)
USD	Aeon Mall Company Limited	Short	(1.200)	(15.751)	(340)
USD	AerCap Holdings NV	Short	(1.325)	(74.505)	(5.910)
USD	Affirm Holdings Incorporated	Short	(382)	(4.305)	(756)
USD	Agilon Health Incorporated	Short	(224)	(5.320)	706
USD	Agnico Eagle Mines Limited	Short	(500)	(25.490)	(59)
USD	AIA Group Limited	Short	(6.400)	(67.119)	(5.427)

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Währung	Wertpapier	Long/Short	Aktien	Marktwert USD	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/ (-minderung)
Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)					
USD	Air Lease Corporation	Short	(787)	(30.984)	(1.716)
USD	Air Liquide SA	Short	(204)	(34.147)	(1.244)
USD	Airbnb Incorporated	Short	(268)	(33.339)	(1.608)
USD	Alexandria Real Estate Equities Incorporated	Short	(179)	(22.481)	(661)
USD	Alight Incorporated	Short	(2.438)	(22.454)	(1.365)
USD	Allianz SE	Short	(254)	(58.632)	(3.529)
USD	Allkem Limited	Short	(1.205)	(9.653)	(1.518)
USD	Alstom SA	Short	(582)	(15.846)	(1.018)
USD	American Airlines Group Incorporated	Short	(657)	(9.691)	(519)
USD	American Tower Corporation	Short	(69)	(14.099)	(165)
USD	Amyris Incorporated	Short	(902)	(1.227)	(72)
USD	ANA Holdings Incorporated	Short	(300)	(6.520)	(260)
USD	Analog Devices Incorporated	Short	(335)	(66.069)	(3.404)
USD	Anavex Life Sciences Corporation	Short	(640)	(5.485)	442
USD	API Group Corporation	Short	(1.146)	(25.762)	(1.914)
USD	Apollo Global Management Incorporated	Short	(1.291)	(81.540)	(8.198)
USD	AptarGroup Incorporated	Short	(122)	(14.419)	(660)
USD	Aptiv plc	Short	(546)	(61.256)	(1.845)
USD	Ares Management Corporation	Short	(264)	(22.028)	(2.297)
USD	Argenx SE	Short	(41)	(15.226)	(429)
USD	Aristocrat Leisure Limited	Short	(270)	(6.751)	(516)
USD	Arthur J Gallagher & Company	Short	(22)	(4.209)	(195)
USD	Arvinas Incorporated	Short	(711)	(19.425)	2.247
USD	Asahi Kasei Corporation	Short	(500)	(3.502)	(98)
USD	Ashtead Group plc	Short	(502)	(30.825)	(876)
USD	ASML Holding NV	Short	(32)	(21.806)	(1.220)
USD	Aspen Technology Incorporated	Short	(78)	(17.852)	(2.349)
USD	AstraZeneca plc	Short	(350)	(48.494)	(2.192)
USD	Atlas Copco AB	Short	(1.454)	(18.420)	(1.125)
USD	Avanza Bank Holding AB	Short	(127)	(2.979)	24
USD	AvidXchange Holdings Incorporated	Short	(1.071)	(8.354)	(439)
USD	Avis Budget Group Incorporated	Short	(35)	(6.818)	(689)
USD	AVZ Minerals Limited	Short	(4.792)	(2.499)	2
USD	Axon Enterprise Incorporated	Short	(236)	(53.065)	(2.627)
USD	Azenta Incorporated	Short	(377)	(16.822)	(1.738)
USD	Azrieli Group Limited	Short	(422)	(24.247)	476
USD	Ballard Power Systems Incorporated	Short	(500)	(2.789)	(253)
USD	Banca Mediolanum SpA	Short	(2.454)	(22.214)	(755)
USD	Bank of America Corporation	Short	(348)	(9.953)	(296)
USD	Bank of Kyoto Limited	Short	(400)	(18.920)	(593)
USD	BCE Incorporated	Short	(100)	(4.479)	(32)
USD	Beam Therapeutics Incorporated	Short	(523)	(16.014)	842
USD	Beauty Health Company	Short	(2.944)	(37.183)	(3.621)

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Währung	Wertpapier	Long/Short	Aktien	Marktwert USD	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/(-minderung)
Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)					
USD	Beijer Ref AB	Short	(220)	(3.851)	(302)
USD	Beijer Ref AB	Short	(660)	(11.581)	(939)
USD	Berkshire Hathaway Incorporated	Short	(67)	(20.688)	(517)
USD	BigCommerce Holdings Incorporated	Short	(1.178)	(10.531)	(601)
USD	BILL Holdings Incorporated	Short	(269)	(21.827)	(2.055)
USD	Blackline Incorporated	Short	(98)	(6.581)	(332)
USD	Block Incorporated	Short	(921)	(63.227)	5.388
USD	Blue Owl Capital Incorporated	Short	(966)	(10.703)	(802)
USD	BP plc	Short	(3.272)	(20.681)	(1.144)
USD	Brunswick Corporation	Short	(112)	(9.184)	(489)
USD	Builders FirstSource Incorporated	Short	(33)	(2.930)	(223)
USD	Cactus Incorporated	Short	(51)	(2.103)	(191)
USD	Cadence Bank	Short	(714)	(14.823)	143
USD	CAE Incorporated	Short	(1.400)	(31.657)	(2.776)
USD	Caesars Entertainment Incorporated	Short	(562)	(27.431)	(3.001)
USD	Calix Incorporated	Short	(41)	(2.197)	(73)
USD	Canadian Pacific Railway Limited	Short	(100)	(7.700)	45
USD	Capital One Financial Corporation	Short	(242)	(23.271)	(1.433)
USD	Carnival Corporation	Short	(937)	(9.511)	(1.443)
USD	carsales.com Limited	Short	(47)	(53)	(3)
USD	carsales.com Limited	Short	(664)	(9.924)	(336)
USD	Carvana Company	Short	(798)	(7.812)	(2.171)
USD	Celldex Therapeutics Incorporated	Short	(676)	(24.322)	3.840
USD	Cellnex Telecom SA	Short	(2.660)	(103.441)	(6.902)
USD	Celsius Holdings Incorporated	Short	(29)	(2.695)	(265)
USD	Central Japan Railway Company	Short	(400)	(47.728)	(955)
USD	Cerevel Therapeutics Holdings Incorporated	Short	(728)	(17.756)	102
USD	Ceridian HCM Holding Incorporated	Short	(55)	(4.027)	(270)
USD	ChargePoint Holdings Incorporated	Short	(1.095)	(11.465)	(1.325)
USD	Chesapeake Energy Corporation	Short	(62)	(4.714)	(143)
USD	Choice Hotels International Incorporated	Short	(64)	(7.500)	25
USD	Chugai Pharmaceutical Company Limited	Short	(800)	(19.754)	339
USD	Ciena Corporation	Short	(50)	(2.626)	(116)
USD	Civitas Resources Incorporated	Short	(266)	(18.178)	(1.306)
USD	Clarivate plc	Short	(4.380)	(41.128)	1.358
USD	Clear Secure Incorporated	Short	(146)	(3.821)	(388)
USD	Coca-Cola Europacific Partners plc	Short	(181)	(10.713)	(554)
USD	Coherent Corporation	Short	(336)	(12.795)	(1.052)
USD	Coinbase Global Incorporated	Short	(410)	(27.704)	3.104
USD	Comcast Corporation	Short	(577)	(21.874)	(854)
USD	Comerica Incorporated	Short	(28)	(1.216)	32
USD	Comfortia Residential REIT Incorporated	Short	(2)	(4.758)	(146)
USD	Core Lithium Limited	Short	(11.720)	(6.841)	(489)

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Währung	Wertpapier	Long/Short	Aktien	Marktwert USD	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/ (-minderung)
Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)					
USD	Corporate Travel Management Limited	Short	(262)	(3.197)	(241)
USD	Coursera Incorporated	Short	(310)	(3.571)	(183)
USD	CRISPR Therapeutics AG	Short	(110)	(4.975)	(85)
USD	Crocs Incorporated	Short	(263)	(33.254)	(2.065)
USD	CSL Limited	Short	(143)	(27.695)	(435)
USD	CTS Eventim AG & Company KGaA	Short	(98)	(6.127)	8
USD	CubeSmart	Short	(270)	(12.479)	235
USD	Cullen/Frost Bankers Incorporated	Short	(100)	(10.534)	(61)
USD	Daikin Industries Limited	Short	(400)	(71.763)	(4.326)
USD	Daio Paper Corporation	Short	(3.800)	(29.719)	(1.038)
USD	Daiwa House Industry Company Limited	Short	(200)	(4.712)	(106)
USD	Darling Ingredients Incorporated	Short	(208)	(12.147)	(822)
USD	DCM Holdings Company Limited	Short	(400)	(3.486)	(66)
USD	De Grey Mining Limited	Short	(18.395)	(19.059)	326
USD	Deliveroo plc	Short	(13.165)	(14.860)	(562)
USD	Denso Corporation	Short	(100)	(5.645)	(378)
USD	Deutsche Post AG	Short	(286)	(13.395)	(768)
USD	Diageo plc	Short	(371)	(16.558)	(544)
USD	DIC Corporation	Short	(200)	(3.603)	(174)
USD	DICE Therapeutics Incorporated	Short	(513)	(14.697)	(1.206)
USD	DigitalOcean Holdings Incorporated	Short	(486)	(19.037)	(2.168)
USD	Dometic Group AB	Short	(937)	(5.722)	(725)
USD	DraftKings Incorporated	Short	(1.585)	(30.686)	(3.376)
USD	Driven Brands Holdings Incorporated	Short	(198)	(6.001)	(461)
USD	DS Smith plc	Short	(5.488)	(21.367)	(757)
USD	DSV A/S	Short	(109)	(21.135)	(1.418)
USD	Dun & Bradstreet Holdings Incorporated	Short	(486)	(5.706)	(496)
USD	Duolingo Incorporated	Short	(113)	(16.113)	(1.488)
USD	E2open Parent Holdings Incorporated	Short	(3.769)	(21.936)	(1.545)
USD	East Japan Railway Company	Short	(400)	(22.137)	(160)
USD	East West Bancorp Incorporated	Short	(235)	(13.043)	(160)
USD	easyJet plc	Short	(1.099)	(7.024)	(691)
USD	Ecolab Incorporated	Short	(300)	(49.659)	(2.772)
USD	Elastic NV	Short	(171)	(9.901)	(467)
USD	Embracer Group AB	Short	(2.985)	(13.940)	761
USD	Enbridge Incorporated	Short	(1.600)	(61.005)	(1.574)
USD	Endeavour Mining plc	Short	(100)	(2.410)	(169)
USD	Enel SpA	Short	(7.109)	(43.357)	(2.302)
USD	Enstar Group Limited	Short	(78)	(18.080)	(701)
USD	EQRx Incorporated	Short	(5.465)	(10.602)	(437)
USD	Erasca Incorporated	Short	(664)	(1.999)	20
USD	ESS Tech Incorporated	Short	(5.641)	(7.841)	(2.087)
USD	Essential Properties Realty Trust Incorporated	Short	(254)	(6.312)	(20)

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Währung	Wertpapier	Long/Short	Aktien	Marktwert USD	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/ (-minderung)
Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)					
USD	EssilorLuxottica SA	Short	(85)	(15.327)	(536)
USD	Euglena Company Limited	Short	(2.300)	(16.347)	(749)
USD	Euronext NV	Short	(673)	(51.535)	(2.757)
USD	Exact Sciences Corporation	Short	(851)	(57.706)	(3.719)
USD	Expro Group Holdings NV	Short	(141)	(2.589)	(38)
USD	FANUC Corporation	Short	(500)	(18.056)	(780)
USD	Fastly Incorporated	Short	(224)	(3.978)	(544)
USD	Fielmann AG	Short	(232)	(9.677)	(88)
USD	First Financial Bankshares Incorporated	Short	(501)	(15.982)	(115)
USD	First Interstate BancSystem Incorporated	Short	(78)	(2.329)	62
USD	First Majestic Silver Corporation	Short	(500)	(3.607)	119
USD	First Solar Incorporated	Short	(23)	(5.003)	(295)
USD	Fisker Incorporated	Short	(3.670)	(22.534)	(1.541)
USD	Five Below Incorporated	Short	(231)	(47.579)	(1.587)
USD	Fiverr International Limited	Short	(576)	(20.114)	(1.181)
USD	Floor & Decor Holdings Incorporated	Short	(496)	(48.717)	(2.872)
USD	Fluidra SA	Short	(242)	(4.265)	(141)
USD	Food & Life Companies Limited	Short	(300)	(7.829)	22
USD	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	Short	(206)	(10.384)	(537)
USD	Freee KK	Short	(500)	(12.882)	1.208
USD	Freeport-McMoRan Incorporated	Short	(443)	(18.123)	(1.533)
USD	Fresenius SE & Company KGaA	Short	(220)	(5.941)	(326)
USD	Freshpet Incorporated	Short	(309)	(20.453)	(2.206)
USD	Freshworks Incorporated	Short	(922)	(14.162)	(1.706)
USD	FREYR Battery SA	Short	(1.482)	(13.175)	(2.712)
USD	FUJIFILM Holdings Corporation	Short	(1.300)	(65.992)	(2.475)
USD	Future plc	Short	(608)	(8.739)	(464)
USD	Garmin Limited	Short	(675)	(68.121)	(2.768)
USD	Gevo Incorporated	Short	(9.986)	(15.378)	1.098
USD	GFL Environmental Incorporated	Short	(600)	(20.688)	(751)
USD	Ginkgo Bioworks Holdings Incorporated	Short	(10.041)	(13.355)	(904)
USD	Gitlab Incorporated	Short	(450)	(15.431)	882
USD	Givaudan SA	Short	(2)	(6.510)	(95)
USD	Glacier Bancorp Incorporated	Short	(496)	(20.837)	(104)
USD	GLP J-Reit	Short	(8)	(8.647)	61
USD	Grab Holdings Limited	Short	(17.057)	(51.342)	(3.753)
USD	Graco Incorporated	Short	(374)	(27.306)	(1.526)
USD	Great-West Lifeco Incorporated	Short	(2.000)	(53.008)	(2.423)
USD	Groupe Bruxelles Lambert NV	Short	(432)	(36.867)	(2.167)
USD	Guardant Health Incorporated	Short	(103)	(2.414)	259
USD	Halliburton Company	Short	(613)	(19.395)	(582)
USD	Harbour Energy plc	Short	(639)	(2.165)	(233)
USD	HealthEquity Incorporated	Short	(50)	(2.936)	(102)

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Währung	Wertpapier	Long/Short	Aktien	Marktwert USD	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/ (-minderung)
Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)					
USD	Herc Holdings Incorporated	Short	(169)	(19.249)	(987)
USD	Hexagon AB	Short	(6.327)	(72.820)	(3.752)
USD	Hilton Grand Vacations Incorporated	Short	(603)	(26.791)	(718)
USD	Hitachi Limited	Short	(200)	(10.992)	(701)
USD	Hong Kong & China Gas Company Limited	Short	(85.000)	(74.835)	2.064
USD	Hong Kong Exchanges & Clearing Limited	Short	(600)	(26.595)	(1.564)
USD	Howden Joinery Group plc	Short	(357)	(3.083)	(125)
USD	ICADE	Short	(178)	(8.381)	109
USD	ICU Medical Incorporated	Short	(97)	(16.001)	(335)
USD	Illumina Incorporated	Short	(247)	(57.440)	(3.157)
USD	ImmunityBio Incorporated	Short	(5.998)	(10.916)	(2.819)
USD	Industria de Diseno Textil SA	Short	(857)	(28.791)	(2.603)
USD	InPost SA	Short	(2.718)	(24.857)	(2.862)
USD	Intel Corporation	Short	(424)	(13.852)	(1.488)
USD	Intellia Therapeutics Incorporated	Short	(658)	(24.524)	658
USD	Interactive Brokers Group Incorporated	Short	(56)	(4.623)	(220)
USD	International Flavors & Fragrances Incorporated	Short	(650)	(59.774)	(5.252)
USD	Intuitive Surgical Incorporated	Short	(176)	(44.963)	(2.635)
USD	Investor AB	Short	(198)	(4.040)	(222)
USD	Investor AB	Short	(783)	(15.598)	(930)
USD	loneer Limited	Short	(23.560)	(4.610)	(117)
USD	Ivanhoe Mines Limited	Short	(7.300)	(65.951)	(4.228)
USD	IVERIC bio Incorporated	Short	(849)	(20.656)	(441)
USD	Japan Post Holdings Company Limited	Short	(500)	(4.058)	50
USD	Japan Tobacco Incorporated	Short	(500)	(10.562)	(308)
USD	JD Sports Fashion plc	Short	(15.190)	(33.452)	(2.844)
USD	JPMorgan Chase & Company	Short	(452)	(58.900)	(1.433)
USD	Keyence Corporation	Short	(100)	(49.011)	(3.307)
USD	Kinden Corporation	Short	(3.000)	(36.153)	(1.062)
USD	Kite Realty Group Trust	Short	(1.741)	(36.422)	(2.281)
USD	KKR & Company Incorporated	Short	(271)	(14.233)	(1.062)
USD	Kone OYJ	Short	(368)	(19.193)	(567)
USD	Koninklijke Vopak NV	Short	(712)	(25.138)	(1.030)
USD	Kuehne + Nagel International AG	Short	(73)	(21.742)	(1.857)
USD	Kusuri no Aoki Holdings Company Limited	Short	(200)	(10.144)	(176)
USD	Kyowa Exeo Corporation	Short	(1.300)	(23.531)	(31)
USD	Kyowa Kirin Company Limited	Short	(300)	(6.549)	(146)
USD	LaSalle Logiport REIT	Short	(15)	(17.407)	(77)
USD	Lawson Incorporated	Short	(600)	(25.403)	(962)
USD	Legal & General Group plc	Short	(6.945)	(20.541)	(914)
USD	Leo Lithium Limited	Short	(60.970)	(21.379)	(3.021)
USD	Liberty Latin America Limited	Short	(441)	(3.643)	(212)
USD	Light & Wonder Incorporated	Short	(345)	(20.717)	(604)

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Währung	Wertpapier	Long/Short	Aktien	Marktwert USD	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/ (-minderung)
Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)					
USD	Lightspeed Commerce Incorporated	Short	(700)	(10.644)	(390)
USD	Lightwave Logic Incorporated	Short	(1.103)	(5.769)	(1.081)
USD	Liontown Resources Limited	Short	(20.500)	(35.819)	(15.313)
USD	Lithia Motors Incorporated	Short	(31)	(7.097)	(551)
USD	Lithium Americas Corporation	Short	(1.500)	(32.630)	(2.038)
USD	Littelfuse Incorporated	Short	(10)	(2.681)	(110)
USD	Lucid Group Incorporated	Short	(3.356)	(26.982)	(1.141)
USD	Luminar Technologies Incorporated	Short	(1.831)	(11.883)	2.399
USD	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	Short	(57)	(52.321)	(3.170)
USD	Macquarie Group Limited	Short	(31)	(3.670)	(190)
USD	Magnite Incorporated	Short	(1.896)	(17.557)	(360)
USD	Makita Corporation	Short	(2.000)	(49.810)	(807)
USD	Mapletree Industrial Trust	Short	(12.905)	(23.041)	(626)
USD	Marqeta Incorporated	Short	(2.181)	(9.967)	(1.265)
USD	Martin Marietta Materials Incorporated	Short	(10)	(3.551)	(302)
USD	Marvell Technology Incorporated	Short	(699)	(30.267)	(2.062)
USD	MasTec Incorporated	Short	(84)	(7.933)	(513)
USD	Matsui Securities Company Limited	Short	(6.900)	(40.790)	(17)
USD	Maximus Incorporated	Short	(46)	(3.620)	(93)
USD	MDU Resources Group Incorporated	Short	(105)	(3.200)	(93)
USD	Mercari Incorporated	Short	(1.400)	(24.677)	(580)
USD	MicroVision Incorporated	Short	(4.507)	(12.034)	(2.434)
USD	Middleby Corporation	Short	(104)	(15.247)	(1.049)
USD	Mister Car Wash Incorporated	Short	(557)	(4.801)	89
USD	Mitsubishi Estate Logistics REIT Investment Corporation	Short	„1.	(2.947)	(3)
USD	Money Forward Incorporated	Short	(300)	(10.498)	380
USD	MongoDB Incorporated	Short	(11)	(2.564)	(244)
USD	MP Materials Corporation	Short	(68)	(1.917)	(82)
USD	MSA Safety Incorporated	Short	(230)	(30.705)	(347)
USD	Murata Manufacturing Company Limited	Short	(200)	(12.189)	(548)
USD	Nabtesco Corporation	Short	(100)	(2.460)	(93)
USD	Nano Dimension Limited	Short	(3.059)	(8.841)	(979)
USD	Nano-X Imaging Limited	Short	(492)	(2.839)	335
USD	Natera Incorporated	Short	(47)	(2.609)	35
USD	National Grid plc	Short	(804)	(10.876)	(486)
USD	nCino Incorporated	Short	(834)	(20.667)	(1.985)
USD	Neste OYJ	Short	(584)	(28.852)	(2.537)
USD	Nestlé SA	Short	(433)	(52.796)	(1.868)
USD	New Fortress Energy Incorporated	Short	(621)	(18.276)	(1.230)
USD	NexGen Energy Limited	Short	(5.400)	(20.737)	(734)
USD	Nexi SpA	Short	(7.450)	(60.547)	(3.932)
USD	NextEra Energy Incorporated	Short	(483)	(37.230)	(536)
USD	Nippon Building Fund Incorporated	Short	(10)	(41.625)	(56)

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Währung	Wertpapier	Long/Short	Aktien	Marktwert USD	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/ (-minderung)
Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)					
USD	Nippon Paper Industries Company Limited	Short	(2.000)	(15.450)	(340)
USD	Nitori Holdings Company Limited	Short	(500)	(60.381)	1.423
USD	NOF Corporation	Short	(400)	(18.692)	(851)
USD	Nordnet AB	Short	(277)	(4.567)	(215)
USD	Northern Star Resources Limited	Short	(2.755)	(22.591)	(803)
USD	Norwegian Cruise Line Holdings Limited	Short	(2.487)	(33.450)	(2.686)
USD	Novanta Incorporated	Short	(72)	(11.454)	(598)
USD	Novonix Limited	Short	(4.190)	(3.600)	(124)
USD	NVIDIA Corporation	Short	(240)	(66.665)	(4.505)
USD	Ocado Group plc	Short	(1.847)	(12.230)	(2.778)
USD	Oesterreichische Post AG	Short	(77)	(2.851)	(98)
USD	Okta Incorporated	Short	(546)	(47.087)	(1.092)
USD	Old National Bancorp	Short	(618)	(8.912)	241
USD	Olo Incorporated	Short	(474)	(3.868)	(318)
USD	OneMain Holdings Incorporated	Short	(422)	(15.648)	(1.097)
USD	Opendoor Technologies Incorporated	Short	(2.762)	(4.861)	(856)
USD	Orix JREIT Incorporated	Short	(5)	(6.340)	(17)
USD	Orsted AS	Short	(225)	(19.185)	(1.088)
USD	Osisko Gold Royalties Limited	Short	(500)	(7.902)	(483)
USD	Pacific Biosciences of California Incorporated	Short	(847)	(9.808)	(2.727)
USD	Panasonic Holdings Corporation	Short	(2.300)	(20.578)	(654)
USD	PAR Technology Corporation	Short	(386)	(13.109)	(1.007)
USD	Paycor HCM Incorporated	Short	(160)	(4.243)	(482)
USD	Paylocity Holding Corporation	Short	(132)	(26.239)	(2.805)
USD	PayPal Holdings Incorporated	Short	(243)	(18.453)	(663)
USD	Penn Entertainment Incorporated	Short	(1.048)	(31.084)	(1.834)
USD	Penumbra Incorporated	Short	(84)	(23.410)	(1.052)
USD	Performance Food Group Company	Short	(45)	(2.715)	(230)
USD	Pernod Ricard SA	Short	(16)	(3.623)	(183)
USD	Phoenix Group Holdings plc	Short	(9.044)	(61.105)	1.012
USD	Piedmont Lithium Incorporated	Short	(157)	(9.428)	(1.314)
USD	Pilbara Minerals Limited	Short	(595)	(1.583)	(198)
USD	Pinnacle Financial Partners Incorporated	Short	(120)	(6.619)	(122)
USD	Planet Fitness Incorporated	Short	(347)	(26.951)	(1.090)
USD	Planet Labs PBC	Short	(1.278)	(5.023)	(601)
USD	Plug Power Incorporated	Short	(2.129)	(24.952)	(1.874)
USD	PNC Financial Services Group Incorporated	Short	(19)	(2.415)	5
USD	Porch Group Incorporated	Short	(2.438)	(3.486)	(731)
USD	Power Corporation of Canada	Short	(800)	(20.445)	(282)
USD	Procore Technologies Incorporated	Short	(307)	(19.227)	(697)
USD	Pure Storage Incorporated	Short	(72)	(1.837)	(86)
USD	PureCycle Technologies Incorporated	Short	(396)	(2.772)	(546)
USD	QuidelOrtho Corporation	Short	(46)	(4.098)	(150)

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Währung	Wertpapier	Long/Short	Aktien	Marktwert USD	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/ (-minderung)
Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)					
USD	R1 RCM Incorporated	Short	(1.175)	(17.625)	(1.586)
USD	RBC Bearings Incorporated	Short	(174)	(40.495)	(3.468)
USD	Realty Income Corporation	Short	(1.225)	(77.567)	(1.654)
USD	Relay Therapeutics Incorporated	Short	(371)	(6.110)	(312)
USD	Rexford Industrial Realty Incorporated	Short	(333)	(19.863)	(656)
USD	RH	Short	(164)	(39.942)	833
USD	Rivian Automotive Incorporated	Short	(1.882)	(29.133)	(4.630)
USD	Rolls-Royce Holdings plc	Short	(42.926)	(79.064)	(4.867)
USD	Royal Caribbean Cruises Limited	Short	(306)	(19.982)	(1.209)
USD	Royal Unibrew A/S	Short	(257)	(22.403)	(1.425)
USD	RWE AG	Short	(83)	(3.571)	(157)
USD	S&P Global Incorporated	Short	(161)	(55.508)	(1.639)
USD	Safran SA	Short	(522)	(77.275)	(4.327)
USD	Salesforce Incorporated	Short	(493)	(98.492)	(7.163)
USD	Santos Limited	Short	(6.437)	(29.626)	(597)
USD	SBM Offshore NV	Short	(735)	(10.913)	(774)
USD	Schibsted ASA	Short	(1.079)	(18.316)	2.934
USD	Schibsted ASA	Short	(1.325)	(21.298)	3.047
USD	ServiceNow Incorporated	Short	(95)	(44.148)	(2.809)
USD	Seven & I Holdings Company Limited	Short	(700)	(31.622)	(978)
USD	Seven Group Holdings Limited	Short	(1.989)	(30.897)	(740)
USD	Shin-Etsu Chemical Company Limited	Short	(1.000)	(32.461)	(2.270)
USD	Shopify Incorporated	Short	(1.600)	(76.715)	(6.520)
USD	Siemens AG	Short	(234)	(37.909)	(3.091)
USD	Siemens Healthineers AG	Short	(199)	(11.473)	(659)
USD	Silicon Laboratories Incorporated	Short	(127)	(22.236)	34
USD	SiteOne Landscape Supply Incorporated	Short	(115)	(15.740)	(434)
USD	Snowflake Incorporated	Short	(245)	(37.801)	(4.611)
USD	SoFi Technologies Incorporated	Short	(5.999)	(36.414)	(5.099)
USD	SoftBank Corporation	Short	(3.700)	(42.712)	413
USD	SoftBank Group Corporation	Short	(1.300)	(51.108)	(3.270)
USD	Softwareone Holding AG	Short	(1.964)	(28.017)	(759)
USD	Sohgo Security Services Company Limited	Short	(400)	(10.773)	(2)
USD	SOITEC	Short	(76)	(12.196)	(877)
USD	Solid Power Incorporated	Short	(4.238)	(12.756)	(1.399)
USD	Sony Group Corporation	Short	(1.100)	(100.192)	(3.733)
USD	Southwestern Energy Company	Short	(1.303)	(6.515)	(169)
USD	Spirit Realty Capital Incorporated	Short	(70)	(2.789)	(43)
USD	St James's Place plc	Short	(209)	(3.136)	(173)
USD	STAG Industrial Incorporated	Short	(508)	(17.181)	(584)
USD	Stanley Black & Decker Incorporated	Short	(886)	(71.394)	(1.719)
USD	Stifel Financial Corporation	Short	(203)	(11.995)	(487)
USD	Sugi Holdings Company Limited	Short	(600)	(25.790)	(667)

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Währung	Wertpapier	Long/Short	Aktien	Marktwert USD	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/ (-minderung)
Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)					
USD	Sumitomo Realty & Development Company Limited	Short	(300)	(6.774)	(84)
USD	Sun Communities Incorporated	Short	(63)	(8.875)	(315)
USD	Sun Life Financial Incorporated	Short	(100)	(4.672)	(165)
USD	Sunnova Energy International Incorporated	Short	(614)	(9.591)	(1.799)
USD	Sunrun Incorporated	Short	(595)	(11.989)	(1.856)
USD	Taiyo Yuden Company Limited	Short	(400)	(13.487)	(971)
USD	TBS Holdings Incorporated	Short	(1.500)	(21.598)	(809)
USD	TC Energy Corporation	Short	(900)	(35.008)	(965)
USD	TD SYNEX Corporation	Short	(84)	(8.130)	(463)
USD	Teledyne Technologies Incorporated	Short	(108)	(48.315)	(3.144)
USD	Tellurian Incorporated	Short	(6.209)	(7.637)	(435)
USD	Tempur Sealy International Incorporated	Short	(394)	(15.559)	(950)
USD	Tesla Incorporated	Short	(94)	(19.501)	(2.276)
USD	TFS Financial Corporation	Short	(2.867)	(36.210)	229
USD	Topgolf Callaway Brands Corporation	Short	(1.687)	(36.473)	(1.097)
USD	Toyota Industries Corporation	Short	(1.400)	(77.996)	(5.037)
USD	Toyota Motor Corporation	Short	(3.600)	(51.247)	(2.994)
USD	TransUnion	Short	(234)	(14.541)	(847)
USD	Transurban Group	Short	(6.351)	(60.642)	(682)
USD	Tsuruha Holdings Incorporated	Short	(200)	(13.377)	(694)
USD	TuSimple Holdings Incorporated	Short	(3.930)	(5.777)	(157)
USD	Twilio Incorporated	Short	(741)	(49.373)	(3.001)
USD	Uber Technologies Incorporated	Short	(627)	(19.876)	144
USD	United Rentals Incorporated	Short	(15)	(5.936)	(260)
USD	UnitedHealth Group Incorporated	Short	(53)	(25.047)	232
USD	Upstart Holdings Incorporated	Short	(649)	(10.313)	(1.116)
USD	Upwork Incorporated	Short	(1.878)	(21.259)	(2.066)
USD	Uranium Energy Corporation	Short	(515)	(1.483)	191
USD	Valley National Bancorp	Short	(327)	(3.021)	114
USD	Verizon Communications Incorporated	Short	(808)	(31.423)	(1.180)
USD	Verve Therapeutics Incorporated	Short	(411)	(5.927)	793
USD	Vinci SA	Short	(496)	(56.863)	(1.168)
USD	Virgin Galactic Holdings Incorporated	Short	(6.850)	(27.743)	343
USD	Vonovia SE	Short	(1.039)	(19.569)	1.596
USD	Vontier Corporation	Short	(137)	(3.746)	(227)
USD	Vulcan Energy Resources Limited	Short	(5.899)	(22.510)	344
USD	Warner Brothers Discovery Incorporated	Short	(2.797)	(42.235)	(2.405)
USD	Washington H Soul Pattinson & Company Limited	Short	(3.348)	(67.853)	(5.868)
USD	Webuild Spa	Short	(91)	0	0
USD	WEX Incorporated	Short	(124)	(22.802)	(1.476)
USD	Whitbread plc	Short	(660)	(24.381)	(1.368)
USD	WillScot Mobile Mini Holdings Corporation	Short	(291)	(13.642)	(201)
USD	Wolfspeed Incorporated	Short	(186)	(12.081)	(497)

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Währung	Wertpapier	Long/Short	Aktien	Marktwert USD	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/ (-minderung)
Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)					
USD	WSFS Financial Corporation	Short	(234)	(8.801)	225
USD	Xero Limited	Short	(111)	(6.732)	(96)
USD	Xometry Incorporated	Short	(231)	(3.458)	(83)
USD	Yamaha Corporation	Short	(400)	(15.450)	(688)
USD	Z Holdings Corporation	Short	(10.400)	(29.489)	(575)
USD	Zenkoku Hosho Company Limited	Short	(600)	(22.641)	1.072
USD	Zions Bancorp NA	Short	(95)	(2.843)	24
					50.819
Global Long/ Short Equity Fund					
USD	Chubu Electric Power Company Incorporated	Long	229.300	2.418.981	(16.296)
USD	Kansai Electric Power Company Incorporated	Long	173.300	1.687.756	20.811
USD	Macnica Fuji Electronics Holdings Incorporated	Long	2.900	82.605	4.221
USD	Mazda Motor Corporation	Long	66.100	609.706	28.485
USD	Mitsubishi Corporation	Long	2.800	100.622	1.433
USD	Mitsubishi Heavy Industries Limited	Long	40.800	1.503.114	75.886
USD	Nippon Steel Corporation	Long	20.000	471.630	9.956
USD	Open House Group Company Limited	Long	17.700	663.752	603
USD	SUMCO Corporation	Long	90.400	1.359.972	39.068
USD	Tokyo Gas Company Limited	Long	124.200	2.334.117	(27.663)
USD	Aegon NV	Short	(303.463)	(1.302.815)	118
USD	Affirm Holdings Incorporated	Short	(17.134)	(193.100)	(21.932)
USD	Alcoa Corporation	Short	(29.980)	(1.275.949)	(69.853)
USD	Alnylam Pharmaceuticals Incorporated	Short	(2.110)	(422.675)	(20.741)
USD	Amplifon SpA	Short	(26.794)	(928.694)	(35.096)
USD	Argenx SE	Short	(2.267)	(841.863)	(19.876)
USD	Ashtead Group plc	Short	(11.011)	(676.130)	2.275
USD	Bachem Holding AG	Short	(10.518)	(1.050.708)	(35.433)
USD	BrainChip Holdings Limited	Short	(2.109.334)	(678.733)	(96.272)
USD	Cameco Corporation	Short	(61.100)	(1.599.947)	(109.964)
USD	Capricorn Energy plc	Short	(70.615)	(203.401)	(485)
USD	Clean Energy Fuels Corporation	Short	(48.457)	(211.273)	(16.475)
USD	Daiichi Sankyo Company Limited	Short	(15.800)	(576.347)	(16.518)
USD	De Grey Mining Limited	Short	(148.738)	(154.110)	(2.846)
USD	Denison Mines Corporation	Short	(53.500)	(58.191)	(5.147)
USD	Eisai Co Limited	Short	(29.300)	(1.664.228)	(53.663)
USD	Energy Fuels Incorporated	Short	(92.200)	(514.383)	(45.885)
USD	Ferrovial SA	Short	(30.207)	(889.518)	7.031
USD	FinecoBank Banca Fineco SpA	Short	(2.550)	(39.069)	(407)
USD	Gevo Incorporated	Short	(90.501)	(139.372)	1.810
USD	HealthEquity Incorporated	Short	(5.288)	(310.458)	(5.447)
USD	Hess Corporation	Short	(7.297)	(965.685)	(85.959)
USD	ITM Power plc	Short	(96.558)	(100.987)	(7.943)

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Währung	Wertpapier	Long/Short	Aktien	Marktwert USD	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/ (-minderung)
Global Long/Short Equity Fund (Fortsetzung)					
USD	Ivanhoe Mines Limited	Short	(94.600)	(854.655)	(73.959)
USD	IWG plc	Short	(169.599)	(344.312)	(29.163)
USD	Kagome Co Limited	Short	(5.900)	(137.595)	(680)
USD	Keyera Corporation	Short	(28.300)	(619.606)	(30.370)
USD	Kinetik Holdings Incorporated	Short	(5.953)	(186.329)	(6.965)
USD	Leo Lithium Limited	Short	(113.729)	(39.878)	(6.559)
USD	Lithium Americas Corporation	Short	(3.800)	(82.664)	(4.264)
USD	Lucid Group Incorporated	Short	(127.595)	(1.025.864)	19.139
USD	Makita Corporation	Short	(5.900)	(146.939)	804
USD	McPhy Energy SA	Short	(1.791)	(25.096)	556
USD	Micron Technology Incorporated	Short	(28.399)	(1.713.596)	28.399
USD	MicroVision Incorporated	Short	(73.140)	(195.284)	(40.958)
USD	NexGen Energy Limited	Short	(145.500)	(558.746)	(30.500)
USD	NextDecade Corporation	Short	(55.239)	(274.538)	(44.744)
USD	Ocado Group plc	Short	(167.545)	(1.109.383)	(185.708)
USD	Occidental Petroleum Corporation	Short	(5.169)	(322.701)	(20.418)
USD	Oriental Land Company Limited	Short	(500)	(17.120)	(252)
USD	Orsted AS	Short	(623)	(53.122)	(1.523)
USD	Pantheon Resources plc	Short	(147.748)	(43.087)	4.613
USD	Petrofac Limited	Short	(69.158)	(67.184)	(21.166)
USD	Plug Power Incorporated	Short	(94.807)	(1.111.138)	(21.806)
USD	PowerCell Sweden AB	Short	(26.755)	(304.374)	(3.461)
USD	Prudential plc	Short	(17.883)	(244.848)	(9.944)
USD	Ramsay Health Care Limited	Short	(11.921)	(532.668)	(21.234)
USD	REC Silicon ASA	Short	(194.819)	(324.778)	(9.295)
USD	Rivian Automotive Incorporated	Short	(78.732)	(1.218.771)	(139.356)
USD	Seagen Incorporated	Short	(3.356)	(679.489)	(14.666)
USD	Senseonics Holdings Incorporated	Short	(88.991)	(63.184)	552
USD	Softwareone Holding AG	Short	(8.876)	(126.621)	(2.670)
USD	Targa Resources Corporation	Short	(6.178)	(450.685)	(37.686)
USD	TC Energy Corporation	Short	(13.900)	(540.676)	(20.828)
USD	Tellurian Incorporated	Short	(301.378)	(370.695)	(74.049)
USD	Trade Desk Incorporated	Short	(18.209)	(1.109.110)	(13.110)
USD	Upstart Holdings Incorporated	Short	(22.904)	(363.945)	(52.908)
USD	Uranium Energy Corporation	Short	(247.539)	(712.912)	(39.606)
USD	Virgin Galactic Holdings Incorporated	Short	(98.980)	(400.869)	(1.980)
USD	Washington H Soul Pattinson & Company Limited	Short	(84.147)	(1.705.388)	(66.972)
USD	Western Digital Corporation	Short	(42.509)	(1.601.314)	(102.022)
USD	Wolfspeed Incorporated	Short	(20.067)	(1.303.352)	(40.134)
					(1.617.095)

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Zum 31. März 2023 verfügten der Alternative Risk Premia Fund und der Global Long/Short Equity Fund über abgesonderte Wertpapiere in Höhe von 2.199.093 USD bzw. 76.361.533 USD als Sicherheiten für offene Differenzkontrakte. Diese Wertpapiere sind im Anlagenspiegel ausgewiesen.

Zum 31. März 2023 hatte der Alternative Risk Premia Fund ausstehende Total Return Swaps:

Währung	Referenzvermögenswert/-index	Zahlungs- häufigkeit	Fälligkeits- datum	USD Nenn- wert	USD-Wert der nicht realisierten Wertsteigerung/ (-minderung)
USD	Goldman Sachs Commodity ARP Strategy Index	1 Monat	01.12.2023	17.600.000	46.805

Zum 31. März 2023 verfügte der Alternative Risk Premia Fund über abgesonderte Barmittel in Höhe von 2.700.000 USD für offene Total-Return-Swap-Kontrakte. Dieser Betrag ist in der Vermögensbilanz als abgesonderte Barsicherheit erfasst.

8. STEUERSTATUS

Der Fonds unterliegt keiner Luxemburger Steuer auf Erträge, Gewinne oder Zugewinne, unterliegt aber in Luxemburg einer jährlichen Zeichnungssteuer (*taxe d'abonnement*), die vierteljährlich berechnet und gezahlt wird.

Alle Teilfonds unterliegen in Luxemburg einer „*taxe d'abonnement*“ zu einem Satz von (i) 0,05 % per annum des Nettovermögens jeder Klasse, die allen Anlegern zur Verfügung steht, und (ii) von 0,01 % per annum des Nettovermögens jeder Klasse, die auf institutionelle Anleger beschränkt ist. Jeder Teilfonds unterliegt Mehrwertsteuern in Bezug auf bestimmte Dienstleistungen, die entsprechend angewendet werden und in den Gebühren eines jeden Teilfonds enthalten sind.

Bei der Ausgabe oder Rücknahme von Anteilen für Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen in Luxemburg fällt in Luxemburg keine Stempel- oder andere Steuer an.

Auf realisierte Kapitalerträge oder nicht realisierte Kapitalzuwächse der Vermögenswerte des Fonds wird in Luxemburg keine Steuer erhoben. Bestimmte Länder können von den Teilfonds eine Kapitalertragssteuer auf nicht realisierte Gewinne aus in diesen Ländern domizilierten Anlagen erheben. Diese Beträge sind in der Vermögensbilanz und in der Aufwands- und Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens als latente Steuerverbindlichkeiten bzw. latente Steueraufwendungen erfasst.

Von den Teilfonds aus ihren Kapitalanlagen erhaltene Dividenden und Zinserträge unterliegen in vielen Fällen einer nichterstattungsfähigen Quellensteuer in ihrem Herkunftsland.

9. AUSSCHÜTTUNGSPOLITIK

Unter normalen Umständen beabsichtigt der Verwaltungsrat nicht, in Bezug auf den Nettoanlageertrag und die realisierten Kapitalerträge (sofern erzielt), die den mit dem Zusatz „thes.“ gekennzeichneten thesaurierenden Klassen zuzurechnen sind, Ausschüttungen zu erklären und vorzunehmen. Dementsprechend wird der Nettoanlageertrag der thesaurierenden Klassen weder erklärt noch ausgeschüttet. Allerdings schlagen sich alle Nettoanlage- oder Kapitalerträge im NIW je Anteil dieser thesaurierenden Klassen nieder.

Unter normalen Umständen beabsichtigt der Verwaltungsrat, zum Ende des Geschäftsjahres oder zu einem (oder mehreren) anderen vom Verwaltungsrat festgelegten Termin(en) mindestens jährlich Ausschüttungen in Bezug auf den Nettoertrag (sofern erzielt), der den ausschüttenden Klassen zuzurechnen ist, sowie in Bezug auf den Bruttoertrag (sofern erzielt), der bestimmten anderen ausschüttenden Klassen zuzurechnen ist, vorzunehmen. In Bezug auf den Global Equity Enhanced Income Fund umfassen die Ausschüttungen der ausschüttenden Klassen die Nettoerträge und gegebenenfalls die realisierten Nettogewinne, um eine angestrebte vierteljährliche Rendite zu zahlen. Ausschüttende Klassen, die Nettoerträge ausschütten, werden mit dem Zusatz „aussch.“ in der Bezeichnung der Anteilklasse versehen, ausschüttende Klassen, die Bruttoerträge ausschütten, werden mit dem Zusatz „brutto aussch.“ in der Bezeichnung der Anteilklasse versehen. Sofern Anteilinhaber nicht ausdrücklich etwas anderes beantragen, wird ein Teilfonds die gesamten Ausschüttungen in weitere Anteile derselben Anteilklasse des Teilfonds, auf die die Ausschüttungen entfallen, reinvestieren und in Zusammenhang mit Ausschüttungen keine Barmittel an Anteilinhaber auszahlen. Informationen über Häufigkeit der Ausschüttungen für jeden Teilfonds sind auf allspringglobal.com erhältlich.

Ausschüttende Anteilsklassen, die Bruttoerträge ausschütten, können dazu führen, dass Anteilinhaber höhere Ausschüttungen erhalten, als sie ansonsten erhalten hätten. Somit können sie einer höheren Einkommensteuerschuld unterliegen. Anteilinhaber sollten sich in dieser Hinsicht an ihren eigenen Steuerberater wenden.

Darüber hinaus kann bezüglich dieser Bruttoerträge ausschüttenden Anteilsklassen die künftige Wertsteigerung des NIW dieser Anteile verringert werden, da die Gebühren und Kosten aus dem Kapital und nicht aus den Erträgen bestritten werden, und unter normalen Umständen liegt der NIW von Anteilsklassen, die Bruttoerträge ausschütten, in der Regel unter dem des NIW von Anteilsklassen, die Nettoerträge ausschütten. Ein geringerer NIW kann zu Performanceabweichungen im Vergleich zwischen Bruttoerträgen und Nettoerträgen ausschüttenden Anteilsklassen führen.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

In Bezug auf den Alternative Risk Premia Fund, den Climate Transition Global Investment Grade Credit Fund und den Global Equity Enhanced Income Fund wenden die Teilfonds eine Rechnungslegungspraxis an, die als Ertragsausgleich bezeichnet wird. Dabei wird ein Teil der Erlöse aus der Zeichnung von Anteilen, dem Umtausch von Anteilen und den Kosten für die Rücknahme von Anteilen, der dem Betrag der nicht ausgeschütteten Nettoanlageerträge und/oder der realisierten Nettogewinne zum Zeitpunkt der Transaktion entspricht, den nicht ausgeschütteten Nettoerträgen und/oder realisierten Nettogewinnen zugeschrieben bzw. belastet. Infolgedessen haben die Ausgabe, der Umtausch und die Rücknahme von Anteilen keine Auswirkungen auf die nicht ausgeschütteten Nettoanlageerträge und/oder die realisierten Nettogewinne je Anteil.

Der Verwaltungsrat kann diese Strategie jederzeit nach Benachrichtigung der Anteilinhaber ändern, ohne dass hierfür die Zustimmung der Anteilinhaber erforderlich ist.

Es erfolgt keine Ausschüttung, die dafür sorgen würde, dass das Nettovermögen des Teilfonds unter den vom Luxemburger Recht vorgeschriebenen Mindestbetrag sinkt.

Dividenden, die nicht innerhalb von fünf Jahren nach ihrem Ausschüttungsdatum angefordert werden, fallen an den betreffenden Teilfonds zurück.

10. SOFT-DOLLAR-VEREINBARUNGEN

Soweit nicht durch geltende Gesetze oder Vorschriften verboten, kann jeder Untieranlageverwalter, wenn zwei oder mehrere Händler in der Lage sind, für Portfoliotransaktionen vergleichbare Ergebnisse anzubieten, demjenigen Händler den Vorzug geben, der ihm statistische oder sonstige Research-Dienste geboten hat. Bei der Auswahl eines Händlers nach derlei Gesichtspunkten wird jeder Untieranlageverwalter abgesehen von den vorstehend aufgeführten Faktoren auch die Qualität des von dem Händler zur Verfügung gestellten Research berücksichtigen. Jeder Untieranlageverwalter kann einem Teilfonds durch die Entgegennahme derartiger Research-Dienste höhere Provisionszahlungen verursachen als unter Umständen von einem anderen Händler in Rechnung gestellt worden wären. Die Research-Dienste umfassen im Allgemeinen: (1) Beratungen zur Bewertung von Wertpapieren, zur Ratsamkeit einer Anlage, eines Kaufs oder Verkaufs eines Wertpapiers und zur Ratsamkeit von Wertpapieren oder Käufern oder Verkäufern von Wertpapieren; (2) Analysen und Berichte über Wertpapieremittenten, Wirtschaftssektoren, Wertpapiere, wirtschaftliche Faktoren und Trends, Portfoliostrategie und die Performance von Depots; und (3) die Ausführung von Wertpapiertransaktionen und damit einhergehenden Funktionen. Durch eine derartige Zuteilung von Transaktionen kann jeder Untieranlageverwalter sein Research und seine Analysen mit Einschätzungen und Informationen von Wertpapierfirmen ergänzen. Auf diese Art erhaltene Informationen werden zusätzlich herangezogen und sind kein Ersatz für die von einem Untieranlageverwalter gemäß Unterberatungsvereinbarungen zu leistenden Dienste; die Aufwendungen eines jeden Untieranlageverwalters verringern sich nicht unbedingt aufgrund dieser zusätzlichen Research-Informationen.

Darüber hinaus kann jeder Untieranlageverwalter Research-Dienste, die ihm ein Händler zur Verfügung stellt, über den er Wertpapiertransaktionen für einen Teilfonds platziert, für seine anderen von ihm betreuten Kunden verwenden. Obschon der Untieranlageverwalter unter Umständen nicht alle diese Dienste zur Beratung des Teilfonds einsetzt, werden derlei Dienste stets im Interesse des Teilfonds verwendet werden.

11. TRANSAKTIONSKOSTEN

Die Transaktionskosten, die den Teilfonds entstehen, beziehen sich auf den Kauf oder Verkauf von Wertpapieren, Derivaten oder anderen zulässigen Vermögenswerten. Dazu gehören Vergütungen, Abrechnungsgebühren und Maklergebühren. Die Transaktionskosten der Verwahrstelle für jeden Teilfonds werden in der Aufwands- und Ertragsrechnung und Entwicklung des Fondsvermögens als Verwahrstellen- und Verwaltungsgebühren ausgewiesen. Nicht alle Transaktionskosten lassen sich getrennt ausweisen. So sind die Transaktionskosten für Anlagen in Rentenwerten, Devisenterminkontrakten und anderen derivativen Kontrakten im Kauf- und Verkaufspreis der Anlage enthalten. Diese Transaktionskosten spiegeln sich vielmehr in der Wertentwicklung eines jeden Teilfonds wider.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2023 sind den Teilfonds folgende Transaktionskosten entstanden:

	USD
2 Degree Global Equity Fund	142.096
China A Focus Fund	32.707
Climate Focused Emerging Markets Equity Fund	1.953
Climate Focused Global Equity Fund	512
Climate Focused U.S. Equity Fund	220
Emerging Markets Equity Fund	143.333
Emerging Markets Equity Income Fund	535.517
Global Equity Enhanced Income Fund	124.606
Global Factor Enhanced Equity Fund	20.539
Global Long/ Short Equity Fund	511.468
Global Small Cap Equity Fund	13.716
Small Cap Innovation Fund	7.973
U.S. All Cap Growth Fund	308.080
U.S. Large Cap Growth Fund	24.238
U.S. Select Equity Fund	163.935

12. TEILWEISE SWING-PRICING-ANPASSUNG

Haben die gesamten Anteilstransaktionen eines Teilfonds an einem beliebigen Bewertungstag einen Nettoanstieg oder -rückgang des Nettovermögens zur Folge, der einen bestimmten prozentualen Anteil am Gesamtnettovermögen (den „Schwellenwert“) übersteigt, dann wird der NIW des betreffenden Teilfonds um maximal 1,50 % dieses NIW angepasst (der „Anpassungsfaktor“), um den geschätzten Transaktionskosten (einschließlich Brokergebühren, Steuern und Preis-/Marktauswirkungen), die dem Teilfonds unter Umständen entstehen, und dem geschätzten Spread zwischen Geld-/Briefkurs der Vermögenswerte, in die der Teilfonds investiert, Rechnung zu tragen. Diese Anpassung wirkt dem Verwässerungseffekt auf den jeweiligen Teilfonds entgegen, der infolge großer Nettozu- und -abflüsse entsteht, und soll den Schutz der bestehenden Anteilinhaber am jeweiligen Teilfonds erhöhen.

Die Anpassung nach unten bzw. oben erfolgt gemäß einem Mechanismus basierend auf den im Vorhinein festgelegten Schwellenwerten und Anpassungsfaktoren. Bei der Anpassung wird es sich um eine Erhöhung des Betrags handeln, wenn die Nettoänderung zu einer Nettozunahme des Gesamt-Nettovermögens des Teilfonds führt. Anleger, die an diesem Bewertungstag Anteile zeichnen, tragen daher effektiv einen zusätzlichen Betrag bei, um die geschätzten Handelskosten auszugleichen. Bei der Anpassung wird es sich um eine Senkung des Betrags handeln, wenn die Nettoänderung zu einer Nettoabnahme des Gesamt-Nettovermögens des Teilfonds führt. Anteilinhaber, die an diesem Bewertungstag Anteile zurückgeben, erhalten daher effektiv einen geringeren Betrag, um die geschätzten Handelskosten auszugleichen. Der angepasste NIW gilt für alle Zeichnungen, Rücknahmen oder Umtäusche von Anteilen des betreffenden Teilfonds an diesem Bewertungstag und berücksichtigt nicht die spezifischen Umstände einer einzelnen Anlegertransaktion.

Die Schwelle wird vom Verwaltungsrat festgelegt, der Faktoren berücksichtigt wie die vorherrschenden Marktbedingungen, geschätzte Verwässerungskosten und die Größe des jeweiligen Teilfonds. Der Anpassungsfaktor für jeden Teilfonds wird vom Verwaltungsrat festgelegt, richtet sich nach der historischen Liquidität und den Kosten des Handels der verschiedenen Arten von Vermögenswerten, die vom jeweiligen Teilfonds gehalten werden, und kann zwischen Teilfonds variieren. Die nach einer Anpassung tatsächlich angefallenen Handelskosten werden mindestens vierteljährlich mit den geschätzten Handelskosten abgeglichen, und es kann empfohlen werden, den Schwellenwert oder den Anpassungsfaktor für einen Teilfonds zu ändern, wenn die Differenz zwischen den tatsächlichen und den geschätzten Kosten in zwei aufeinanderfolgenden Quartalen einen bestimmten Prozentsatz überschreitet. Änderungen des Schwellenwerts oder Anpassungsfaktors für einen Teilfonds müssen vom Verwaltungsrat genehmigt werden. Darüber hinaus kann der Verwaltungsrat oder ein ordnungsgemäß bevollmächtigter Beauftragter des Verwaltungsrates beschließen, den Anpassungsfaktor bei Mittelzuflüssen, die der Zielgröße eines Teilfonds entsprechen, und in anderen Fällen, die im Interesse der bestehenden Anteilinhaber liegen, nicht auf Zeichnungen von Anteilen anzuwenden. In solchen Fällen kann die Verwaltungsgesellschaft oder ein verbundenes Unternehmen den Betrag der ansonsten anwendbaren Anpassung aus ihrem eigenen Vermögen zahlen, um eine Verwässerung des Anteilswerts für die Anteilinhaber zu verhindern. Unter diesen Umständen werden Rücknahmeanträge auf der Grundlage des nicht angepassten Nettoinventarwerts abgewickelt.

Alle Teilfonds nehmen an einer teilweisen Swing-Pricing-Anpassung teil. Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2023 haben der Climate Transition Global Investment Grade Fund, EUR Short Duration Credit Fund, Small Cap Innovation Fund, U.S. Large Cap Growth Fund, U.S. Select Equity Fund, U.S. Short-Term High Yield Bond Fund und USD Investment Grade Credit Fund Swing-Pricing-Anpassungen vorgenommen.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Zum 31. März 2023 wurde der NIW von keiner Anteilsklasse der Teilfonds dem vorstehend beschriebenen Swing-Pricing-Verfahren unterzogen.

13. MARKTRISIKEN

Russland begann am 24. Februar 2022 eine groß angelegte Invasion der Ukraine. Infolge dieser Militäraktion haben die Vereinigten Staaten und viele andere Länder eine Reihe von Wirtschaftssanktionen gegen Personen und Einrichtungen in Russland und Belarus verhängt. Die Situation hat zu erhöhter Volatilität an den Finanzmärkten geführt und könnte schwerwiegende nachteilige Auswirkungen auf die regionalen und globalen Wirtschaftsmärkte haben, einschließlich der Märkte für bestimmte Wertpapiere und Rohstoffe wie Öl und Erdgas. Das Ausmaß und die Dauer der Militäraktion, der daraufhin verhängten Sanktionen, anderer Strafmaßnahmen und der daraus resultierenden Marktstörungen sind schwer vorherzusagen. Zum 31. März 2023 hielten der Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, der Emerging Markets Equity Fund und der Emerging Markets Equity Income Fund russische Wertpapiere, jeweils mit einer Marktbewertung von insgesamt 0 USD, wie im Anlageportfolio des betreffenden Teilfonds angegeben. Zum 31. März 2023 spiegelten die NIW des Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, des Emerging Markets Equity Fund und des Emerging Markets Equity Income Fund nicht realisierte Verluste in Höhe von 13.711 USD, 7.920.208 USD bzw. 2.109.036 USD für russische Wertpapiere wider.

14. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG

Der Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund und Climate Focused U.S. Equity Fund wurden nach einer vollständigen Rücknahme ihrer Anteile am 19. Mai 2023 aufgelöst.

Am 26. Mai 2023 informierte der Verwaltungsrat die Anteilinhaber des China A Focus Fund über die Liquidation des Teilfonds mit Wirkung zum 7. Juli 2023.

Der Fonds legte am 6. Juni 2023 den Climate Transition Global High Yield Fund auf.

Es gab keine weiteren wesentlichen Ereignisse nach dem Datum der Vermögensbilanz, die einer Überprüfung der im Halbjahresabschluss enthaltenen Zahlen oder Offenlegungen bedürften.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Sitz

80, route d'Esch
L-1470 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Verwaltungsrat

Andrew Owen

Vorsitzende des Verwaltungsrats
Head of Global Fund Governance
Allspring Global Investments

Mattheus Wijnand (Martijn) de Vree

Head of Fixed Income Solutions, Global Fixed Income
Allspring Global Investments

Jürgen Meisch

Achalm Capital GmbH

Yves Wagner

The Directors' Office S.A.

Richard Goddard

The Directors' Office S.A.

Verwaltungsgesellschaft

Allspring Global Investments Luxembourg S.A.
33, rue de Gasperich
H2O Building Floor 2
L-5826 Hesperange
Großherzogtum Luxemburg

Anlageverwalter

Allspring Funds Management, LLC
1415 Vantage Park Drive, 3rd Floor
Charlotte, NC 28203
Vereinigte Staaten von Amerika

Unteranlageverwalter

Allspring Global Investments (UK) Limited
Bow Bells House, 6th Floor
1 Bread Street
London EC4M 9BE
Vereinigtes Königreich

Allspring Global Investments, LLC
1415 Vantage Park Drive, 3rd Floor
Charlotte, NC 28203
Vereinigte Staaten von Amerika

Hauptvertriebsstelle

Allspring Global Investments Luxembourg S.A.
33, rue de Gasperich
H2O Building Floor 2
L-5826 Hesperange
Großherzogtum Luxemburg

Rechtsberater

Elvinger Hoss Prussen, *Société anonyme*
2, Place Winston Churchill
L-1340 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Verwahrstelle, Verwaltungsstelle, Domizilstelle, Listing-Agent, Zahl-, Register- und Transferstelle

Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.
80, route d'Esch
L-1470 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Cabinet de Révision Agréé

Deloitte Audit, *Société à responsabilité limitée*
20, boulevard de Kockelscheuer
L-1821 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Österreichische Zahlstelle

UniCredit Bank Austria AG
Schottengasse 6-8
1010 Wien
Österreich

Vertreter für Finanzdienstleistungen in Belgien

ABN AMRO Private Banking
Borsbeeksebrug 30
2600 Antwerpen
Belgien

Vertreter und Zahlstelle in Frankreich

CACEIS Bank France
1-3 Place Valhubert
75103 Paris
Frankreich

Deutsche Zahl- und Informationsstelle

Marcard, Stein & Co AG
Ballindamm 36
20095 Hamburg
Deutschland

Vertreter in Hongkong

Brown Brothers Harriman (Hong Kong) Limited
13/F Man Yee Building
68 Des Voeux Road Central
Hongkong

Facilities Agent, Irland

Société Générale, Dublin Branch
IFSC House, 3rd Floor
IFSC
Dublin 1
Irland

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Italienische Zahlstelle

Société Générale Securities Services SpA
Via Benigno Crespi 19/A – MAC 2
20159 Mailand
Italien

Allfunds Bank S.A.U., Niederlassung Mailand
Via Bocchetto, 6
20123 Mailand
Italien

Portugiesische Zahlstelle

Banco Electronico de Servico Total, S.A.
Rua Castilho 26, Piso 2
1250-069 Lissabon
Portugal

Vertreter in Singapur

State Street Bank and Trust Company
168 Robinson Road
#33-01 Capital Tower
Singapur 068912
Singapur

Spanische Vertretungsstelle

Allfunds Bank S.A.
Estafeta, 6, La Moraleja
Complejo Plaza de la Fuente Edificio 3
28109, Alcobendas
Madrid
Spanien

Schwedische Zahlstelle

Skandinaviska Enskilda Banken AB
Sergels Torg H1, SE-106 40 Stockholm
Schweden

Schweizer Zahl- und Vertretungsstelle

BNP Paribas, Paris*
Succursale de Zurich
Selnaustrasse 16
8002 Zürich
Schweiz

Vertreter im Vereinigten Königreich

Allspring Global Investments (UK) Limited
Bow Bells House, 6th Floor
1 Bread Street
London EC4M 9BE
Vereinigtes Königreich

* BNP Paribas, Paris, Succursale de Zurich, Selnaustrasse 16, CH-8002 Zürich, Schweiz wurde von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht (FINMA) als Schweizer Zahl- und Vertretungsstelle des Allspring (Lux) Worldwide Fund zugelassen. Der Prospekt des Allspring (Lux) Worldwide Fund, die wesentlichen Anlegerinformationen, die Satzung der Gesellschaft und die Jahres- und ungeprüften Halbjahresberichte sowie eine Liste über Zeichnungen und Rücknahmen sind kostenlos am Sitz der Schweizer Zahl- und Vertretungsstelle erhältlich.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

An die Anteilhaber des
Allspring (Lux) Worldwide Fund
80, rue d'Esch
L-1470 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

BERICHT DES *REVISEUR D'ENTREPRISES AGREE*

Bericht über die Prüfung des Abschlusses

Testat

Wir haben den Abschluss von Allspring (Lux) Worldwide Fund (der „Fonds“) sowie jedes ihrer Teilfonds geprüft. Der Abschluss umfasst die Nettovermögensaufstellung, die Aufstellung der Wertpapieranlagen und sonstiges Nettovermögen zum 31. März 2023, die Aufwands- und Ertragsrechnung und die Entwicklung des Fondsvermögens für das zu diesem Zeitpunkt endende Geschäftsjahr sowie die Erläuterungen zum Jahresbericht einschließlich einer Zusammenfassung der wesentlichen Bilanzierungsgrundsätze.

Nach unserer Auffassung vermittelt der beigefügte Abschluss in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Erstellung und Darstellung von Abschlüssen ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögenslage des Fonds und jedes seiner Teilfonds zum 31. März 2023 sowie der Ergebnisse seiner Transaktionen und der Veränderung seines Nettovermögens für das zu diesem Datum endende Geschäftsjahr.

Grundlage für den Bestätigungsvermerk

Wir haben unsere Prüfung im Einklang mit der EU-Verordnung Nr. 537/2014, dem Gesetz vom 23. Juli 2016 über den Beruf des Abschlussprüfers (das „Gesetz vom 23. Juli 2016“) und den internationalen Prüfungsstandards („ISAs“) durchgeführt, wie sie von der „*Commission de Surveillance du Secteur Financier*“ (CSSF) für Luxemburg übernommen worden sind. Unsere Pflichten gemäß der EU-Verordnung Nr. 537/2014, dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den von der CSSF für Luxemburg übernommenen ISAs sind im Abschnitt „Verantwortlichkeiten des *Réviseur d'Entreprises Agréé* bei der Abschlussprüfung“ in unserem Bericht näher erläutert. Wir sind gemäß den vom internationalen Rat für die Verabschiedung von Standards zur Berufsethik für Wirtschaftsprüfer (International Ethics Standards Board for Accountants, IESBA) herausgegebenen Kodex der ethischen Grundsätze für den Berufsstand (Code of Ethics for Professional Accountants - IESBA-Code) in der von der CSSF in Luxemburg umgesetzten Form sowie den für unsere Prüfung des Abschlusses relevanten ethischen Anforderungen von dem Fonds unabhängig. Wir halten die uns vorgelegten Belege für eine ausreichende und angemessene Grundlage für unseren Bestätigungsvermerk.

Hinweis

In den Erläuterungen 2 und 15 dieses Abschlusses ist angegeben, dass die Abschlüsse der Teilfonds Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund und Climate Focused U.S. nicht nach dem Grundsatz der Unternehmensfortführung erstellt wurden, da diese Teilfonds zum 19. Mai 2023 aufgelöst wurden. Dieser Sachverhalt hat keinen Einfluss auf unser Testat.

Besonders wichtige Prüfungssachverhalte

Besonders wichtige Prüfungssachverhalte sind Sachverhalte, die nach unserem pflichtgemäßen Ermessen für die Prüfung des Abschlusses für den laufenden Berichtszeitraum von größter Bedeutung waren. Diese Sachverhalte wurden im Zusammenhang mit der Prüfung des Abschlusses insgesamt und der Erstellung des Bestätigungsvermerks behandelt. Wir erstellen in Bezug auf diese Sachverhalte keinen gesonderten Bestätigungsvermerk.

Wir haben keine besonders wichtigen Prüfungssachverhalte festgestellt, die im Rahmen unseres Berichts mitgeteilt werden müssten.

Weitere Informationen

Der Verwaltungsrat des Fonds ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die im Jahresbericht enthaltenen Informationen, jedoch nicht den Abschluss und unseren dazugehörigen Bericht des „*Réviseur d'Entreprises Agréé*“.

Unsere Stellungnahme zu den Rechnungsabschlüssen umfasst nicht die sonstigen Informationen und wir äußern dahingehend keinerlei Prüfungssicherheit.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

In Verbindung mit unserer Prüfung des Abschlusses sind wir dafür verantwortlich, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu beurteilen, ob die sonstigen Informationen wesentlich im Widerspruch zum Abschluss oder zu unserem bei der Abschlussprüfung erlangten Wissen stehen oder anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Wenn wir aufgrund der von uns durchgeführten Arbeit zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, müssen wir über diese Tatsache berichten. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats des Fonds bezüglich des Abschlusses

Der Verwaltungsrat des Fonds ist für die Erstellung und ehrliche Darstellung des Abschlusses gemäß den gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Bestimmungen Luxemburgs für die Erstellung von Abschlüssen und für entsprechende interne Kontrollmaßnahmen verantwortlich, die der Verwaltungsrat des Fonds für die Erstellung und Darstellung von Abschlüssen für notwendig erachtet, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind.

Bei der Erstellung des Abschlusses ist der Verwaltungsrat des Fonds verantwortlich für die Beurteilung der Fähigkeit des Fonds zur Fortsetzung des Geschäftsbetriebs. Dabei muss er Angelegenheiten, die sich auf die Fortsetzung des Geschäftsbetriebs und die Verwendung des Grundsatzes der Unternehmensfortführung beziehen, gegebenenfalls offenlegen, es sei denn, der Verwaltungsrat des Fonds hat die Absicht, den Fonds zu liquidieren oder die Geschäftstätigkeit einzustellen, bzw. hat keine realistische Alternative zu diesem Vorgehen.

Pflichten des „Réviseur d'Entreprises Agréé“ in Bezug auf die Prüfung des Abschlusses

Das Ziel unserer Prüfung ist es, eine angemessene Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Abschluss insgesamt frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, und einen Bericht des „Réviseur d'Entreprises Agréé“ zu erstellen, der unseren Bestätigungsvermerk enthält. Die angemessene Sicherheit stellt einen hohen Grad an Sicherheit dar, ist jedoch keine Garantie dafür, dass bestehende wesentliche falsche Darstellungen bei einer gemäß der EU-Verordnung Nr. 537/2014, dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den in Luxemburg von der CSSF umgesetzten ISAs durchgeführten Abschlussprüfung immer entdeckt werden. Falsche Darstellungen können durch dolose Handlungen oder Irrtümer entstehen und gelten als wesentlich, wenn vernünftigerweise erwartet werden kann, dass sie einzeln oder insgesamt die wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen, die auf der Grundlage dieses Abschlusses getroffen werden.

Im Rahmen unserer Abschlussprüfung gemäß der EU-Verordnung Nr. 537/2014, dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den in Luxemburg von der CSSF umgesetzten ISAs gehen wir während der gesamten Abschlussprüfung nach pflichtgemäßem Ermessen und mit professioneller Skepsis vor. Des Weiteren umfasst unsere Prüfung:

- die Identifizierung und Beurteilung des Risikos wesentlicher falscher Darstellungen im Abschluss aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, die Planung und Durchführung von Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken und die Erlangung von Prüfungsnachweisen, die als Grundlage für die Erteilung unseres Bestätigungsvermerks ausreichend und angemessen sind. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen nicht entdeckt werden, ist höher als bei wesentlichen falschen Darstellungen, die aus Irrtümern resultieren, da dolose Handlungen geheime Absprachen, Fälschungen, gezielte Auslassungen, falsche Angaben wesentlicher Umstände oder die Umgehung interner Kontrollen beinhalten können;
- die Erlangung eines Verständnisses der für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollen, um den Umständen angemessene Prüfungsverfahren zu erarbeiten, jedoch nicht, um eine Meinung über die Wirksamkeit der internen Kontrollen des Fonds abzugeben.
- die Beurteilung der Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsgrundsätze und der vom Verwaltungsrat des Fonds vorgenommenen Schätzungen und der damit im Zusammenhang stehenden Offenlegungen.
- die Schlussfolgerung, ob der vom Verwaltungsrat bei der Erstellung des Abschlusses angewandte Grundsatz der Unternehmensfortführung angemessen ist und ob auf der Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise eine wesentliche Unsicherheit in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen besteht, die die Fähigkeit des Fonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit ernsthaft in Zweifel stellen könnten. Wenn wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Bericht des „Réviseur d'Entreprises Agréé“ auf die entsprechenden Offenlegungen im Abschluss hinzuweisen bzw. unseren Bestätigungsvermerk zu ändern, falls die Offenlegungen unangemessen sind. Unsere Schlussfolgerungen basieren auf den bis zum Datum unseres Berichts des „Réviseur d'Entreprises Agréé“ erlangten Prüfungsnachweisen. Künftige Ereignisse oder Bedingungen können jedoch dazu führen, dass die Fortführung der Unternehmenstätigkeit des Fonds nicht länger gegeben ist.
- die Beurteilung der Gesamtdarstellung und Struktur des Abschlusses sowie seines Inhalts, einschließlich der Offenlegungen und der Frage, ob die zugrunde liegenden Transaktionen und Ereignisse im Abschluss so dargestellt sind, dass ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild erreicht wird.

Wir kommunizieren mit den für die Überwachung Verantwortlichen, unter anderem in Bezug auf den geplanten Umfang und den Zeitplan für die Abschlussprüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich eventueller bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung entdecken.

Wir geben den mit der Unternehmensführung beauftragten Personen gegenüber zudem eine Erklärung ab, dass wir die relevanten ethischen Anforderungen in Bezug auf die Unabhängigkeit erfüllt haben, und teilen ihnen alle Beziehungen und sonstigen Sachverhalte mit, von denen vernünftigerweise angenommen werden kann, dass sie sich auf unsere Unabhängigkeit auswirken, sowie gegebenenfalls die getroffenen Maßnahmen zur Abwehr von Bedrohungen und die entsprechenden Schutzvorkehrungen.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Aus den mit den für die Unternehmensführung Verantwortlichen kommunizierten Sachverhalten ermitteln wir diejenigen Sachverhalte, die für die Prüfung des Abschlusses der aktuellen Periode von größter Bedeutung waren und somit die besonders wichtigen Prüfungssachverhalte darstellen. Wir beschreiben diese Sachverhalte in unserem Bericht, es sei denn, dass Gesetze oder Vorschriften eine öffentliche Bekanntgabe ausschließen.

Wir haben keine besonders wichtigen Prüfungssachverhalte festgestellt, die im Rahmen unseres Berichts mitgeteilt werden müssten.

Bericht zu sonstigen rechtlichen und regulatorischen Vorschriften

Wir wurden bei der Hauptversammlung der Anteilhaber am 22. Juli 2022 zum „*Réviseur d'Entreprises Agréé*“ ernannt. Die Dauer unseres ununterbrochenen Engagements, einschließlich früherer Verlängerungen und Wiederernennungen, beträgt 5 Jahre.

Wir bestätigen, dass keine durch die EU-Verordnung Nr. 537/2014 untersagten Nichtprüfungsleistungen erbracht wurden und wir bei der Durchführung unserer Prüfung unabhängig vom Fonds geblieben sind.

Während des Geschäftsjahres zum 31. März 2023 war Deloitte Audit, zusätzlich zur gesetzlichen Abschlussprüfung, für den Fonds im Rahmen einer Vereinbarung auf der Grundlage einer Anforderung des Verwaltungsrats des Fonds tätig.

Für Deloitte Audit, *Cabinet de Révision Agréé*

Ladislav de Crouy-Chanel, *Réviseur d'Entreprises Agréé*
Associé

21.06.2023

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Aktueller Verkaufsprospekt

Der aktuelle Verkaufsprospekt und das Basisinformationsblatt des Fonds können auf Anfrage kostenlos vom Anlageverwalter, von der Verwaltungsstelle, am eingetragenen Sitz des Fonds sowie auf www.allspringglobal.com bezogen werden.

Veröffentlichung der Anteilspreise und Mitteilungen an Anteilinhaber

Einberufungen zu Hauptversammlungen und Mitteilungen an Anteilinhaber erfolgen in Übereinstimmung mit Luxemburger Gesetzen und Bestimmungen. Ausgabe- und Rücknahmepreise sind an jedem Handelstag am eingetragenen Sitz der Gesellschaft erhältlich.

Käufe und Verkäufe

Eine detaillierte Aufstellung der Anlagenkäufe und -verkäufe für jeden Teilfonds während des Berichtszeitraums ist auf Anfrage kostenlos am eingetragenen Sitz des Fonds erhältlich.

Berichte und Satzung des Fonds

Eine Kopie der Fondssatzung und des vorliegenden Jahresberichts einschließlich des geprüften Abschlusses sowie des jüngsten ungeprüften Jahresberichts sind ebenfalls kostenlos am eingetragenen Sitz des Fonds erhältlich.

Vergütung

Die Verwaltungsgesellschaft hat eine Vergütungsrichtlinie eingeführt, die den derzeitigen Gesetzen und Verordnungen für OGAW-Fonds entspricht. Die Vergütungsrichtlinie, die vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft genehmigt wurde, beinhaltet Maßnahmen zur Vermeidung von Interessenkonflikten und strebt die Förderung eines kohärenten und effektiven Risikomanagements an. Der Fondsprospekt enthält eine detaillierte Beschreibung der Vergütungsrichtlinie.

Eine elektronische Version der Vergütungsrichtlinie ist unter folgendem Link verfügbar:

<https://allspringglobal.com/assets/edocs/lux/legal/remuneration-policy.pdf>

Eine gedruckte Ausgabe ist kostenlos am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft erhältlich.

Die von der Verwaltungsgesellschaft einschließlich ihrer Niederlassungen an ihre Mitarbeiter gezahlte Vergütung für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 belief sich auf insgesamt 4.757.099 EUR und setzt sich wie folgt zusammen:

Festvergütung: 2.830.014 EUR
Variable Vergütung: 1.927.084 EUR
Anzahl der Begünstigten: 25*

* davon 3 Personen, die keine Vergütung für ihre Tätigkeit als Mitglied des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft erhalten.

Die Gesamtvergütung für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022, die von der Verwaltungsgesellschaft an identifizierte Mitarbeiter/Risikoträger gezahlt wurde, ist wie folgt:

Benannte Mitarbeiter/Risikoträger: 3.929.316 EUR
Andere Risikoträger: 0 EUR

Der Fonds zahlte keine Vergütung an die Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft. Weder der Fonds noch die Verwaltungsgesellschaft zahlten Vergütungen an Mitarbeiter von Beauftragten der Verwaltungsgesellschaft.

Allspring Funds Management, LLC, ein verbundenes Unternehmen der Verwaltungsgesellschaft, wird mit dem Portfoliomanagement beauftragt. Allspring Funds Management, LLC überträgt bestimmte Aufgaben des Portfoliomanagements an Allspring Global Investments, LLC und Allspring Global Investments (UK) Limited, die ebenfalls verbundene Unternehmen der Verwaltungsgesellschaft sind und ihren Sitz in den USA bzw. im Vereinigten Königreich haben. Die an die Mitarbeiter der verbundenen Unternehmen im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 gezahlte Vergütung für die Durchführung des Portfoliomanagements für den OGAW belief sich auf 1.199.300 USD und setzt sich wie folgt zusammen:

Festvergütung: 302.100 USD
Variable Vergütung: 897.200 USD
Anzahl der Begünstigten: 37

Bitte beachten Sie, dass der Betrag für jeden Begünstigten, der zu den oben genannten Summen zusammengerechnet wurde, auf der Grundlage der verwalteten Vermögenswerte des geltenden OGAW, für die der Begünstigte zuständig ist, im Vergleich zum gesamten verwalteten Vermögen über alle Konten, für die der Begünstigte zuständig ist, anteilig berechnet wurde.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Allgemeine Informationen (ungeprüft)

Die Gesamtvergütung basiert auf der Beurteilung der individuellen Leistung und den Ergebnissen von Allspring Global Investments, LLC, der Verwaltungsgesellschaft und/oder der Investmentfonds gemäß den relevanten Anreizplänen von Allspring. Dabei werden sowohl finanzielle als auch nicht-finanzielle Kriterien berücksichtigt, einschließlich übertragener Aktien von Wells Fargo.

Die Vergütungsrichtlinie der Verwaltungsgesellschaft wird jährlich vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft überprüft. Aktualisierungen der Richtlinie erfolgen durch die maßgeblichen Mitarbeiter von Allspring Global Investments, LLC und der Verwaltungsgesellschaft und werden dem Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft zur Prüfung und Genehmigung vorgelegt. Daneben wird die Richtlinie fortlaufend von der unabhängigen Revisionsstelle der Verwaltungsgesellschaft überprüft. In den letzten Überprüfungen wurden keine Unregelmäßigkeiten festgestellt.

Die Richtlinie wurde zuletzt im Mai 2023 mit Änderungen der Vergütungspraktiken infolge der Änderungen bei der Eigentümerschaft aktualisiert.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Gesamtkostenquoten

Die Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio, TER) wird berechnet, indem die Aufwendungen ohne Bankzinsen, der Dividendenaufwand und aufgelaufene Transaktionskosten durch das durchschnittliche Nettovermögen jeder Anteilsklasse dividiert und anschließend annualisiert werden. Die Gesamtkostenquoten der abgesicherten Anteilsklassen beinhalten zusätzliche Depotbankgebühren für die Verwaltung der Absicherungen und weisen daher eine höhere Brutto-TER und Verzichtsbeiträge aus als die nicht abgesicherten Anteilsklassen. Die Sätze sind auf das Jahr umgerechnet und bei der Berechnung der durchschnittlichen Nettovermögen werden Wochenenden mit eingeschlossen. Die TER beinhaltet nicht die in Erläuterung 11 des Abschlusses aufgeführten Transaktionskosten.

Die TER der Teilfonds für das Geschäftsjahr zum 31. März 2023 und die maximale Kostenquote zum 31. März 2023 für jede aktive Anteilsklasse werden nachfolgend aufgeführt.

Gesamtkostenquoten

	Brutto-TER	Gebühren- verzicht	Netto-TER	Maximale Kostenquote
2 Degree Global Equity Fund				
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	1,34 %	(0,16) %	1,18 %	1,20 %
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	26,59 %	(25,94) %	0,65 %	0,65 %
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	0,82 %	(0,18) %	0,64 %	0,65 %
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	0,82 %	(0,18) %	0,64 %	0,65 %
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	0,84 %	(0,20) %	0,64 %	0,65 %
Anteile der Klasse Z (USD) - thes.	0,84 %	(0,20) %	0,64 %	0,65 %
Alternative Risk Premia Fund				
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	25,71 %	(25,01) %	0,70 %	0,70 %
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	1,43 %	(0,73) %	0,70 %	0,70 %
China A Focus Fund				
Anteile der Klasse A (SEK) - thes.	3,11 %	(1,35) %	1,76 %	1,80 %
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	3,11 %	(1,34) %	1,77 %	1,80 %
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	2,43 %	(1,32) %	1,11 %	1,15 %
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	2,43 %	(1,32) %	1,11 %	1,15 %
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	2,46 %	(1,32) %	1,14 %	1,15 %
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	2,46 %	(1,35) %	1,11 %	1,15 %
Climate Focused Emerging Markets Equity Fund				
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	11,41 %	(11,41) %	0,00 %	0,45 %
Climate Focused Global Equity Fund				
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	18,00 %	(17,87) %	0,13 %	0,40 %
Climate Focused U.S. Equity Fund				
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	18,80 %	(18,45) %	0,35 %	0,35 %
Climate Transition Global Investment Grade Credit Fund				
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	1,13 %	(0,18) %	0,95 %	0,95 %
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	24,83 %	(24,38) %	0,45 %	0,45 %
Anteile der Klasse I (GBP) - thes. (abgesichert)	0,65 %	(0,20) %	0,45 %	0,45 %
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	0,68 %	(0,23) %	0,45 %	0,45 %
Anteile der Klasse I (USD) - aussch.	0,62 %	(0,17) %	0,45 %	0,45 %
Anteile der Klasse Z (USD) - aussch.	0,62 %	(0,17) %	0,45 %	0,45 %

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Gesamtkostenquoten (Fortsetzung)

	Brutto-TER	Gebühren- verzicht	Netto-TER	Maximale Kostenquote
Emerging Markets Equity Fund				
Anteile der Klasse A (SEK) - thes.	1,94 %	(0,05) %	1,89 %	1,94 %
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	1,92 %	0,00 %	1,92 %	1,94 %
Anteile der Klasse I (AUD) - aussch.	1,04 %	0,00 %	1,04 %	1,15 %
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	1,14 %	(0,01) %	1,13 %	1,15 %
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	1,14 %	(0,01) %	1,13 %	1,15 %
Anteile der Klasse I (SEK) - thes.	1,14 %	(0,01) %	1,13 %	1,15 %
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	1,13 %	0,00 %	1,13 %	1,15 %
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	1,18 %	(0,02) %	1,16 %	1,19 %
Anteile der Klasse Z (USD) - thes.	1,14 %	0,00 %	1,14 %	1,19 %
Emerging Markets Equity Income Fund				
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	2,29 %	(0,33) %	1,96 %	2,00 %
Anteile der Klasse A (USD) - brutto aussch.	2,29 %	(0,33) %	1,96 %	2,00 %
Anteile der Klasse I (AUD) - aussch.	1,50 %	(0,29) %	1,21 %	1,25 %
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	1,48 %	(0,28) %	1,20 %	1,25 %
Anteile der Klasse I (GBP) - aussch.	1,48 %	(0,28) %	1,20 %	1,25 %
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	1,49 %	(0,28) %	1,21 %	1,25 %
Anteile der Klasse I (USD) - brutto aussch.	1,48 %	(0,28) %	1,20 %	1,25 %
Anteile der Klasse X (GBP) - thes.	1,44 %	(0,33) %	1,11 %	n. z.*
Anteile der Klasse Y (EUR) - brutto aussch.	1,24 %	(0,29) %	0,95 %	n. z.*
Anteile der Klasse Y (GBP) - brutto aussch.	1,26 %	(0,30) %	0,96 %	n. z.*
Anteile der Klasse Y (USD) - brutto aussch.	1,25 %	(0,30) %	0,95 %	n. z.*
Anteile der Klasse Z (USD) - aussch.	1,52 %	(0,31) %	1,21 %	1,25 %
EUR Investment Grade Credit Fund				
Anteile der Klasse A (EUR) - aussch.	1,13 %	(0,18) %	0,95 %	0,95 %
Anteile der Klasse I (CHF) - thes. (abgesichert)	0,67 %	(0,22) %	0,45 %	0,45 %
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	0,62 %	(0,17) %	0,45 %	0,45 %
Anteile der Klasse I (EUR) - aussch.	0,57 %	(0,12) %	0,45 %	0,45 %
EUR Short Duration Credit Fund				
Anteile der Klasse A (EUR) - thes.	0,86 %	(0,03) %	0,83 %	0,85 %
Anteile der Klasse A (EUR) - aussch.	0,86 %	(0,03) %	0,83 %	0,85 %
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	0,38 %	(0,04) %	0,34 %	0,35 %
Anteile der Klasse X1 (EUR) - thes.	0,42 %	(0,13) %	0,29 %	n. z.*
Anteile der Klasse X1 (USD) - thes. (abgesichert)	24,09 %	(23,79) %	0,30 %	n. z.*
Anteile der Klasse X (EUR) - thes.	0,31 %	(0,12) %	0,19 %	n. z.*
Anteile der Klasse X (EUR) - aussch.	0,31 %	(0,12) %	0,19 %	n. z.*
Anteile der Klasse X (GBP) - aussch. (abgesichert)	14,03 %	(13,83) %	0,20 %	n. z.*
Anteile der Klasse X (USD) - thes. (abgesichert)	0,32 %	(0,14) %	0,18 %	n. z.*
Anteile der Klasse Z (EUR) - aussch.	0,38 %	(0,04) %	0,34 %	0,35 %

* * Die maximale Kostenquote basiert auf gesonderten Vereinbarungen.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Gesamtkostenquoten (Fortsetzung)

	Brutto-TER	Gebühren- verzicht	Netto-TER	Maximale Kostenquote
Global Equity Enhanced Income Fund				
Anteile der Klasse A (SGD) - aussch. (abgesichert)	1,93 %	(0,53) %	1,40 %	1,40 %
Anteile der Klasse A (USD) - aussch.	1,87 %	(0,47) %	1,40 %	1,40 %
Anteile der Klasse I (USD) - aussch.	1,21 %	(0,51) %	0,70 %	0,70 %
Anteile der Klasse X (GBP) - brutto aussch.	0,90 %	(0,55) %	0,35 %	n. z.*
Anteile der Klasse X (USD) - brutto aussch.	0,90 %	(0,55) %	0,35 %	n. z.*
Anteile der Klasse Z (GBP) - brutto aussch.	1,26 %	(0,56) %	0,70 %	0,70 %
Global Factor Enhanced Equity Fund				
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	1,02 %	(0,65) %	0,37 %	0,40 %
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	0,88 %	(0,65) %	0,23 %	0,25 %
Anteile der Klasse Z (USD) - thes.	0,92 %	(0,69) %	0,23 %	0,25 %
Global Long/ Short Equity Fund				
Anteile der Klasse AP (USD) - thes.	1,91 %	(0,17) %	1,74 %	1,75 %
Anteile der Klasse IP (AUD) - aussch. (abgesichert)	1,17 %	(0,18) %	0,99 %	1,00 %
Anteile der Klasse IP (EUR) - thes. (abgesichert)	1,18 %	(0,19) %	0,99 %	1,00 %
Anteile der Klasse IP (EUR) - aussch.	1,12 %	(0,13) %	0,99 %	1,00 %
Anteile der Klasse IP (GBP) - thes.	1,12 %	(0,13) %	0,99 %	1,00 %
Anteile der Klasse IP (USD) - thes.	1,12 %	(0,13) %	0,99 %	1,00 %
Anteile der Klasse ZP (USD) - thes.	1,14 %	(0,15) %	0,99 %	1,00 %
Global Small Cap Equity Fund				
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	2,51 %	(1,56) %	0,95 %	0,95 %
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	2,51 %	(1,56) %	0,95 %	0,95 %
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	2,51 %	(1,56) %	0,95 %	0,95 %
Small Cap Innovation Fund				
Anteile der Klasse A (SGD) - thes. (abgesichert)	26,17 %	(24,37) %	1,80 %	1,80 %
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	4,94 %	(3,99) %	0,95 %	0,95 %
Anteile der Klasse X (GBP) - thes.	4,52 %	(4,02) %	0,50 %	n. z.*
Anteile der Klasse Z (EUR) - thes. (abgesichert)	24,86 %	(23,91) %	0,95 %	0,95 %
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	5,01 %	(4,06) %	0,95 %	0,95 %
Anteile der Klasse Z (USD) - thes.	4,99 %	(4,04) %	0,95 %	0,95 %
U.S. All Cap Growth Fund				
Anteile der Klasse A (EUR) - thes. (abgesichert)	1,96 %	(0,14) %	1,82 %	1,84 %
Anteile der Klasse A (GBP) - thes.	1,78 %	(0,01) %	1,77 %	1,84 %
Anteile der Klasse A (SGD) - thes. (abgesichert)	2,17 %	(0,35) %	1,82 %	1,84 %
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	1,78 %	(0,01) %	1,77 %	1,84 %
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	0,96 %	(0,02) %	0,94 %	1,00 %
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	5,69 %	(4,71) %	0,98 %	1,00 %
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	0,94 %	(0,01) %	0,93 %	1,00 %
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	0,94 %	(0,01) %	0,93 %	1,00 %
Anteile der Klasse Y (EUR) - thes.	0,74 %	(0,05) %	0,69 %	n. z.*
Anteile der Klasse Z (EUR) - thes. (abgesichert)	1,18 %	(0,16) %	1,02 %	1,04 %
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	0,98 %	(0,01) %	0,97 %	1,04 %
Anteile der Klasse Z (GBP) - aussch.	0,98 %	(0,01) %	0,97 %	1,04 %
Anteile der Klasse Z (USD) - thes.	0,98 %	(0,01) %	0,97 %	1,04 %
Anteile der Klasse Z (USD) - aussch.	0,98 %	(0,01) %	0,97 %	1,04 %

* * Die maximale Kostenquote basiert auf gesonderten Vereinbarungen.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Gesamtkostenquoten (Fortsetzung)

	Brutto-TER	Gebühren- verzicht	Netto-TER	Maximale Kostenquote
U.S. Large Cap Growth Fund				
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	2,82 %	(1,08) %	1,74 %	1,74 %
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	0,91 %	(0,01) %	0,90 %	0,90 %
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	0,97 %	(0,07) %	0,90 %	0,90 %
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	2,10 %	(1,16) %	0,94 %	0,94 %
U.S. Select Equity Fund				
Anteile der Klasse A (EUR) - thes.	7,73 %	(5,88) %	1,85 %	1,85 %
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	5,53 %	(3,68) %	1,85 %	1,85 %
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	6,69 %	(5,54) %	1,15 %	1,15 %
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	1,33 %	(0,18) %	1,15 %	1,15 %
Anteile der Klasse X (USD) - aussch.	1,27 %	(0,12) %	1,15 %	n. z.*
U.S. Short-Term High Yield Bond Fund				
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	1,89 %	(0,66) %	1,23 %	1,30 %
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	15,70 %	(14,90) %	0,80 %	0,80 %
Anteile der Klasse I (EUR) - aussch. (abgesichert)	35,64 %	(34,90) %	0,74 %	0,80 %
Anteile der Klasse I (GBP) - aussch. (abgesichert)	1,34 %	(0,60) %	0,74 %	0,80 %
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	1,29 %	(0,53) %	0,76 %	0,80 %
Anteile der Klasse I (USD) - brutto aussch.	1,12 %	(0,32) %	0,80 %	0,80 %
USD Investment Grade Credit Fund				
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	0,99 %	(0,04) %	0,95 %	0,95 %
Anteile der Klasse A (USD) - aussch.	0,99 %	(0,05) %	0,94 %	0,95 %
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	0,50 %	(0,07) %	0,43 %	0,45 %
Anteile der Klasse I (EUR) - aussch. (abgesichert)	0,51 %	(0,06) %	0,45 %	0,45 %
Anteile der Klasse I (GBP) - aussch. (abgesichert)	1,66 %	(1,22) %	0,44 %	0,45 %
Anteile der Klasse I (JPY) - thes. (abgesichert)	0,51 %	(0,07) %	0,44 %	0,45 %
Anteile der Klasse I (SGD) - thes. (abgesichert)	30,38 %	(29,94) %	0,44 %	0,45 %
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	0,46 %	(0,02) %	0,44 %	0,45 %
Anteile der Klasse I (USD) - aussch.	0,46 %	(0,02) %	0,44 %	0,45 %
Anteile der Klasse Y (EUR) - thes. (abgesichert)	0,32 %	(0,07) %	0,25 %	n. z.*
Anteile der Klasse Y (EUR) - brutto aussch. (abgesichert)	1,47 %	(1,08) %	0,39 %	n. z.*
Anteile der Klasse Y (USD) - brutto aussch.	0,41 %	(0,02) %	0,39 %	n. z.*
Anteile der Klasse Z (EUR) - aussch. (abgesichert)	1,75 %	(1,30) %	0,45 %	0,45 %
Anteile der Klasse Z (USD) - aussch.	0,43 %	0,00 %	0,43 %	0,45 %

* * Die maximale Kostenquote basiert auf gesonderten Vereinbarungen.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Wertentwicklung

Die frühere Wertentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Der Wert einer Anlage und daraus erzielte Erträge können sowohl steigen als auch fallen und sind nicht garantiert. Die Erträge können je nach Marktumfeld und Besteuerung schwanken. Anleger erhalten das von ihnen investierte Kapital möglicherweise nicht zurück. In den Performancezahlen nicht berücksichtigt sind Gebühren und Aufwendungen, die bei der Zeichnung oder Rücknahme von Anteilen anfallen können. Die Steuerhöhe und -bemessungsgrundlage kann von Zeit zu Zeit Änderungen unterliegen.

Anteilszeichnungen können nur auf Grundlage des aktuellen Verkaufsprospekts und der wesentlichen Anlegerinformationen erfolgen, wobei der letzte ungeprüfte Halbjahresbericht nebst Bilanz ein wesentlicher Bestandteil des Verkaufsprospekts der Gesellschaft ist. Kopien sind am eingetragenen Sitz des Fonds erhältlich.

Die Berechnungsmethoden basieren auf branchenüblichen Standards.

Renditen für Zeiträume von weniger als einem Jahr sind nicht annualisiert. Sofern nicht anderweitig vermerkt, verstehen sich sämtliche Renditen zum 31. März 2023.

	Renditen ohne Verkaufsgebühren				Tatsächliches Auflegungsdatum	
	1 Jahr	5 Jahre	10 Jahre	Seit Auflegungsdatum		1 Jahr (vom 01.01.2022 bis 31.12.2022) ¹
2 Degree Global Equity Fund						
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	(4,28) %	-	-	(2,66) %	(17,59) %	20.07.2021
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	(7,31) %	-	-	(4,87) %	(20,05) %	20.07.2021
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	2,48 %	-	-	3,79 %	(7,22) %	20.07.2021
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	(3,75) %	-	-	(2,13) %	(17,14) %	20.07.2021
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	2,47 %	-	-	3,79 %	(7,23) %	20.07.2021
Anteile der Klasse Z (USD) - thes.	(3,76) %	-	-	(2,13) %	(17,14) %	20.07.2021
Alternative Risk Premia Fund						
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	4,33 %	-	-	(3,83) %	3,21 %	09.12.2019
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	6,55 %	-	-	(2,45) %	4,93 %	09.12.2019
China A Focus Fund						
Anteile der Klasse A (SEK) - thes.	(2,73) %	5,87 %	-	12,33 %	(20,53) %	28.06.2013
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	(11,88) %	1,36 %	6,67 %	9,53 %	(31,18) %	30.01.2009
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	(9,52) %	4,63 %	9,21 %	11,66 %	(26,33) %	30.01.2009
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	(5,54) %	4,69 %	9,67 %	10,52 %	(22,45) %	02.04.2009
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	(11,30) %	2,11 %	7,45 %	10,34 %	(30,73) %	30.01.2009
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	(5,55) %	4,68 %	9,67 %	10,65 %	(22,45) %	31.10.2012
Climate Focused Emerging Markets Equity Fund						
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	(11,38) %	-	-	(12,88) %	(17,71) %	23.02.2022
Climate Focused Global Equity Fund						
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	(5,06) %	-	-	(7,74) %	(15,57) %	29.12.2021
Climate Focused U.S. Equity Fund						
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	(8,86) %	-	-	(10,95) %	(19,26) %	29.12.2021
Climate Transition Global Investment Grade Credit Fund						
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	(7,15) %	-	-	(9,43) %	(16,01) %	27.08.2021
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	(9,14) %	-	-	(10,81) %	(17,41) %	27.08.2021
Anteile der Klasse I (GBP) - thes. (abgesichert)	(7,75) %	-	-	(6,50) %	(16,30) %	26.02.2021
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	(6,69) %	-	-	(8,97) %	(15,57) %	27.08.2021
Anteile der Klasse I (USD) - aussch.	(6,62) %	-	-	(1,64) %	(15,52) %	08.11.2019
Anteile der Klasse Z (USD) - aussch.	(6,69) %	-	-	(1,66) %	(15,58) %	08.11.2019

¹ Besteht eine Klasse zum 31. Dezember 2022 weniger als 1 Jahr, wird die Rendite ab Auflegungsdatum bis zum 31. Dezember 2022 aufgeführt.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Wertentwicklung (Fortsetzung)

	Renditen ohne Verkaufsgebühren			Seit Auflegungs- datum	1 Jahr (vom 01.01.2022 bis 31.12.2022) ¹	Tatsächliches Auflegungs- datum
	1 Jahr	5 Jahre	10 Jahre			
Emerging Markets Equity Fund						
Anteile der Klasse A (SEK) - thes.	0,64 %	-	-	(8,95) %	(8,24) %	01.04.2021
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	(8,84) %	(1,84) %	1,19 %	0,35 %	(20,55) %	15.12.2010
Anteile der Klasse I (AUD) - aussch.	2,96 %	1,79 %	7,06 %	6,72 %	(14,34) %	30.09.2011
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	(6,28) %	1,46 %	3,70 %	2,83 %	(14,83) %	15.12.2010
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	(2,15) %	1,51 %	4,13 %	3,13 %	(10,35) %	15.12.2010
Anteile der Klasse I (SEK) - thes.	1,42 %	-	-	(8,26) %	(7,53) %	01.04.2021
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	(8,12) %	(1,07) %	1,99 %	1,14 %	(19,92) %	15.12.2010
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	(2,17) %	-	-	0,12 %	(10,36) %	26.02.2020
Anteile der Klasse Z (USD) - thes.	(8,13) %	-	-	(1,32) %	(19,93) %	26.02.2020
Emerging Markets Equity Income Fund						
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	(12,92) %	(1,79) %	0,78 %	2,12 %	(19,30) %	29.06.2012
Anteile der Klasse A (USD) - brutto aussch.	(12,92) %	(1,79) %	-	3,83 %	(19,30) %	29.02.2016
Anteile der Klasse I (AUD) - aussch.	(1,78) %	1,74 %	-	5,44 %	(13,10) %	02.06.2014
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	(10,50) %	1,53 %	3,29 %	4,41 %	(13,52) %	29.06.2012
Anteile der Klasse I (GBP) - aussch.	(6,58) %	-	-	2,35 %	(8,97) %	24.02.2020
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	(12,26) %	(1,03) %	1,56 %	2,91 %	(18,69) %	29.06.2012
Anteile der Klasse I (USD) - brutto aussch.	(12,27) %	(1,02) %	-	4,68 %	(18,68) %	29.02.2016
Anteile der Klasse X (GBP) - thes.	(6,49) %	-	-	1,44 %	(8,87) %	16.05.2018
Anteile der Klasse Y (EUR) - brutto aussch.	(10,30) %	-	-	1,51 %	(13,32) %	16.05.2018
Anteile der Klasse Y (GBP) - brutto aussch.	(6,35) %	1,90 %	-	4,58 %	(8,74) %	29.05.2015
Anteile der Klasse Y (USD) - brutto aussch.	(12,05) %	-	-	(0,23) %	(18,49) %	16.05.2018
Anteile der Klasse Z (USD) - aussch.	(12,27) %	-	-	0,80 %	(18,69) %	24.02.2020
EUR Investment Grade Credit Fund						
Anteile der Klasse A (EUR) - aussch.	(8,96) %	-	-	(4,69) %	(15,11) %	24.02.2020
Anteile der Klasse I (CHF) - thes. (abgesichert)	(9,42) %	(1,93) %	-	(1,48) %	(15,23) %	19.06.2017
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	(8,50) %	(1,41) %	-	(0,95) %	(14,69) %	19.06.2017
Anteile der Klasse I (EUR) - aussch.	(8,49) %	(1,30) %	-	(0,86) %	(14,68) %	19.06.2017
EUR Short Duration Credit Fund						
Anteile der Klasse A (EUR) - thes.	(5,48) %	-	-	(3,00) %	(9,38) %	26.02.2020
Anteile der Klasse A (EUR) - aussch.	(5,49) %	-	-	(3,00) %	(9,39) %	26.02.2020
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	(5,02) %	(1,02) %	0,65 %	1,36 %	(8,92) %	04.11.2011
Anteile der Klasse X (EUR) - thes.	(4,87) %	-	-	(1,31) %	(8,79) %	29.03.2019
Anteile der Klasse X (EUR) - aussch.	(4,88) %	-	-	(2,10) %	(8,79) %	06.12.2019
Anteile der Klasse X (GBP) - aussch. (abgesichert) ²	(3,60) %	-	-	(0,42) %	(7,71) %	29.03.2019
Anteile der Klasse X (USD) - thes. (abgesichert)	(2,58) %	-	-	0,47 %	(6,96) %	29.03.2019
Anteile der Klasse X1 (EUR) - thes.	(4,97) %	-	-	(1,41) %	(8,88) %	29.03.2019
Anteile der Klasse X1 (USD) - thes. (abgesichert)	(2,64) %	-	-	0,38 %	(6,99) %	29.03.2019
Anteile der Klasse Z (EUR) - aussch.	(5,01) %	-	-	(2,51) %	(8,93) %	26.02.2020

¹ Besteht eine Klasse zum 31. Dezember 2022 weniger als 1 Jahr, wird die Rendite ab Auflegungsdatum bis zum 31. Dezember 2022 aufgeführt.

² Die Anteilsklasse wurde am 28. Oktober 2022 aufgelöst und am 25. November 2022 wieder eröffnet. Die historische Wertentwicklung der Klasse I (EUR) – thes. wurde während des Zeitraums der Inaktivität zur Schätzung der Wertentwicklung der Klasse X (GBP) – aussch. (abgesichert) verwendet.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Wertentwicklung (Fortsetzung)

	Renditen ohne Verkaufsgebühren			Seit Auflegungs- datum	1 Jahr (vom 01.01.2022 bis 31.12.2022) ¹	Tatsächliches Auflegungs- datum
	1 Jahr	5 Jahre	10 Jahre			
Global Equity Enhanced Income Fund						
Anteile der Klasse A (SGD) - aussch. (abgesichert)	(8,31) %	-	-	(5,20) %	(17,61) %	05.08.2021
Anteile der Klasse A (USD) - aussch.	(7,42) %	-	-	7,35 %	(16,99) %	16.07.2020
Anteile der Klasse I (USD) - aussch.	(6,77) %	-	-	8,10 %	(16,41) %	16.07.2020
Anteile der Klasse X (GBP) - brutto aussch.	(0,38) %	-	-	6,84 %	(6,07) %	19.03.2021
Anteile der Klasse X (USD) - brutto aussch.	(6,45) %	-	-	8,48 %	(16,11) %	16.07.2020
Anteile der Klasse Z (GBP) - brutto aussch.	(0,73) %	-	-	4,03 %	(6,41) %	16.07.2021
Global Factor Enhanced Equity Fund						
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	(5,57) %	-	-	8,28 %	(15,67) %	26.02.2020
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	(5,43) %	-	-	7,13 %	(15,54) %	15.03.2019
Anteile der Klasse Z (USD) - thes.	(5,42) %	-	-	8,44 %	(15,54) %	26.02.2020
Global Long/ Short Equity Fund						
Anteile der Klasse AP (USD) - thes.	(3,79) %	1,09 %	-	1,17 %	(5,23) %	20.10.2017
Anteile der Klasse IP (AUD) - aussch. (abgesichert)	(4,72) %	-	-	(2,72) %	(5,89) %	01.06.2021
Anteile der Klasse IP (EUR) - thes. (abgesichert)	(5,81) %	(0,42) %	-	(1,20) %	(6,95) %	31.01.2018
Anteile der Klasse IP (EUR) - aussch.	(1,12) %	4,51 %	-	4,35 %	1,55 %	31.07.2017
Anteile der Klasse IP (GBP) - thes.	3,23 %	4,63 %	-	3,43 %	6,92 %	31.08.2017
Anteile der Klasse IP (USD) - thes.	(3,07) %	1,90 %	-	2,72 %	(4,52) %	31.07.2017
Anteile der Klasse ZP (USD) - thes.	(3,03) %	-	-	5,86 %	(4,40) %	28.02.2020
Global Small Cap Equity Fund						
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	(4,32) %	-	-	2,88 %	(18,14) %	20.02.2020
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	(0,11) %	-	-	4,51 %	(13,84) %	20.02.2020
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	(6,20) %	-	-	3,06 %	(23,03) %	20.02.2020
Small Cap Innovation Fund						
Anteile der Klasse A (SGD) - thes. (abgesichert)	(19,90) %	-	-	(26,90) %	(39,45) %	10.12.2021
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	(18,15) %	-	-	(0,73) %	(38,14) %	20.02.2020
Anteile der Klasse X (GBP) - thes.	(12,45) %	-	-	(14,80) %	(30,42) %	26.02.2021
Anteile der Klasse Z (EUR) - thes. (abgesichert)	(21,31) %	-	-	(3,30) %	(40,55) %	20.02.2020
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	(12,84) %	-	-	0,65 %	(30,75) %	20.02.2020
Anteile der Klasse Z (USD) - thes.	(18,15) %	-	-	(0,73) %	(38,14) %	20.02.2020

¹ Besteht eine Klasse zum 31. Dezember 2022 weniger als 1 Jahr, wird die Rendite ab Auflegungsdatum bis zum 31. Dezember 2022 aufgeführt.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Wertentwicklung (Fortsetzung)

	Renditen ohne Verkaufsgebühren				1 Jahr (vom 01.01.2022 bis 31.12.2022) ¹	Tatsächliches Auflegungs- datum
	1 Jahr	5 Jahre	10 Jahre	Seit Auflegungs- datum		
U.S. All Cap Growth Fund						
Anteile der Klasse A (EUR) - thes. (abgesichert)	(20,13) %	-	-	5,18 %	(40,00) %	16.11.2018
Anteile der Klasse A (GBP) - thes.	(11,55) %	10,21 %	12,35 %	15,64 %	(30,24) %	02.04.2009
Anteile der Klasse A (SGD) - thes. (abgesichert)	(18,00) %	-	-	4,08 %	(38,42) %	28.02.2020
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	(16,94) %	7,41 %	10,03 %	9,80 %	(37,69) %	02.05.2008
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	(14,56) %	11,08 %	12,83 %	13,38 %	(33,17) %	02.05.2008
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	(19,44) %	-	-	2,43 %	(39,50) %	06.12.2019
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	(10,81) %	11,14 %	13,30 %	16,61 %	(29,66) %	02.04.2009
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	(16,24) %	8,31 %	10,96 %	10,71 %	(37,17) %	02.05.2008
Anteile der Klasse Y (EUR) - thes.	(14,36) %	-	-	(4,14) %	(33,02) %	14.12.2020
Anteile der Klasse Z (EUR) - thes. (abgesichert)	(19,49) %	5,37 %	-	4,70 %	(39,57) %	31.01.2018
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	(10,84) %	11,10 %	13,26 %	14,34 %	(29,68) %	31.10.2012
Anteile der Klasse Z (GBP) - aussch.	(10,83) %	11,10 %	-	13,03 %	(29,67) %	13.01.2014
Anteile der Klasse Z (USD) - thes.	(16,27) %	8,27 %	10,91 %	11,42 %	(37,19) %	31.10.2012
Anteile der Klasse Z (USD) - aussch.	(16,27) %	8,27 %	-	9,65 %	(37,19) %	29.05.2015
U.S. Large Cap Growth Fund						
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	(16,63) %	9,30 %	11,23 %	8,32 %	(34,39) %	01.04.2008
Anteile der Klasse I (EUR) - thes.	(14,10) %	13,08 %	14,07 %	11,96 %	(29,09) %	01.04.2008
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	(15,93) %	10,22 %	12,16 %	9,25 %	(33,83) %	01.04.2008
Anteile der Klasse Z (GBP) - thes.	(10,51) %	13,01 %	14,44 %	16,12 %	(25,95) %	31.10.2012
U.S. Select Equity Fund						
Anteile der Klasse A (EUR) - thes.	(9,80) %	7,50 %	-	6,24 %	(12,47) %	30.01.2015
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	(11,57) %	4,84 %	-	5,72 %	(17,69) %	30.01.2015
Anteile der Klasse I (GBP) - thes.	(5,17) %	-	-	14,12 %	(7,20) %	26.02.2020
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	(10,94) %	5,66 %	-	6,57 %	(17,11) %	30.01.2015
Anteile der Klasse Z (USD) - aussch.	(11,07) %	5,81 %	-	6,78 %	(17,08) %	30.01.2015
U.S. Short-Term High Yield Bond Fund						
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	(0,35) %	2,70 %	2,09 %	2,21 %	(4,08) %	29.06.2012
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	(2,51) %	-	-	(1,52) %	(5,75) %	21.05.2021
Anteile der Klasse I (EUR) - aussch. (abgesichert)	(2,46) %	1,19 %	-	1,33 %	(5,77) %	31.07.2013
Anteile der Klasse I (GBP) - aussch. (abgesichert)	(0,91) %	2,29 %	-	2,16 %	(4,40) %	31.07.2013
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	0,16 %	3,42 %	2,88 %	3,00 %	(3,61) %	29.06.2012
Anteile der Klasse I (USD) - brutto aussch.	0,05 %	3,44 %	-	3,29 %	(3,71) %	29.02.2016

¹ Besteht eine Klasse zum 31. Dezember 2022 weniger als 1 Jahr, wird die Rendite ab Auflegungsdatum bis zum 31. Dezember 2022 aufgeführt.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Wertentwicklung (Fortsetzung)

	Renditen ohne Verkaufsgebühren				1 Jahr (vom 01.01.2022 bis 31.12.2022) ¹	Tatsächliches Auflegungs- datum
	1 Jahr	5 Jahre	10 Jahre	Seit Auflegungs- datum		
USD Investment Grade Credit Fund						
Anteile der Klasse A (USD) - thes.	(6,98) %	1,24 %	-	1,78 %	(16,51) %	15.12.2016
Anteile der Klasse A (USD) - aussch.	(6,98) %	-	-	(3,24) %	(16,48) %	24.02.2020
Anteile der Klasse I (EUR) - thes. (abgesichert)	(9,08) %	-	-	(6,41) %	(18,00) %	31.08.2020
Anteile der Klasse I (EUR) - aussch. (abgesichert)	(9,02) %	(0,47) %	-	0,06 %	(17,94) %	15.12.2016
Anteile der Klasse I (GBP) - aussch. (abgesichert)	(7,63) %	-	-	(3,58) %	(16,81) %	24.02.2020
Anteile der Klasse I (JPY) - thes. (abgesichert)	(10,06) %	-	-	(0,27) %	(18,30) %	22.01.2019
Anteile der Klasse I (SGD) - thes. (abgesichert)	(6,97) %	-	-	(0,89) %	(16,27) %	02.08.2019
Anteile der Klasse I (USD) - thes.	(6,52) %	1,76 %	-	2,30 %	(16,08) %	15.12.2016
Anteile der Klasse I (USD) - aussch.	(6,51) %	1,76 %	-	2,29 %	(16,08) %	15.12.2016
Anteile der Klasse Y (EUR) - thes. (abgesichert)	(8,90) %	-	-	(6,74) %	(17,85) %	19.10.2020
Anteile der Klasse Y (EUR) - brutto aussch. (abgesichert)	(9,08) %	(0,42) %	-	(0,91) %	(17,98) %	18.12.2017
Anteile der Klasse Y (USD) - brutto aussch.	(6,47) %	1,81 %	-	1,46 %	(16,03) %	24.08.2017
Anteile der Klasse Z (EUR) - aussch. (abgesichert)	(9,05) %	-	-	(4,48) %	(17,93) %	24.02.2020
Anteile der Klasse Z (USD) - aussch.	(6,50) %	-	-	(2,75) %	(16,07) %	24.02.2020

¹ Besteht eine Klasse zum 31. Dezember 2022 weniger als 1 Jahr, wird die Rendite ab Auflegungsdatum bis zum 31. Dezember 2022 aufgeführt.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Risikomanagement

Der Fonds und die Verwaltungsgesellschaft wenden ein Risikomanagementverfahren gemäß den ESMA-Leitlinien 10-788, den CSSF-Rundschreiben 11/512 und 18/698 oder einer jeweiligen Änderung oder Ersetzung derselben sowie Kapitel VI der CSSF-Verordnung 10-4 an, das es ihnen ermöglicht, zusammen mit dem Anlageverwalter jederzeit das Risiko der Positionen und deren Beitrag zum Gesamtrisikoprofil jedes Teilfonds zu überwachen und zu messen. Die Verwaltungsgesellschaft wendet ein Verfahren zur exakten und unabhängigen Beurteilung des Wertes von OTC-Derivaten an. Sie übermittelt der CSSF regelmäßig und unter Einhaltung der ausführlichen Vorgaben des CSSF Informationen über die Arten von derivativen Instrumenten, die zugrunde liegenden Risiken, die quantitativen Beschränkungen und die Methoden zur Bewertung der mit Transaktionen mit derivativen Instrumenten verbundenen Risiken.

Der Risikomanagement-Ansatz und die Value-at-Risk-Grenzen lauten wie folgt:

	Verwendeter Ansatz	VaR-Grenze*
2 Degree Global Equity Fund	Engagements	-
Alternative Risk Premia Fund	Absoluter VaR	20 %
China A Focus Fund	Engagements	-
Climate Focused Emerging Markets Equity Fund	Engagements	-
Climate Focused Global Equity Fund	Engagements	-
Climate Focused U.S. Equity Fund	Engagements	-
Climate Transition Global Investment Grade Credit Fund	Engagements	-
Emerging Markets Equity Fund	Engagements	-
Emerging Markets Equity Income Fund	Engagements	-
EUR Investment Grade Credit Fund	Engagements	-
EUR Short Duration Credit Fund	Absoluter VaR	20 %
Global Equity Enhanced Income Fund	Engagements	-
Global Factor Enhanced Equity Fund	Engagements	-
Global Long/ Short Equity Fund	Absoluter VaR	20 %
Global Small Cap Equity Fund	Engagements	-
Small Cap Innovation Fund	Engagements	-
U.S. All Cap Growth Fund	Engagements	-
U.S. Large Cap Growth Fund	Engagements	-
U.S. Select Equity Fund	Engagements	-
U.S. Short-Term High Yield Bond Fund	Engagements	-
USD Investment Grade Credit Fund	Engagements	-

* Der VaR wird auf der Grundlage eines Konfidenzintervalls von 99 % und einer Haltedauer von einem Monat bzw. 20 Geschäftstagen in Luxemburg ermittelt.

Der erwartete Hebelungsfaktor der Teilfonds basiert auf dem Value-at-Risk-Ansatz und wird als Summe der absoluten Nominalwerte der verwendeten Derivate berechnet (die „Methode der Summe der Nominalwerte“). Bei dieser Berechnung werden alle individuellen Hebelungsfaktoren, die durch jedes einzelne durch den Teilfonds genutzte derivative Instrument entstehen, zusammengerechnet. Da die Methode der Summe der Nominalwerte nicht hinsichtlich der beabsichtigten Nutzung eines Derivats unterscheidet, kann der nachstehend angegebene Hebelungswert einen falschen Eindruck hinsichtlich des Risikoprofils eines Teilfonds vermitteln, da bestimmte derivative Instrumente zu Absicherungszwecken verwendet werden und daher eigentlich das Gesamtrisiko des Teilfondsportfolios senken können.

Um das Anlageziel zu erreichen, kann der betreffende Unteranlageverwalter (ohne Beschränkungen) Futures und Devisenterminkontrakte, Optionen, Swap-Vereinbarungen und sonstige derivative Finanzinstrumente einsetzen, sofern und wie in den Informationen zum Teilfonds beschrieben und vorbehaltlich der im Verkaufsprospekt aufgeführten Beschränkungen. Anleger werden auf die Abschnitte „TECHNIKEN UND INSTRUMENTE“ sowie „RISIKOWARNUNGEN“ des Prospekts verwiesen, die weitere Informationen zum Einsatz von Derivaten enthalten.

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Risikomanagement (Fortsetzung)

	Erwarteter Hebelungswert (Summe Nominalwert-Methode)
Alternative Risk Premia Fund	400-1200 %
EUR Short Duration Credit Fund	150 %
Global Long/ Short Equity Fund	30-60 %

Die oben aufgeführten Beträge sind Schätzungen der Hebelungswerte der Teilfonds unter normalen Marktbedingungen. Höhere Hebelungswerte sind in Zeiten möglich, in denen sich der Auslauf bestimmter Derivatekontrakte mit der Ausführung oder Verlängerung neuer Kontrakte überschneidet (z. B. Devisentermingeschäfte, Roll-over-Transaktionen) sowie in Phasen hoher Marktvolatilität.

Da die Methodik der „Summe der Nominalwerte“ nicht zwischen für Anlagezwecke verwendeten Derivaten und für Absicherungszwecke verwendeten Derivaten unterscheidet, wird der erwartete Hebelungsfaktor der entsprechenden Teilfonds ebenfalls anhand des Commitment-Ansatzes berechnet, bei dem bestimmte, für Absicherungszwecke verwendete Derivate von dem in der obigen Tabelle angegebenen Wert saldiert werden.

	Erwartete Hebelwirkung (Commitment-Ansatz)
Alternative Risk Premia Fund	400-1200 %
EUR Short Duration Credit Fund	100 %
Global Long/ Short Equity Fund	30-60 %

Auf Anfrage stellt die Verwaltungsgesellschaft Anlegern ergänzende Informationen über die quantitativen Beschränkungen und Qualitätskriterien, die im Rahmen des Risikomanagements für die Teilfonds gelten, die zu diesem Zweck gewählten Methoden und die aktuelle Entwicklung der Risiken und Renditen in den Hauptkategorien der Instrumente zur Verfügung.

Die Angaben zur VaR-Nutzung für den betreffenden Teilfonds lauten wie folgt:

	Geringste Nutzung	Höchste Nutzung	Durchschnittliche Nutzung
Alternative Risk Premia Fund	2,58 %	7,82 %	3,84 %
EUR Short Duration Credit Fund	1,30 %	2,70 %	2,20 %
Global Long/ Short Equity Fund	5,04 %	9,14 %	6,90 %
Systeme:	FactSet		
VaR-Methode:	Monte Carlo		
Konfidenzniveau:	99 %		
Haltedauer:	20 Tage		
Beobachtungszeitraum:	3 Jahre		

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Die Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 25. November 2015 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung („SFT-Verordnung“) führte Berichtspflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT“), Total Return Swaps und alle als Sicherheiten erhaltenen Finanzinstrumente, die weiterverwendet werden sollen, ein.

Zu den SFT gemäß der Definition in Artikel 3(11) der SFT-Verordnung gehören:

- Wertpapierpensionsgeschäfte und umgekehrte Wertpapierpensionsgeschäfte,
- Wertpapier- oder Warenverleihgeschäfte bzw. Wertpapier- oder Warenentleihgeschäfte,
- Kauf-/Rückverkaufgeschäfte oder Verkauf-/Rückkaufgeschäfte und
- Lombardgeschäfte

Zum 31. März 2023 hielten der **Alternative Risk Premia Fund** und der **Global Long/Short Equity Fund** Differenzkontrakte. Der **Alternative Risk Premia Fund** hielt einen Total Return Swap, für den die SFT-Verordnung gilt.

Allgemeine Angaben

Der Wert der Vermögenswerte, für die Offenlegungspflichten gemäß der SFT-Verordnung gelten, betrug zum 31. März 2023:

Gattungsbezeichnung		Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) USD	% des Nettovermögens
Alternative Risk Premia Fund	Differenzkontrakte	50.819	0,14
Global Long/ Short Equity Fund	Differenzkontrakte	(1.617.095)	(1,26)
Alternative Risk Premia Fund	Total Return Swaps	46.805	0,13

Angaben zur Konzentration

Wertpapiere, die als Sicherheit für Differenzkontrakte verpfändet werden, sind im Anlagenspiegel des jeweiligen Teilfonds aufgeführt. Zum 31. März 2023 belief sich der Gesamtwert dieser Wertpapiere, die in ihrer Beschreibung im Anlagenspiegel des jeweiligen Teilfonds mit „+“ gekennzeichnet sind, auf 100.916.183 USD.

Die Emittenten von erhaltenen/verpfändeten Sicherungswertpapieren zum 31. März 2023 sind nachstehend aufgeführt:

Emittent der Sicherheit	Erhalten / verpfändet	Betrag der Sicherheit USD
Alternative Risk Premia Fund		
United States Government Securities	Verpfändet	2.199.093
Global Long/ Short Equity Fund		
Stammaktien	Verpfändet	76.361.533

Die Kontrahenten zum 31. März 2023 sind nachstehend aufgeführt:

	Kontrahent	Marktwert USD
Alternative Risk Premia Fund	Goldman Sachs International	50.819
Global Long/ Short Equity Fund	Goldman Sachs International	(1.617.095)

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Fortsetzung)**Verwahrung der verpfändeten Sicherheiten**

Zum 31. März 2023 wurden folgenden Sicherheiten verpfändet:

Verwahrstelle	Betrag der Sicherheit USD
Alternative Risk Premia Fund	
Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. United States Government Securities	2.199.093
Goldman Sachs International Barsicherheiten	2.700.000
Global Long/ Short Equity Fund	
Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. Stammaktien	76.361.533

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten

Es gab keine Sicherheitenwertpapiere, die während des Geschäftsjahres zum 31. März 2023 weiterverwendet wurden.

Renditen

Im Geschäftsjahr zum 31. März 2023 gab es keine Renditen aus umgekehrten Pensionsgeschäften.

Die Erträge für die Differenzkontrakte im Alternative Risk Premia Fund und im Global Long/Short Equity Fund gelten als der realisierte Nettogewinn/(-verlust) aus Differenzkontrakten und die Nettoänderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus Differenzkontrakten während des Berichtszeitraums. Die Transaktionskosten lassen sich nicht getrennt ausweisen. Die Erträge für den Total Return Swap im Alternative Risk Premia Fund gelten als der realisierte Nettogewinn/(-verlust) aus Swap-Kontrakten und die Nettoänderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus Swap-Kontrakten während des Berichtszeitraums.

Aggregierte Transaktionsdaten

Die gesamten Transaktionsdaten aller Sicherheiten zum 31. März 2023 sind nachstehend aufgeführt:

Kontrahent	Art der Sicherheit	Betrag der Sicherheit	Währung	Qualität der Sicherheiten	Laufzeit der Sicherheit	Land des Kontrahenten	Abwicklung und Clearing
Alternative Risk Premia Fund							
Goldman Sachs International	United States Treasury Securities	678.509	USD	Aaa	Mehr als drei Monate	Vereinigtes Königreich	Bilateral
Goldman Sachs International	United States Treasury Securities	1.520.584	USD	Aaa	Über ein Monat	Vereinigtes Königreich	Bilateral
Goldman Sachs International	Barsicherheiten	2.700.000	USD	-	-	Vereinigtes Königreich	Bilateral
Global Long/ Short Equity Fund							
Goldman Sachs International	Stammaktien	76.361.533	USD	-	-	Vereinigtes Königreich	Bilateral

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor

Teilfonds gemäß Artikel 6 der Offenlegungsverordnung

Die den folgenden Teilfonds zugrunde liegenden Anlagen berücksichtigen nicht die Kriterien der Europäischen Union („EU“) für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten. Die Teilfonds wurden mit Wirkung zum 10. März 2021 zu Teilfonds gemäß Artikel 6 der Offenlegungsverordnung („SFDR“).

Teilfonds	Auflegungsdatum
Alternative Risk Premia Fund	09.12.2019
China A Focus Fund	30.01.2009
Global Factor Enhanced Equity Fund	15.03.2019
Global Long/ Short Equity Fund	16.07.2020
Small Cap Innovation Fund	26.02.2020
U.S. Large Cap Growth Fund	01.04.2008
U.S. Select Equity Fund	30.01.2015
U.S. Short-Term High Yield Bond Fund	29.06.2012

2 Degree Global Equity Fund, Alternative Risk Premia Fund, China A Focus Fund, Climate Focused Emerging Markets Equity Fund, Climate Focused Global Equity Fund, Climate Focused U.S. Equity Fund, EUR Short Duration Credit Fund und Global Equity Enhanced Income Fund wurden von der Hong Kong Securities and Futures Commission nicht zugelassen und stehen privaten Anlegern in Hongkong nicht zur Anlage zur Verfügung.

Teilfonds gemäß Artikel 8 der Offenlegungsverordnung

Name des Produkts: 2 Degree Global Equity Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code): 254900PQTNBAWE5T9H83

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

- | | |
|--|---|
| <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: % | <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen. |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind | <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind |
| <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: % | <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel |
| | <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt. |

**Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?**

Der Teilfonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Anlage in Unternehmen, die mit einem durchschnittlichen globalen Temperaturanstieg von 2 Grad Celsius oder weniger in Einklang stehen.
- Anwendung der zentralen Ausschlüsse und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Unteranlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf

<https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt

Mit Ausnahme der beiden nachstehend aufgeführten passiven Verstöße erfüllte der Teilfonds im Berichtszeitraum die oben genannten von ihm beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Beworbene E/S-Merkmale / Nachhaltigkeitsindikatoren	Wertentwicklung
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Anlage in Unternehmen, die mit einem durchschnittlichen globalen Temperaturanstieg von 2 Grad Celsius oder weniger in Einklang stehen</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Daten zur Klimaausrichtung von einem unabhängigen externen Datenanbieter</p>	<p>Mit Ausnahme der drei nachstehend aufgeführten passiven Verstöße investierte der Teilfonds nur in Unternehmen, die während des Bezugszeitraums mit einem durchschnittlichen globalen Temperaturanstieg von 2 Grad Celsius oder weniger in Einklang standen.</p> <p>Am 30. April 2022 verstieß der Teilfonds passiv gegen diese Vorgabe, als ein unabhängiger externer Datenanbieter meldete, dass ein im Portfolio gehaltenes Wertpapier die Zwei-Grad-Ausrichtung nicht mehr erfüllte. Dieser passive Verstoß führte zu einem Engagement von 0,18 % in einem Unternehmen ohne Zwei-Grad-Ausrichtung. Die betreffenden Wertpapiere wurden innerhalb von zehn (10) Geschäftstagen veräußert.</p> <p>Am 30. Juni 2022 verstieß der Teilfonds passiv gegen diese Vorgabe, als ein unabhängiger externer Datenanbieter meldete, dass zwei im Portfolio gehaltene Wertpapiere die Zwei-Grad-Ausrichtung nicht mehr erfüllten. Dieser passive Verstoß führte zu einem Engagement von 1,28 % in Unternehmen ohne Zwei-Grad-Ausrichtung. Eines der betreffenden Wertpapiere wurde innerhalb von 10 Geschäftstagen verkauft. Das zweite betreffende Wertpapier wurde nach einer Kapitalmaßnahme am 4. August 2022 verkauft.</p>
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Anwendung der zentralen Ausschlüsse und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Untermanagers, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf https://www.allspringglobal.com/assets/docs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf dargelegt</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Daten zur Produktbeteiligung und zur Prüfung der Einhaltung globaler Standards von einem unabhängigen Datenanbieter</p>	<p>Der Teilfonds erfüllte während des Bezugszeitraums seine spezifischen Ausschlusskriterien und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien (wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds dargelegt).</p>

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Entfällt, da es sich um den ersten Bezugszeitraum für die periodische Berichterstattung gemäß Delegierter Verordnung zur SFDR handelt.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

→ **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

→ **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Details:**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Während des Bezugszeitraums berücksichtigte der Teilfonds bestimmte wichtigste nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er Unternehmen aus dem Portfolio ausschloss, entweder weil sie unter die in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegten zentralen Ausschlüsse und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Unteranlageverwalters fielen, oder weil die Unternehmen in Bezug auf ihre Treibhausgasemissionen nicht auf die Begrenzung des durchschnittlichen globalen Temperaturanstiegs auf 2 Grad Celsius oder ein besseres Ergebnis ausgerichtet waren (mit Ausnahme der beiden oben genannten passiven Verstöße).

Anlageentscheidungen beruhen jedoch nicht ausschließlich auf der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, sondern auf verschiedenen Faktoren, die während der Anlageanalyse berücksichtigt wurden.



Was waren die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 1. April 2022 – 31. März 2023

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Alphabet Inc. Class C	Kommunikationsdienstleistungen	3,66	Vereinigte Staaten
Visa Inc. Klasse A	Finanzen	2,21	Vereinigte Staaten
UnitedHealth Group Incorporated	Gesundheitswesen	2,15	Vereinigte Staaten
Berkshire Hathaway Inc. Klasse B	Finanzen	1,91	Vereinigte Staaten
Gilead Sciences, Inc.	Gesundheitswesen	1,80	Vereinigte Staaten
Elevance Health, Inc.	Gesundheitswesen	1,76	Vereinigte Staaten
Bristol-Myers Squibb Company	Gesundheitswesen	1,74	Vereinigte Staaten
McDonald's Corporation	Zyklische Konsumgüter	1,69	Vereinigte Staaten
Publicis Groupe SA	Kommunikationsdienstleistungen	1,69	Frankreich
Siemens Aktiengesellschaft	Industrie	1,68	Deutschland
CVS Health Corporation	Gesundheitswesen	1,67	Vereinigte Staaten
JPMorgan Chase & Co.	Finanzen	1,61	Vereinigte Staaten
Loblaw Companies Limited	Basiskonsumgüter	1,56	Kanada
Flex Ltd.	Informationstechnologie	1,51	Vereinigte Staaten
NVIDIA Corporation	Informationstechnologie	1,51	Vereinigte Staaten

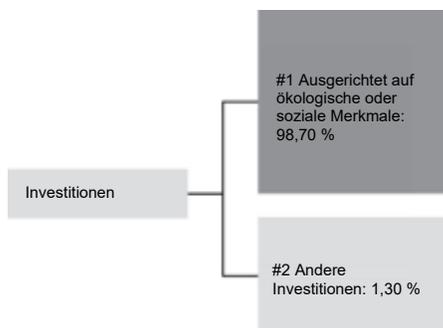


Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

98,7 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Anlagen mit Ausrichtung auf die während des Bezugszeitraums beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale. Die übrigen 1,3 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Barmitteln oder barmittelähnlichen Instrumenten.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% der Vermögenswerte
Barmittel	1,31
Kommunikationsdienstleistungen	9,43
Zyklische Konsumgüter	8,74
Basiskonsumgüter	5,38
Finanzen	20,84
Gesundheitswesen	15,90
Industrie	11,37
Informationstechnologie	17,24
Grundstoffe	3,54
Sonstige	-0,03
Immobilien	3,86
Versorgung	2,42

„Andere Investitionen“ umfasst Positionen in Futures-Instrumenten innerhalb des Portfolios, die keine ökologischen oder sozialen Merkmale bewerben.



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**¹

Ja

In fossiles Gas

In Kernenergie

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten sind Wirtschaftstätigkeiten**, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonmiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonmiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

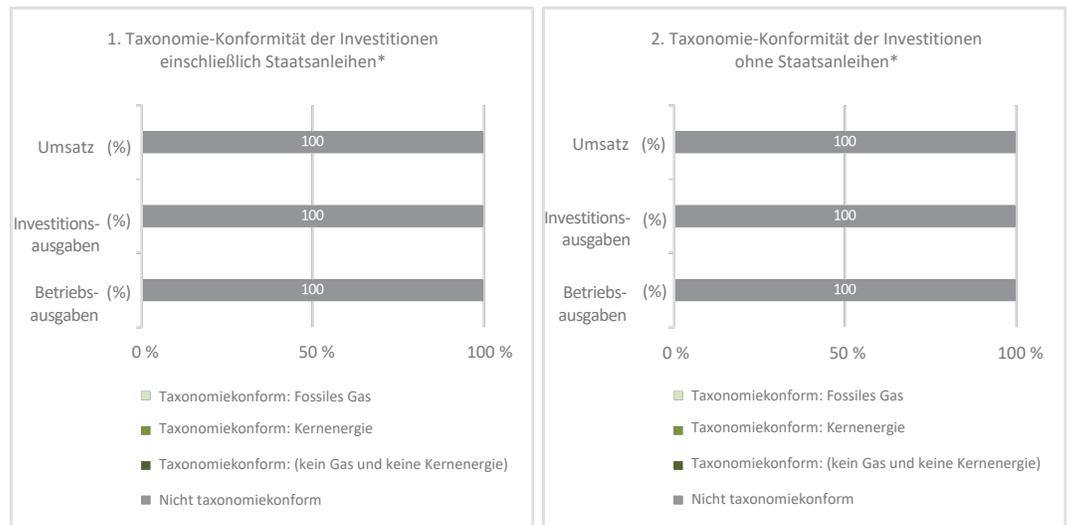
Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

X Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.



Wie hoch war Anteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Anlagen in Barmitteln oder bargeldähnlichen Instrumenten sowie Derivaten wurden unter „Andere Investitionen“ aufgeführt. Die vom Finanzprodukt gehaltenen liquiden Mittel oder bargeldähnlichen Instrumente sowie Derivate wurden im Einklang mit den für Liquiditätsreserven geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben zur Absicherung und/oder zur effizienten Portfolioverwaltung eingesetzt. Auf die im Finanzprodukt gehaltenen Barmittel oder bargeldähnlichen Instrumente und Derivate wurde kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz angewandt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Unteranlageverwalter hat die in den Abschnitten „Überwachung ökologischer oder sozialer Merkmale“, „Methoden“ und „Datenquellen und Datenverarbeitung“ der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds (zu finden auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf>) beschriebenen Maßnahmen ergriffen, die dazu führten, dass der Teilfonds die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Bezugszeitraum wie folgt erreichte:

- Anlage in Unternehmen, die mit einem durchschnittlichen globalen Temperaturanstieg von 2 Grad Celsius oder weniger in Einklang stehen.
- Anwendung der zentralen Ausschlüsse und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Unteranlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf

<https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt

Passive Verstöße und Korrekturmaßnahmen: Am 30. April 2022 verstieß der Teilfonds passiv gegen diese Vorgabe, als ein unabhängiger externer Datenanbieter meldete, dass ein im Portfolio gehaltenes Wertpapier seiner Bewertung nach die Zwei-Grad-Ausrichtung nicht mehr erfüllte. Das Anlageteam verkaufte daraufhin das betreffende Wertpapier innerhalb von zehn Geschäftstagen.

Am 30. Juni 2022 verstieß der Teilfonds passiv gegen diese Vorgabe, als zwei im Portfolio gehaltene Wertpapiere nach Einschätzung der unabhängigen Drittpartei die Zwei-Grad-Ausrichtung nicht mehr erfüllten. Eines der betreffenden Wertpapiere wurde innerhalb von 10 Geschäftstagen verkauft. Das zweite betreffende Wertpapier wurde nach einer Kapitalmaßnahme am 4. August 2022 verkauft.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Name des Produkts: Climate Focused Emerging Markets Equity Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code): 2549007NJJJD60CU3GX98

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: %

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen** getätigt.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Teilfonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Zielvorgabe einer CO₂-Bilanz und CO₂-Intensität, die insgesamt mindestens 30 % unter denen des MSCI Emerging Markets Index liegen.
- Zielvorgabe eines gegenüber dem MSCI Emerging Markets Index besseren Energiemix (d. h. höherer Anteil der Energieerzeugung aus erneuerbaren Energien und geringere Emissionsreserve)
- Anwendung der zentralen Ausschlüsse und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Untereinlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf

<https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt

Mit Ausnahme des nachstehend aufgeführten passiven Verstoßes erfüllte der Teilfonds während des gesamten Berichtszeitraums die oben genannten von ihm beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Beworbene E/S-Merkmale / Nachhaltigkeitsindikatoren	Wertentwicklung
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Zielvorgabe einer CO2-Bilanz¹ und CO2-Intensität des Portfolios, die insgesamt mindestens 30 % unter denen des MSCI Emerging Markets Index liegen</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Klimabezogene Daten von einem unabhängigen externen Datenanbieter</p>	<p>Der Teilfonds erzielte während des Bezugszeitraums insgesamt eine mindestens 30 % bessere CO2-Bilanz und geringere CO2-Intensität als der MSCI Emerging Markets Index.</p>
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Zielvorgabe eines gegenüber dem MSCI Emerging Markets Index besseren Energiemix (d. h. höherer Anteil der Energieerzeugung aus erneuerbaren Energien und geringere Emissionsreserve)</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Klimabezogene Daten von einem unabhängigen externen Datenanbieter</p>	<p>Der Teilfonds erzielte während des Bezugszeitraums durchgängig einen besseren Energiemix als der MSCI Emerging Markets Index (d. h. höherer Anteil der Energieerzeugung aus erneuerbaren Energien und geringere Emissionsreserve).</p>
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Anwendung der zentralen Ausschlüsse und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Untieranlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf dargelegt</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Daten zur Produktbeteiligung und zur Prüfung der Einhaltung globaler Standards von einem unabhängigen Datenanbieter</p>	<p>Mit Ausnahme des nachstehend aufgeführten passiven Verstoßes erfüllte der Teilfonds während des Bezugszeitraums die zentralen spezifischen Ausschlusskriterien und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Untieranlageverwalters (wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds dargelegt). Am 31. August 2022 verstieß der Teilfonds passiv gegen seine Vorgaben, als der unabhängige externe Datenanbieter drei zuvor vom Teilfonds gehaltene Wertpapiere in seine Liste der Verletzer des UN Global Compact aufnahm. Infolgedessen erfüllten 5,1 % der gehaltenen Anlagen des Teilfonds nicht die vom Teilfonds beworbenen Hauptausschlusskriterien. Der Untieranlageverwalter verkaufte daraufhin die drei betreffenden Wertpapiere innerhalb von zehn (10) Geschäftstagen.</p>

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Entfällt, da es sich um den ersten Bezugszeitraum für die periodische Berichterstattung gemäß Delegierter Verordnung zur SFDR handelt.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

¹ Die CO2-Bilanz ist ein Maß für die Menge der von den zugrunde liegenden Unternehmen ausgestoßenen Treibhausgase und wird als „Kohlendioxid-Äquivalente“ (in Tonnen) angegeben. Die Kohlenstoffintensität ist ein Maß für die Gesamtemissionen pro Umsatz. Der Energiemix gibt an, welche Energiearten Unternehmen zu welchen Anteilen nutzen, und nennt den Umfang der Emissionsreserven für Unternehmen, die einen Teil ihres CO2-Budgets noch nicht genutzt haben.

- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Details:**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?



Das Portfolio des Teilfonds erzielte während des Bezugszeitraums eine mindestens 30 % bessere CO2-Bilanz und geringere CO2-Intensität als der MSCI Emerging Markets Index und wies einen besseren Energiemix und geringere Emissionen fossiler Brennstoffe auf als dieser Referenzwert. Aufgrund der CO2-Beschränkungen auf Portfolioebene investierte das Portfolio im Durchschnitt stärker in Unternehmen mit geringeren Emissionen. Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren wurden in dieser Form berücksichtigt. Der Teilfonds berücksichtigte darüber hinaus andere wichtigste nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er Unternehmen aus dem Portfolio ausschloss, die unter die zentralen spezifischen Ausschlusskriterien und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Untermanagerverwalters fielen, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf

<https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt. Dies bezieht sich nicht auf den im Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“ genannten passiven Verstoß gegen die Nachhaltigkeitsvorgaben.

Anlageentscheidungen beruhten jedoch nicht ausschließlich auf der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, sondern auf verschiedenen Faktoren, die während der Anlageanalyse berücksichtigt wurden.



Die Liste umfasst die Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 1. April 2022 – 31. März 2023

Was waren die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	Informationstechnologie	5,70	Taiwan
iShares MSCI India UCITS ETF	Diversifiziert	4,96	Indien
Samsung Electronics Co., Ltd.	Informationstechnologie	3,69	Korea
Lyxor MSCI India UCITS ETF EUR (Acc)	Diversifiziert	2,75	Indien
Alibaba Group Holding Limited	Zyklische Konsumgüter	2,68	China/Hongkong
Tencent Holdings Ltd.	Kommunikationsdienstleistungen	1,93	China/Hongkong
Infosys Limited Sponsored ADR	Informationstechnologie	1,83	Indien
China Construction Bank Corporation Klasse H	Finanzen	1,57	China/Hongkong
Petroleo Brasileiro SA Pfd	Energie	1,33	Brasilien
ICICI Bank Limited Sponsored ADR	Finanzen	1,27	Indien
Samsung Electronics Co Ltd Pfd Non-Voting	Informationstechnologie	1,06	Korea
Mahindra & Mahindra Ltd. Sponsored GDR RegS	Zyklische Konsumgüter	1,02	Indien
Industrial and Commercial Bank of China Limited Klasse H	Finanzen	0,98	China/Hongkong
Meituan Klasse B	Zyklische Konsumgüter	0,96	China/Hongkong
Netease Inc	Kommunikationsdienstleistungen	0,94	China/Hongkong

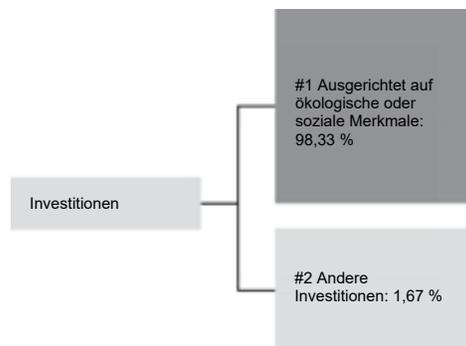


Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

98,33 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Anlagen mit Ausrichtung auf die während des Bezugszeitraums beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale. Die übrigen 1,67 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Barmitteln oder barmittelähnlichen Instrumenten.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% der Vermögenswerte
Barmittel	1,67
Kommunikationsdienstleistungen	8,37
Zyklische Konsumgüter	12,56
Basiskonsumgüter	7,02
Diversifiziert	8,55
Energie	3,61
Finanzen	19,15
Gesundheitswesen	4,40
Industrie	4,86
Informationstechnologie	19,92
Grundstoffe	6,05
Immobilien	1,06
Versorgung	2,79

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**²

Ja

In fossiles Gas In Kernenergie

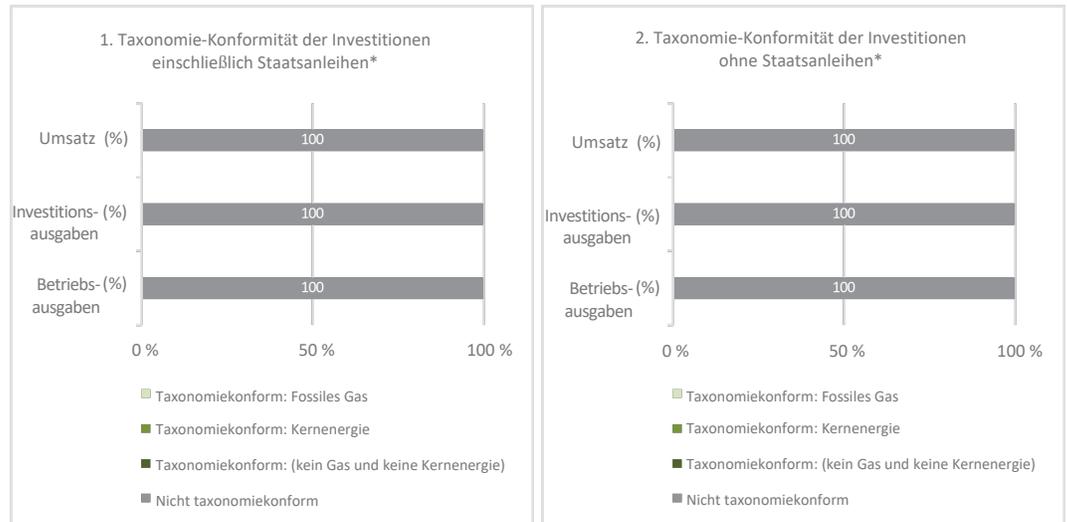
Nein

² Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

🕒 **Wie hoch war Anteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

👤 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

🌍 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Anlagen in Barmitteln oder bargeldähnlichen Instrumenten wurden unter „Andere Investitionen“ aufgeführt. Die vom Finanzprodukt gehaltenen liquiden Mittel oder bargeldähnlichen Instrumente wurden im Einklang mit den für Liquiditätsreserven geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben zur effizienten Portfolioverwaltung eingesetzt. Auf die im Finanzprodukt gehaltenen Barmittel oder bargeldähnlichen Instrumente wurde kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz angewandt.

🕒 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Untereinlageverwalter hat die in den Abschnitten „Überwachung ökologischer oder sozialer Merkmale“, „Methoden“ und „Datenquellen und Datenverarbeitung“ der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds (zu finden auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf>) beschriebenen Maßnahmen ergriffen, die dazu führten, dass der Teilfonds die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Bezugszeitraum wie folgt erreichte:

- Aufrechterhaltung einer CO₂-Bilanz und CO₂-Intensität, die insgesamt mindestens 30 % unter denen des MSCI Emerging Markets Index lagen.
- Erzielung eines gegenüber dem MSCI Emerging Markets Index besseren Energiemix (d. h. höherer Anteil der Energieerzeugung aus erneuerbaren Energien und geringere Emissionsreserve)
- Anwendung der zentralen Ausschlüsse und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Untereinlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf

<https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt

Passive Verstöße und Korrekturmaßnahmen: Am 31. August 2022 verstieß der Teilfonds passiv gegen seine Vorgaben, als der unabhängige externe Datenanbieter drei zuvor vom Teilfonds gehaltene Wertpapiere in seine Liste der Verletzer des UN Global Compact aufnahm. Infolgedessen erfüllten 5,1 % der gehaltenen Anlagen des Teilfonds nicht die vom Teilfonds beworbenen Hauptausschlusskriterien. Der Untereinlageverwalter verkaufte daraufhin die drei betreffenden Wertpapiere innerhalb von zehn (10) Geschäftstagen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Name des Produkts: Climate Focused Global Equity Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code): 254900IAK4NQB41V8383

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

- | | |
|---|--|
| <p><input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: %</p> <p><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: %</p> | <p><input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.</p> <p><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</p> <p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.</p> |
|---|--|

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Teilfonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Zielvorgabe einer CO2-Bilanz und CO2-Intensität des Portfolios, die insgesamt mindestens 30 % unter denen des MSCI World Index liegen.
- Zielvorgabe eines gegenüber dem MSCI World Index besseren Energiemix (d. h. höherer Anteil der Energieerzeugung aus erneuerbaren Energien und geringere Emissionsreserve)
- Anwendung der zentralen Ausschlüsse und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Untereinlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf

<https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt

Mit Ausnahme des nachstehend aufgeführten passiven Verstoßes erfüllte der Teilfonds während des gesamten Berichtszeitraums die oben genannten von ihm beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Beworbene E/S-Merkmale / Nachhaltigkeitsindikatoren	Wertentwicklung
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Zielvorgabe einer CO₂-Bilanz¹ und CO₂-Intensität des Portfolios, die insgesamt mindestens 30 % unter denen des MSCI World Index liegen</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Klimabezogene Daten von einem unabhängigen externen Datenanbieter</p>	<p>Mit Ausnahme des nachstehend beschriebenen passiven Verstoßes erreichte der Teilfonds während des Bezugszeitraums durchgängig eine mindestens 30 % bessere CO₂-Bilanz und mindestens 30 % geringere % CO₂-Intensität als der MSCI World Index.</p> <p>Am 31. Dezember 2022 verstieß der Teilfonds passiv gegen seine Vorgaben, da zu diesem Zeitpunkt seine CO₂-Bilanz nur 28 % besser war als die des MSCI World Index und somit der beworbene Mindestwert von 30 % nicht erreicht wurde. Diese Nichterreicherung des Nachhaltigkeitsziels dauerte acht (8) Geschäftstage an, bevor neue CO₂-Daten des externen Datenanbieters das erneute Erreichen des Zielwerts anzeigten.</p>
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Zielvorgabe eines gegenüber dem MSCI World Index besseren Energiemix (d. h. höherer Anteil der Energieerzeugung aus erneuerbaren Energien und geringere Emissionsreserve)</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Klimabezogene Daten von einem unabhängigen externen Datenanbieter</p> <p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Anwendung der zentralen Ausschlüsse und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Untermanagerverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf https://www.allspringglobal.com/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf dargelegt</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Daten zur Produktbeteiligung und zur Prüfung der Einhaltung globaler Standards von einer unabhängigen Drittpartei</p>	<p>Der Teilfonds erzielte während des Bezugszeitraums durchgängig einen besseren Energiemix als der MSCI World Index (d. h. höherer Anteil der Energieerzeugung aus erneuerbaren Energien und geringere Emissionsreserve).</p> <p>Der Teilfonds erfüllte während des Bezugszeitraums die zentralen Ausschlusskriterien und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Untermanagerverwalters (wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds dargelegt).</p>

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Entfällt, da es sich um den ersten Bezugszeitraum für die periodische Berichterstattung gemäß Delegierter Verordnung zur SFDR handelt.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

¹ Die CO₂-Bilanz ist ein Maß für die Menge der von den zugrunde liegenden Unternehmen ausgestoßenen Treibhausgasen und wird als „Kohlendioxid-Äquivalente“ (in Tonnen) angegeben. Die Kohlenstoffintensität ist ein Maß für die Gesamtemissionen pro Umsatz. Der Energiemix gibt an, welche Energiearten Unternehmen zu welchen Anteilen nutzen, und nennt den Umfang der Emissionsreserven für Unternehmen, die einen Teil ihres CO₂-Budgets noch nicht genutzt haben.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Details:**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?



Das Portfolio des Teilfonds erzielte (mit Ausnahme des zuvor genannten passiven Verstoßes) während des Bezugszeitraums eine mindestens 30 % bessere CO₂-Bilanz und geringere CO₂-Intensität als der MSCI World Index und wies einen besseren Energiemix und geringere Emissionen fossiler Brennstoffe auf als der MSCI World Index. Aufgrund der CO₂-Beschränkungen auf Portfolioebene investierte das Portfolio im Durchschnitt stärker in Unternehmen mit geringeren Emissionen. Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren wurden in dieser Form berücksichtigt. Der Teilfonds berücksichtigte darüber hinaus andere wichtigste nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er Unternehmen aus dem Portfolio ausschloss, die unter die zentralen spezifischen Ausschlusskriterien und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Untermanagerverwalters fielen, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf

<https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt.

Anlageentscheidungen beruhten jedoch nicht ausschließlich auf der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, sondern auf verschiedenen Faktoren, die während der Anlageanalyse berücksichtigt wurden.



Die Liste umfasst die Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 1. April 2022 – 31. März 2023

Was waren die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Apple Inc.	Informationstechnologie	3,92	Vereinigte Staaten
Microsoft Corporation	Informationstechnologie	3,78	Vereinigte Staaten
iShares MSCI World UCITS ETF USD (Dist)	Diversifiziert	3,36	Diversifiziert
Alphabet Inc. Klasse A	Kommunikationsdienstleistungen	1,54	Vereinigte Staaten
Amazon.com, Inc.	Zyklische Konsumgüter	1,50	Vereinigte Staaten
Alphabet Inc. Class C	Kommunikationsdienstleistungen	1,17	Vereinigte Staaten
Home Depot, Inc.	Zyklische Konsumgüter	1,10	Vereinigte Staaten
McDonald's Corporation	Zyklische Konsumgüter	1,10	Vereinigte Staaten
Visa Inc. Klasse A	Finanzen	1,07	Vereinigte Staaten
Walmart Inc.	Basiskonsumgüter	1,05	Vereinigte Staaten
Costco Wholesale Corporation	Basiskonsumgüter	1,03	Vereinigte Staaten
Merck & Co., Inc.	Gesundheitswesen	1,03	Vereinigte Staaten
Bristol-Myers Squibb Company	Gesundheitswesen	1,03	Vereinigte Staaten
Abbott Laboratories	Gesundheitswesen	0,89	Vereinigte Staaten
Accenture Plc Class A	Informationstechnologie	0,88	Vereinigte Staaten

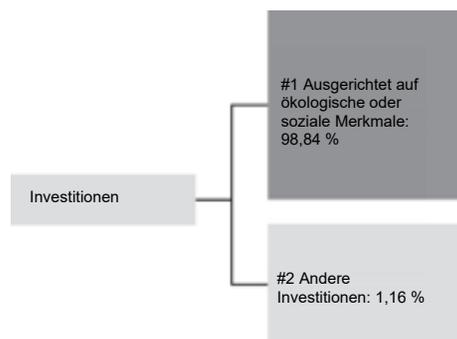


Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

98,84 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Anlagen mit Ausrichtung auf die während des Bezugszeitraums beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale. Die übrigen 1,16 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Barmitteln oder barmittelähnlichen Instrumenten.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% der Vermögenswerte
Barmittel	1,16
Kommunikationsdienstleistungen	7,66
Zyklische Konsumgüter	10,56
Basiskonsumgüter	6,96
Diversifiziert	3,36
Energie	3,03
Finanzen	16,95
Gesundheitswesen	15,06
Industrie	10,13
Informationstechnologie	18,72
Grundstoffe	3,04
Immobilien	2,38
Versorgung	0,99

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?²**

Ja

In fossiles Gas

In Kernenergie

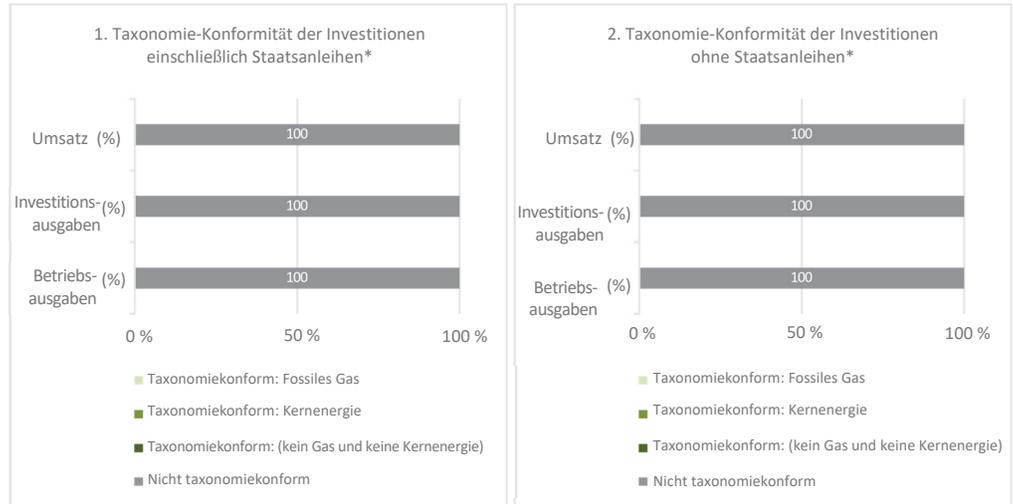
Nein

² Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war Anteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Anlagen in Barmitteln oder bargeldähnlichen Instrumenten wurden unter „Andere Investitionen“ aufgeführt. Die vom Finanzprodukt gehaltenen liquiden Mittel oder bargeldähnlichen Instrumente wurden im Einklang mit den für Liquiditätsreserven geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben zur effizienten Portfolioverwaltung eingesetzt. Auf die im Finanzprodukt gehaltenen Barmittel oder bargeldähnlichen Instrumente wurde kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz angewandt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Untereinlageverwalter hat die in den Abschnitten „Überwachung ökologischer oder sozialer Merkmale“, „Methoden“ und „Datenquellen und Datenverarbeitung“ der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds (zu finden auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf>) beschriebenen Maßnahmen ergriffen, die dazu führten, dass der Teilfonds die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Bezugszeitraum wie folgt erreichte:

- Aufrechterhaltung einer CO₂-Bilanz und CO₂-Intensität des Portfolios, die insgesamt mindestens 30 % unter denen des MSCI World Index liegen.
- Aufrechterhaltung eines gegenüber dem MSCI World Index besseren Energiemix (d. h. höherer Anteil der Energieerzeugung aus erneuerbaren Energien und geringere Emissionsreserve)
- Anwendung der zentralen Ausschlüsse und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Untereinlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf

<https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt

Passive Verstöße und Korrekturmaßnahmen: Am 31. Dezember 2022 verstieß der Teilfonds passiv gegen seine Vorgaben, da zu diesem Zeitpunkt seine CO₂-Bilanz nur 28 % besser war als die des MSCI World Index und somit der beworbene Mindestwert von 30 % nicht erreicht wurde. Diese Nichterreichung des Nachhaltigkeitsziels dauerte acht Geschäftstage an, bevor neue CO₂-Daten des externen Datenanbieters das erneute Erreichen des Zielwerts anzeigten.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Name des Produkts: Climate Focused U.S. Equity Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code): 254900QZKK6Q1MRS7G59

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: %

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es % an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Teilfonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Zielvorgabe einer CO₂-Bilanz und CO₂-Intensität, die insgesamt mindestens 30 % unter denen des Russell 1000® Index liegen.
- Zielvorgabe eines gegenüber dem Russell 1000® Index besseren Energiemix (d. h. höherer Anteil der Energieerzeugung aus erneuerbaren Energien und geringere Emissionsreserve).
- Anwendung der zentralen Ausschlüsse und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Unteranlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt

Der Teilfonds erfüllte im Bezugszeitraum die oben beschriebenen beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Beworbene E/S-Merkmale / Nachhaltigkeitsindikatoren	Wertentwicklung
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Zielvorgabe einer CO2-Bilanz¹ und CO2-Intensität, die insgesamt mindestens 30 % unter denen des Russell 1000® Index liegen</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Klimabezogene Daten von einem unabhängigen externen Datenanbieter</p>	Der Teilfonds erzielte während des Bezugszeitraums insgesamt eine mindestens 30 % bessere CO2-Bilanz und 30 % geringere CO2-Intensität als der Russell 1000® Index.
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Zielvorgabe eines gegenüber dem Russell 1000® Index besseren Energiemix (d. h. höherer Anteil der Energieerzeugung aus erneuerbaren Energien und geringere Emissionsreserve)</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Klimabezogene Daten von einem unabhängigen externen Datenanbieter</p>	Der Teilfonds erzielte während des Bezugszeitraums durchgängig einen besseren Energiemix als der Russell 1000® Index (d. h. höherer Anteil der Energieerzeugung aus erneuerbaren Energien und geringere Emissionsreserve).
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Anwendung der zentralen Ausschlüsse und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Untereinlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf dargelegt</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Daten zur Produktbeteiligung und zur Prüfung der Einhaltung globaler Standards von einer unabhängigen Drittpartei.</p>	Der Teilfonds erfüllte während des Bezugszeitraums die zentralen Ausschlusskriterien und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Untereinlageverwalters (wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf dargelegt).

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Entfällt, da es sich um den ersten Bezugszeitraum für die periodische Berichterstattung gemäß Delegierter Verordnung zur SFDR handelt.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

¹ Die CO2-Bilanz ist ein Maß für die Menge der von den zugrunde liegenden Unternehmen ausgestoßenen Treibhausgase und wird als „Kohlendioxid-Äquivalente“ (in Tonnen) angegeben. Die Kohlenstoffintensität ist ein Maß für die Gesamtemissionen pro Umsatz. Der Energiemix gibt an, welche Energiearten Unternehmen zu welchen Anteilen nutzen, und nennt den Umfang der Emissionsreserven für Unternehmen, die einen Teil ihres CO2-Budgets noch nicht genutzt haben.

→ **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

→ **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Details:**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Das Portfolio des Teilfonds erzielte während des Bezugszeitraums eine mindestens 30 % bessere CO₂-Bilanz und geringere CO₂-Intensität als der Referenzwert und wies einen besseren Energiemix und geringere Emissionen fossiler Brennstoffe auf als dieser. Aufgrund der CO₂-Beschränkungen auf Portfolioebene investierte das Portfolio im Durchschnitt stärker in Unternehmen mit geringeren Emissionen. Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren wurden in dieser Form berücksichtigt. Der Teilfonds berücksichtigte darüber hinaus andere wichtigste nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er Unternehmen aus dem Portfolio ausschloss, die unter die zentralen spezifischen Ausschlusskriterien und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Untereinlageverwalters fielen, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf

<https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt.

Anlageentscheidungen beruhten jedoch nicht ausschließlich auf der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, sondern auf verschiedenen Faktoren, die während der Anlageanalyse berücksichtigt wurden.



Was waren die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 1. April 2022 – 31. März 2023

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Microsoft Corporation	Informationstechnologie	5,50	Vereinigte Staaten
Apple Inc.	Informationstechnologie	5,36	Vereinigte Staaten
iShares Core S&P 500 UCITS ETF USD (Dist)	Diversifiziert	4,05	Vereinigte Staaten
Alphabet Inc. Klasse A	Kommunikationsdienstleistungen	2,16	Vereinigte Staaten
Amazon.com, Inc.	Zyklische Konsumgüter	2,04	Vereinigte Staaten
Alphabet Inc. Class C	Kommunikationsdienstleistungen	1,69	Vereinigte Staaten
JPMorgan Chase & Co.	Finanzen	1,62	Vereinigte Staaten
Visa Inc. Klasse A	Finanzen	1,61	Vereinigte Staaten
Home Depot, Inc.	Zyklische Konsumgüter	1,42	Vereinigte Staaten
Tesla, Inc.	Zyklische Konsumgüter	1,39	Vereinigte Staaten
Merck & Co., Inc.	Gesundheitswesen	1,39	Vereinigte Staaten
Costco Wholesale Corporation	Basiskonsumgüter	1,25	Vereinigte Staaten
Broadcom Inc.	Informationstechnologie	1,19	Vereinigte Staaten
Walmart Inc.	Basiskonsumgüter	1,17	Vereinigte Staaten
Coca-Cola Company	Basiskonsumgüter	1,15	Vereinigte Staaten

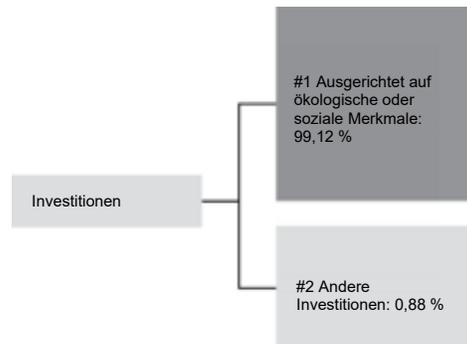


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

99,12 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Anlagen mit Ausrichtung auf die während des Bezugszeitraums beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale. Die übrigen 0,88 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Barmitteln oder barmittelähnlichen Instrumenten.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Sektor	% der Vermögenswerte
Barmittel	0,88
Kommunikationsdienstleistungen	8,04
Zyklische Konsumgüter	8,81
Basiskonsumgüter	5,89
Diversifiziert	4,05
Energie	3,06
Finanzen	15,24
Gesundheitswesen	14,84
Industrie	7,96
Informationstechnologie	23,33
Grundstoffe	2,34
Immobilien	2,84
Versorgung	2,71

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?

Ja

² Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

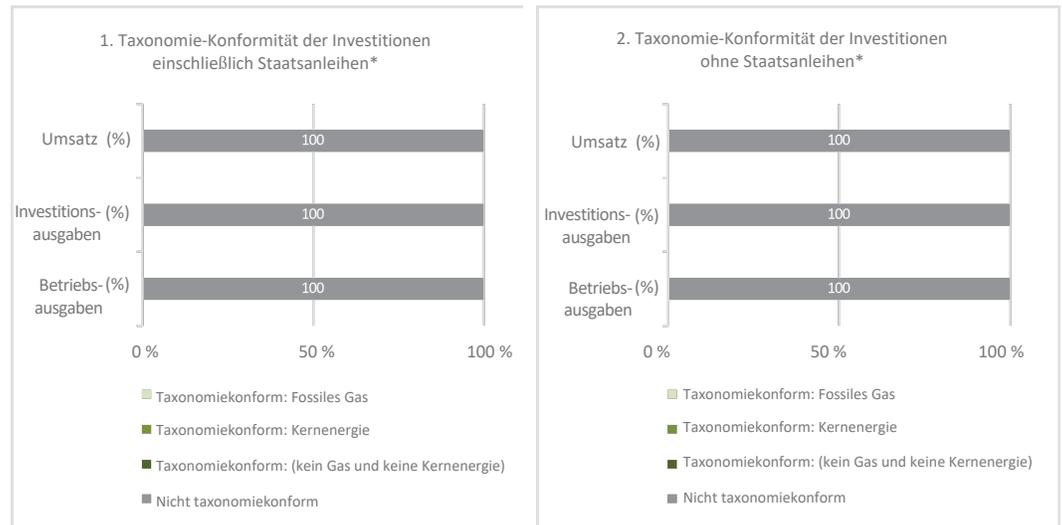
In fossiles Gas In Kernenergie

Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

Wie hoch war Anteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Anlagen in Barmitteln oder bargeldähnlichen Instrumenten wurden unter „Andere Investitionen“ aufgeführt. Die vom Finanzprodukt gehaltenen liquiden Mittel oder bargeldähnlichen Instrumente wurden im Einklang mit den für Liquiditätsreserven geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben zur effizienten Portfolioverwaltung eingesetzt. Auf die im Finanzprodukt gehaltenen Barmittel oder bargeldähnlichen Instrumente wurde kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz angewandt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Unteranlageverwalter hat die in den Abschnitten „Überwachung ökologischer oder sozialer Merkmale“, „Methoden“ und „Datenquellen und Datenverarbeitung“ der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds (zu finden auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf>) beschriebenen Maßnahmen ergriffen, die dazu führten, dass der Teilfonds die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Bezugszeitraum wie folgt erreichte:

- Aufrechterhaltung einer CO₂-Bilanz und CO₂-Intensität, die insgesamt mindestens 30 % unter denen des Russell 1000® Index liegen.
- Aufrechterhaltung eines gegenüber dem Russell 1000® Index besseren Energiemix (d. h. höherer Anteil der Energieerzeugung aus erneuerbaren Energien und geringere Emissionsreserve).
- Anwendung der zentralen Ausschlüsse und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Unteranlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts: Climate Transition Global Investment Grade Credit Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300ULHNNTBLJH1M19

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: %

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es __% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Teilfonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Zielvorgabe einer Gesamt-Kohlenstoffintensität, die 30 % niedriger ist als die des Bloomberg Global Aggregate Corporate Index (USD Hedged), sowie Ziel der Dekarbonisierung bis 2050
- Anwendung der zentralen Ausschlusskriterien des Untereinlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt

Der Teilfonds erfüllte im gesamten Bezugszeitraum die oben beschriebenen beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Beworbene E/S-Merkmale / Nachhaltigkeitsindikatoren	Wertentwicklung
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Zielvorgabe einer Gesamt-Kohlenstoffintensität¹ des Portfolios, die 30 % niedriger ist als die des Bloomberg Global Aggregate Corporate Index (USD Hedged), sowie Ziel der Dekarbonisierung bis 2050</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Klimabezogene Daten von einem unabhängigen externen Datenanbieter</p>	<p>Das Portfolio des Teilfonds wies während des Bezugszeitraums durchgehend eine Gesamt-Kohlenstoffintensität mindestens 30 % unter dem Bloomberg Global Aggregate Corporate Index (USD Hedged) auf. Der Teilfonds erreichte darüber hinaus die vorgesehene jährliche Reduzierung seiner Treibhausgasemissionen mit dem Ziel der vollständigen Dekarbonisierung bis 2050.</p>
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Anwendung der zentralen Ausschlusskriterien des Untieranlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf dargelegt</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Daten zur Produktbeteiligung und zur Prüfung der Einhaltung globaler Standards von einem unabhängigen Datenanbieter</p>	<p>Der Teilfonds erfüllte während des Bezugszeitraums die zentralen Ausschlusskriterien des Untieranlageverwalters (wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds dargelegt).</p>

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Entfällt, da es sich um den ersten Bezugszeitraum für die periodische Berichterstattung gemäß Delegierter Verordnung zur SFDR handelt.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

→ **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

→ **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Details:**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

¹ Die Kohlenstoffintensität ist ein Maß für die Gesamtemissionen pro Umsatz.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Während des Bezugszeitraums berücksichtigte der Untieranlageverwalter im Rahmen seiner ESG- und Anlagenbewertung sowie seines Dialogs mit Emittenten bestimmte wichtigste nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren. Der Teilfonds berücksichtigte andere wichtigste nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er Unternehmen aus dem Portfolio ausschloss, die unter die zentralen spezifischen Ausschlusskriterien des Untieranlageverwalters fielen, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt. Anlageentscheidungen beruhten jedoch nicht ausschließlich auf der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, sondern auf verschiedenen Faktoren, die während der Anlageanalyse berücksichtigt wurden.



Was waren die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel:
1. April 2022 –
31. März 2023

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	Government	5,03	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley	Finanzdienstleistungen	2,22	Vereinigte Staaten
Intercontinental Exchange, Inc.	Finanzdienstleistungen	1,70	Vereinigte Staaten
Bank of America Corporation	Finanzdienstleistungen	1,52	Vereinigte Staaten
BNP Paribas S.A.	Finanzdienstleistungen	1,41	Frankreich
Western Union Company	Finanzdienstleistungen	1,34	Vereinigte Staaten
Citigroup Inc.	Finanzdienstleistungen	1,33	Vereinigte Staaten
Equifax Inc.	Gewerbliche Dienste	1,33	Vereinigte Staaten
Verizon Communications Inc.	Kommunikation	1,25	Vereinigte Staaten
AbbVie Inc.	Medizintechnologie	1,22	Vereinigte Staaten
American International Group, Inc.	Finanzdienstleistungen	1,16	Vereinigte Staaten
Hyundai Capital America, Inc.	Gebrauchsgüter	1,15	Südkorea
UnitedHealth Group Incorporated	Gesundheitsdienstleistungen	1,14	Vereinigte Staaten
HSBC Holdings Plc	Finanzdienstleistungen	0,98	Vereinigtes Königreich
AT&T Inc.	Kommunikation	0,97	Vereinigte Staaten

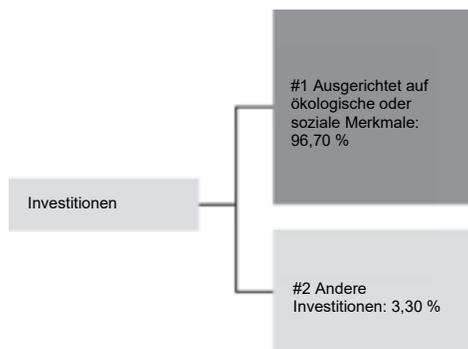


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

96,7 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Anlagen mit Ausrichtung auf die während des Bezugszeitraums beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale. Die übrigen 3,3 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Barmitteln oder barmittelähnlichen Instrumenten.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% der Vermögenswerte
Grundstoffe	1,60
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	3,25
Kommunikation	8,32
Zyklische Konsumgüter	6,57
Nichtzyklische Konsumgüter	13,30
Energie	5,80
Berichts-	44,26
Government	5,16
Industrie	1,83
Technologie	4,04
Versorgung	5,87

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?²**

Ja

In fossiles Gas

In Kernenergie

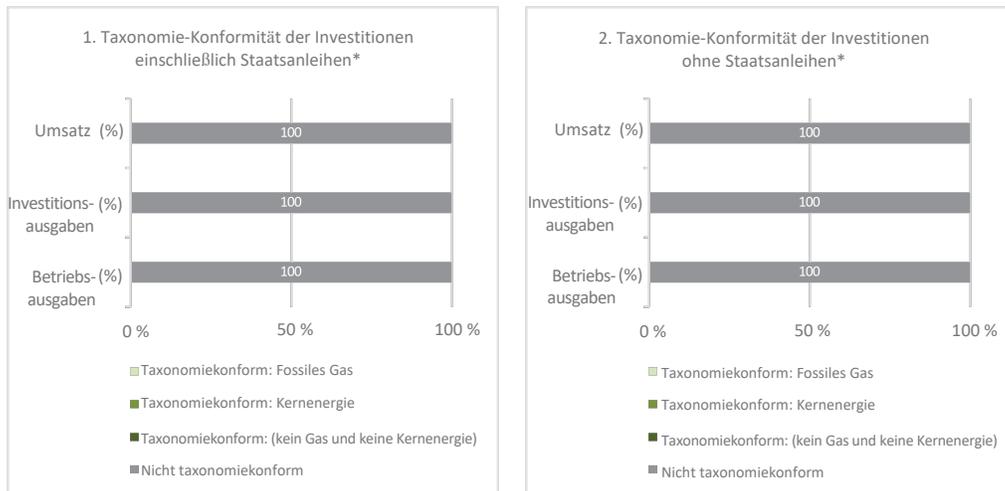
Nein

² Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonmiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonmiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war Anteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Anlagen in Barmitteln oder bargeldähnlichen Instrumenten wurden unter „Andere Investitionen“ aufgeführt. Die vom Finanzprodukt gehaltenen liquiden Mittel oder bargeldähnlichen Instrumente wurden im Einklang mit den für Liquiditätsreserven geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben zur effizienten Portfolioverwaltung eingesetzt. Auf die im Finanzprodukt gehaltenen Barmittel oder bargeldähnlichen Instrumente wurde kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz angewandt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Unteranlageverwalter hat die in den Abschnitten „Überwachung ökologischer oder sozialer Merkmale“, „Methoden“ und „Datenquellen und Datenverarbeitung“ der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds (zu finden auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf>) beschriebenen Maßnahmen ergriffen, die dazu führten, dass der Teilfonds die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Bezugszeitraum wie folgt erreichte:

- Aufrechterhaltung einer Gesamt-Kohlenstoffintensität des Portfolios, die 30 % niedriger ist als die des Bloomberg Global Aggregate Corporate Index (USD Hedged), und Umsetzung der vorgesehenen jährlichen Reduzierung der Treibhausgasemissionen mit dem Ziel der Dekarbonisierung bis 2050.
- Anwendung der zentralen Ausschlusskriterien des Unteranlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Name des Produkts: Emerging Markets Equity Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300I6AWQ5BEBPSW16

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: %

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Teilfonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Anlagen in Unternehmen, die entweder bereits starke Performance in Bezug auf Umwelt-, Sozial- oder Governance-Aspekte in Verbindung mit langfristiger Wertgenerierung aufweisen oder bei denen Entwicklungsprozesse im Gang sind, die zeigen, dass diese Unternehmen in zunehmendem Maß die mit langfristiger Wertschöpfung verbundenen Anforderungen in Bezug auf Umwelt-, Sozial- oder Governance-Themen erfüllen
- Anwendung der Ausschlusskriterien des Teilfonds, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt
- Anwendung von Beschränkungen beim Kauf der Wertpapiere von Unternehmen, die gegen die Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen in Bezug auf Menschenrechte, Arbeitsrechte, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung verstoßen

Der Teilfonds erfüllte im gesamten Bezugszeitraum die oben beschriebenen beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Beworbene E/S-Merkmale / Nachhaltigkeitsindikatoren	Wertentwicklung
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Anlagen in Unternehmen, die entweder bereits starke Performance in Bezug auf Umwelt-, Sozial- oder Governance-Aspekte in Verbindung mit langfristiger Wertgenerierung aufweisen oder bei denen Entwicklungsprozesse im Gang sind, die zeigen, dass diese Unternehmen in zunehmendem Maß die mit langfristiger Wertschöpfung verbundenen Anforderungen in Bezug auf Umwelt-, Sozial- oder Governance-Themen erfüllen</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u></p> <ul style="list-style-type: none"> • Proprietäre quantitative ESG-Risikobewertungen, die aus drei separaten Drittquellen stammen • Verbesserungen bei diesen Bewertungen • Qualitative Beurteilung von ESG-Themen durch den Untereinlageverwalter, um deren Wesentlichkeit einzuschätzen und festzustellen, ob die quantitativen Daten die ESG-Performance korrekt wiedergeben • Dokumentation der Interaktionen im Rahmen der Mitwirkung in Unternehmen und Prüfung, ob das jeweilige Unternehmen Handlungsbereitschaft zeigt und Verbesserungskonzepte entwickelt 	<p>Im Bezugszeitraum investierte der Teilfonds nur in Unternehmen, die entweder:</p> <ul style="list-style-type: none"> • starke aktuelle Performance in Bezug auf mit der langfristigen Wertschöpfung verbundene Umwelt-, Sozial- oder Governance-Themen aufweisen (gemessen anhand der proprietären quantitativen ESG-Risikobewertungen oder der qualitativen Bewertung des Untereinlageverwalters), oder • bei denen Entwicklungsprozesse im Gang sind, die zeigen, dass diese Unternehmen in zunehmendem Maß die mit langfristiger Wertschöpfung verbundenen Verbesserungsanforderungen in Bezug auf Umwelt-, Sozial- oder Governance-Themen erfüllen (gemessen an der längerfristigen Verbesserung bei proprietären quantitativen ESG-Risikoscores oder der qualitativen Beurteilung des Untereinlageverwalters). <p>In bestimmten Fällen trat der Untereinlageverwalter mit den Unternehmen, in die investiert wird, in den Dialog, um Erkenntnisse über deren Handlungsbereitschaft zu gewinnen oder in Zusammenarbeit mit den Unternehmen Konzepte zur Verbesserung ihrer Performance bei ökologischen oder sozialen Themen zu entwickeln, die mit langfristiger Wertschöpfung in Zusammenhang stehen. Dieser Dialog bildete eine Grundlage der qualitativen Bewertungen der Unternehmen, in die investiert wurde, durch den Untereinlageverwalter.</p>
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Anwendung der Ausschlusskriterien des Teilfonds, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf https://www.allspringglobal.com/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf dargelegt</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Daten zur Produktbeteiligung von einem unabhängigen externen Datenanbieter</p>	<p>Der Teilfonds erfüllte während des Bezugszeitraums seine spezifischen Ausschlusskriterien (wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds dargelegt).</p>
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Anwendung von Beschränkungen beim Kauf der Wertpapiere von Unternehmen, die gegen die Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen in Bezug auf Menschenrechte, Arbeitsrechte, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung verstoßen.</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Daten zur Prüfung der Einhaltung globaler Standards von einem unabhängigen Datenanbieter</p>	<p>Der Teilfonds erfüllte die Beschränkungen beim Kauf der Wertpapiere von Unternehmen, die nach Analyse des unabhängigen Datenanbieters im Bezugszeitraum gegen die Prinzipien des United Nations Global Compact zu Menschenrechten, Arbeitsbedingungen, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung verstießen.</p>

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Entfällt, da es sich um den ersten Bezugszeitraum für die periodische Berichterstattung gemäß Delegierter Verordnung zur SFDR handelt.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Details:**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Während des Bezugszeitraums berücksichtigte der Unteranlageverwalter im Rahmen seiner ESG- und Anlagenbewertung sowie seines Dialogs mit Emittenten bestimmte wichtigste nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren. Der Teilfonds berücksichtigte andere wichtigste nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er Unternehmen aus dem Portfolio ausschloss, die unter seine spezifischen Ausschlusskriterien fielen, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt. Anlageentscheidungen beruhten jedoch nicht ausschließlich auf der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, sondern auf verschiedenen Faktoren, die während der Anlageanalyse berücksichtigt wurden.



Die Liste umfasst die Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 1. April 2022 – 31. März 2023

Was waren die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. Sponsored ADR	Informationstechnologie	7,59	Taiwan
Samsung Electronics Co., Ltd.	Informationstechnologie	5,78	Korea
Tencent Holdings Ltd.	Kommunikationsdienstleistungen	4,34	China/Hongkong
Reliance Industries Limited	Energie	3,42	Indien
Fomento Economico Mexicano SAB de CV Sponsored ADR Class B	Basiskonsumgüter	2,85	Mexiko
Meituan Klasse B	Zyklische Konsumgüter	2,47	China/Hongkong
Li Ning Company Limited	Zyklische Konsumgüter	2,37	China/Hongkong
AIA Group Limited	Finanzen	2,37	China/Hongkong
Uni-President Enterprises Corp.	Basiskonsumgüter	2,36	Taiwan
WH Group Ltd. (HK)	Basiskonsumgüter	2,16	China/Hongkong
America Movil SAB de CV Sponsored ADR Class B	Kommunikationsdienstleistungen	1,97	Mexiko
Alibaba Group Holding Limited Sponsored ADR	Zyklische Konsumgüter	1,88	China/Hongkong
Fibra Uno Administracion SA de CV	Immobilien	1,82	Mexiko
HDFC Bank Limited Sponsored ADR	Finanzen	1,81	Indien
KT Corporation Sponsored ADR	Kommunikationsdienstleistungen	1,60	Korea

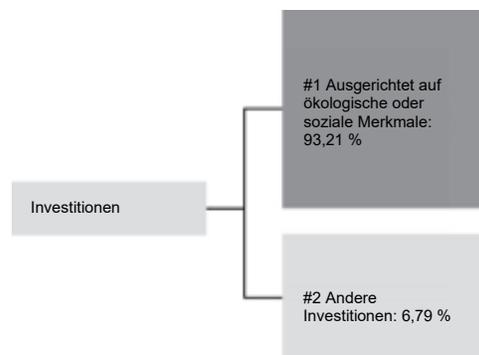


Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

93,21 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Anlagen mit Ausrichtung auf die während des Bezugszeitraums beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale. Die übrigen 6,79 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Barmitteln oder barmittelähnlichen Instrumenten.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% der Vermögenswerte
Barmittel	6,79
Kommunikationsdienstleistungen	16,89
Zyklische Konsumgüter	14,86
Basiskonsumgüter	17,02
Energie	5,11
Finanzen	14,32
Gesundheitswesen	2,77
Industrie	1,58
Informationstechnologie	16,91
Grundstoffe	1,70
Immobilien	2,04
Versorgung	0,01

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**

Ja

In fossiles Gas In Kernenergie

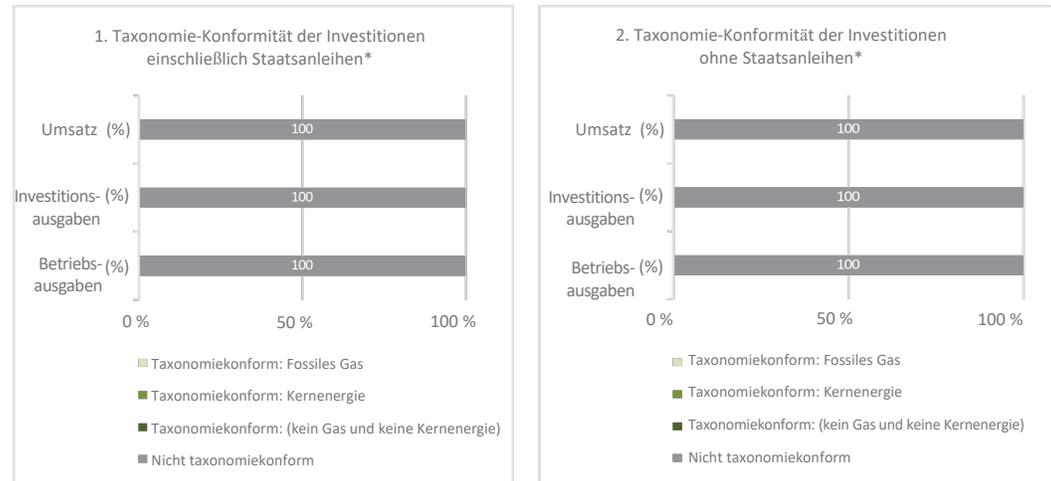
Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.



Wie hoch war Anteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



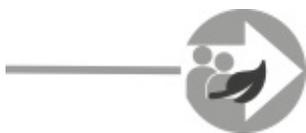
Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Anlagen in Barmitteln oder bargeldähnlichen Instrumenten sowie Derivaten wurden unter „Andere Investitionen“ aufgeführt. Die vom Finanzprodukt gehaltenen liquiden Mittel oder bargeldähnlichen Instrumente sowie Derivate wurden im Einklang mit den für Liquiditätsreserven geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben zur Absicherung und/oder zur effizienten Portfolioverwaltung eingesetzt. Auf die im Finanzprodukt gehaltenen Barmittel oder bargeldähnlichen Instrumente und Derivate wurde kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz angewandt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Unteranlageverwalter hat die in den Abschnitten „Überwachung ökologischer oder sozialer Merkmale“, „Methoden“ und „Datenquellen und Datenverarbeitung“ der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds (zu finden auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf>) beschriebenen Maßnahmen ergriffen, die dazu führten, dass der Teilfonds die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Bezugszeitraum wie folgt erreichte:

Anlagen in Unternehmen, die entweder bereits starke Performance in Bezug auf Umwelt-, Sozial- oder Governance-Aspekte in Verbindung mit langfristiger Wertgenerierung aufweisen oder bei denen Entwicklungsprozesse im Gang sind, die zeigen, dass diese Unternehmen in zunehmendem Maß die mit langfristiger Wertschöpfung verbundenen Anforderungen in Bezug auf Umwelt-, Sozial- oder Governance-Themen erfüllen.

- Anwendung der Ausschlusskriterien des Teilfonds, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt

- Anwendung von Beschränkungen beim Kauf der Wertpapiere von Unternehmen, die gegen die Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen in Bezug auf Menschenrechte, Arbeitsrechte, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung verstoßen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts: Emerging Markets Equity Income Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300COF8Y3EMEK7E75

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt %

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es __% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Teilfonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Zielvorgabe einer Gesamt-Kohlenstoffintensität des Portfolios, die insgesamt mindestens 30 % unter der des MSCI Emerging Markets Index liegt.
- Anlage in Unternehmen, die durch verantwortungsvolle Praktiken bei wesentlichen ESG-Themen sowohl ESG-bezogene als auch operationelle Risiken effektiv steuern können, oder in Unternehmen, die das Potenzial zur längerfristigen Verbesserung ihre operationellen Profile und ESG-Performance haben.
- Fokus auf Unternehmen, deren potenzielle Rendite höher eingeschätzt wurde als die vom Unteranlageverwalter geschätzte Erhöhung des Aktien-Value-at-Risk aufgrund solcher wesentlicher ESG-Faktoren.
- Anwendung der zentralen Ausschlusskriterien des Unteranlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Mit Ausnahme des nachstehend aufgeführten passiven Verstoßes erfüllte der Teilfonds während des gesamten Berichtszeitraums die oben genannten von ihm beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Beworbene E/S-Merkmale / Nachhaltigkeitsindikatoren	Wertentwicklung
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Zielvorgabe einer Gesamt-Kohlenstoffintensität des Portfolios, die insgesamt mindestens 30 % unter der des MSCI Emerging Markets Index liegt</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Klimabezogene Daten von einem unabhängigen externen Datenanbieter</p>	<p>Der Teilfonds erzielte während des Bezugszeitraums insgesamt eine mindestens 30 % geringere CO₂-Intensität als der MSCI Emerging Markets Index.</p>
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Anlage in Unternehmen, die (i) durch verantwortungsvolle Praktiken bei wesentlichen ESG-Themen sowohl ESG-bezogene als auch operationelle Risiken effektiv steuern können oder (ii) das Potenzial zur längerfristigen Verbesserung ihre operationellen Profile und ESG-Performance haben</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u></p> <ul style="list-style-type: none"> • Das Investmentteam verfolgt die längerfristige Performance aller Emittenten anhand der von ihm als relevant erachteten Nachhaltigkeitskennzahlen. • Das Investmentteam verfolgt darüber hinaus weitere branchenspezifische Nachhaltigkeitskennzahlen abhängig von deren Wesentlichkeit • Dialog mit Unternehmen, um die strategische Ausrichtung von nachhaltigen Praktiken und Investitionen zu bewerten und gemeinsam mit den Unternehmensführungen auf Verbesserungen von Nachhaltigkeitsstrategien hinzuarbeiten 	<p>Der Untereinlageverwalter verfolgte die Wertentwicklung aller während des Bezugszeitraums im Portfolio gehaltenen Emittenten unter Verwendung von Nachhaltigkeitskennzahlen, die der Untereinlageverwalter als relevant erachtet. Der Untereinlageverwalter verfolgte darüber hinaus weitere branchenspezifische Nachhaltigkeitskennzahlen, die er als wesentlich ansah, und trat bei Bedarf in den Dialog mit bestimmten Beteiligungsunternehmen, um die strategische Ausrichtung von nachhaltigen Praktiken und Investitionen zu bewerten und beim Management auf die Verbesserung von Nachhaltigkeitsstrategien hinzuwirken.</p> <p>Die oben erwähnte Analyse ist in ihrer Gesamtheit Grundlage der Beurteilung der nachhaltigen oder sich in Bezug auf Nachhaltigkeit verbessernden operativen Tätigkeit und ESG-Profile von Unternehmen durch den Untereinlageverwalter sowie der mit proprietären Methoden erfolgenden Schätzung des „Equity Value at Risk“ in Abhängigkeit von wesentlichen ESG-Faktoren (s. nachstehende Beschreibung).</p> <p>Während des Bezugszeitraums investierte der Teilfonds nur in Unternehmen, die durch verantwortungsvolle Praktiken bei wesentlichen ESG-Themen sowohl ESG-bezogene als auch operationelle Risiken effektiv steuern können, oder in Unternehmen, die das Potenzial zur längerfristigen Verbesserung ihre operationellen Profile und ESG-Performance haben.</p>
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Fokus auf Unternehmen, deren potenzielle Rendite höher eingeschätzt wurde als die vom Untereinlageverwalter geschätzte Erhöhung des Aktien-Value-at-Risk aufgrund solcher wesentlicher ESG-Faktoren</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Einschätzung des „Equity Value at Risk“ durch den Untereinlageverwalter auf Grundlage wesentlicher ESG-Faktoren</p>	<p>Der Teilfonds investierte nur in Unternehmen, deren potenzielle Rendite höher eingeschätzt wurde als die vom Untereinlageverwalter geschätzte Erhöhung des Aktien-Value-at-Risk aufgrund solcher wesentlicher ESG-Faktoren.</p>
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Anwendung der zentralen Ausschlusskriterien des Untereinlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf dargelegt</p>	<p>Mit Ausnahme eines passiven Verstoßes während des nachstehend angegebenen Zeitraums und laut Daten zur Produktbeteiligung und zur Prüfung der Einhaltung globaler Standards von einem unabhängigen Datenanbieter erfüllte der Teilfonds während des Bezugszeitraums die zentralen Ausschlusskriterien des Untereinlageverwalters (wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds dargelegt).</p>

¹ Die Kohlenstoffintensität ist ein Maß für die Gesamtemissionen pro Umsatz.

Nachhaltigkeitsindikatoren:

Daten zur Produktbeteiligung und zur Prüfung der Einhaltung globaler Standards von einem unabhängigen Datenanbieter

Am 31. August 2022 verstieß der Teilfonds passiv gegen seine Vorgaben, als der unabhängige externe Datenanbieter drei zuvor vom Teilfonds gehaltene Wertpapiere in seine Liste der Verletzer des UN Global Compact aufnahm. Infolgedessen erfüllten 4,4 % der gehaltenen Anlagen des Teilfonds nicht die vom Teilfonds beworbenen Hauptausschlusskriterien. Der Untermanager verkaufte daraufhin zwei (2) Wertpapiere innerhalb von zehn (10) Geschäftstagen. Bei dem verbleibenden Wertpapier handelte es sich um ein illiquides russisches Wertpapier, das aufgrund des Krieges zwischen Russland und der Ukraine sowie der sanktionsbedingt eingeschränkten Möglichkeiten zur Veräußerung solcher Wertpapiere anders behandelt werden musste.

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Entfällt, da es sich um den ersten Bezugszeitraum für die periodische Berichterstattung gemäß Delegierter Verordnung zur SFDR handelt.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

— **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

— **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Details:**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Während des Bezugszeitraums berücksichtigte der Unteranlageverwalter im Rahmen seiner ESG- und Anlagenbewertung sowie seines Dialogs mit Emittenten bestimmte wichtigste nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren. Der Teilfonds berücksichtigte andere wichtigste nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er Unternehmen aus dem Portfolio ausschloss, die unter die zentralen spezifischen Ausschlusskriterien des Unteranlageverwalters fielen, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt. Anlageentscheidungen beruhten jedoch nicht ausschließlich auf der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, sondern auf verschiedenen Faktoren, die während der Anlageanalyse berücksichtigt wurden.

Was waren die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?



Die Liste umfasst die Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel:
01.04.2022 – 31.03.2023

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	Informationstechnologie	7,24	Taiwan
Alibaba Group Holding Limited	Zyklische Konsumgüter	3,70	China/Hongkong
Samsung Electronics Co., Ltd.	Informationstechnologie	2,75	Korea
Samsung Electronics Co Ltd Pfd Non-Voting	Informationstechnologie	2,47	Korea
Infosys Limited Sponsored ADR	Informationstechnologie	1,86	Indien
Midea Group Co. Ltd. Class A	Zyklische Konsumgüter	1,73	China/Hongkong
China Resources Land Limited	Immobilien	1,61	China/Hongkong
JD.com, Inc. Class A	Zyklische Konsumgüter	1,47	China/Hongkong
China Construction Bank Corporation Klasse H	Finanzen	1,37	China/Hongkong
Bangkok Bank Public Company Limited (Alien Mkt)	Finanzen	1,36	Thailand
LIC Housing Finance Ltd	Finanzen	1,29	Indien
LG Chem Ltd Pfd Registered Shs Issue 01	Grundstoffe	1,28	Korea
KB Financial Group Inc.	Finanzen	1,25	Korea
Bank of Baroda	Finanzen	1,22	Indien
Power Grid Corporation of India Limited	Versorgung	1,22	Indien

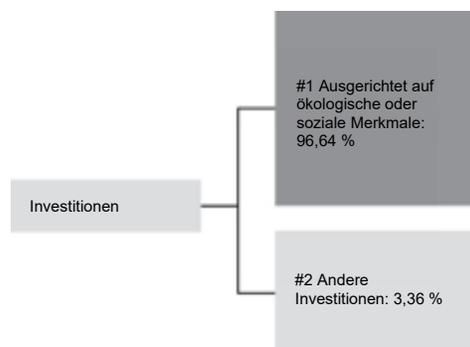


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

96,64 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Anlagen mit Ausrichtung auf die während des Bezugszeitraums beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale. Die übrigen 3,36 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Barmitteln oder barmittelähnlichen Instrumenten.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% der Vermögenswerte
Barmittel	3,36
Kommunikationsdienstleistungen	5,37
Zyklische Konsumgüter	13,40
Basiskonsumgüter	6,98
Energie	2,02
Finanzen	25,18
Gesundheitswesen	1,29
Industrie	6,98
Informationstechnologie	20,20
Grundstoffe	6,38
Immobilien	3,60
Versorgung	5,23

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.
Übergangstätigkeiten sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**²

Ja

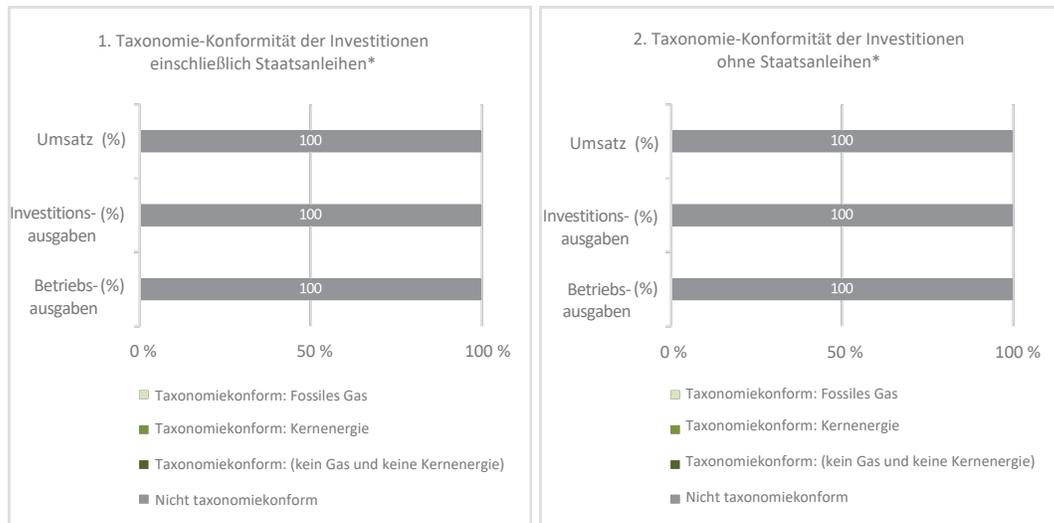
In fossiles Gas In Kernenergie

Nein

² Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln. - **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft. - **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

*Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Wie hoch war Anteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Anlagen in Barmitteln oder bargeldähnlichen Instrumenten. Die vom Finanzprodukt gehaltenen liquiden Mittel oder bargeldähnlichen Instrumente wurden im Einklang mit den für Liquiditätsreserven geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben zur effizienten Portfolioverwaltung eingesetzt. Auf die im Finanzprodukt gehaltenen Barmittel oder bargeldähnlichen Instrumente wurde kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz angewandt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Unteranlageverwalter hat die in den Abschnitten „Überwachung ökologischer oder sozialer Merkmale“, „Methoden“ und „Datenquellen und Datenverarbeitung“ der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds (zu finden auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf>) beschriebenen Maßnahmen ergriffen, die dazu führten, dass der Teilfonds die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Bezugszeitraum wie folgt erreichte:

- Zielvorgabe einer Gesamt-Kohlenstoffintensität des Portfolios, die insgesamt mindestens 30 % unter der des MSCI Emerging Markets Index liegt.
- Anlage in Unternehmen, die durch verantwortungsvolle Praktiken bei wesentlichen ESG-Themen sowohl ESG-bezogene als auch operationelle Risiken effektiv steuern können, oder in Unternehmen, die das Potenzial zur längerfristigen Verbesserung ihre operationellen Profile und ESG-Performance haben.
- Anlage in Unternehmen, deren potenzielle Rendite höher eingeschätzt wurde als die vom Unteranlageverwalter geschätzte Erhöhung des Aktien-Value-at-Risk aufgrund solcher wesentlicher ESG-Faktoren.
- Dialog mit bestimmten Unternehmen, in die investiert wird, um die strategische Ausrichtung von nachhaltigen Praktiken und Investitionen zu bewerten und gemeinsam mit den Unternehmensführungen auf Verbesserungen von Nachhaltigkeitsstrategien hinzuarbeiten
- Anwendung der zentralen Ausschlusskriterien des Unteranlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt

Passive Verstöße und Korrekturmaßnahmen: Am 31. August 2022 verstieß der Teilfonds passiv gegen seine Vorgaben, als der externe Datenanbieter drei zuvor vom Teilfonds gehaltene Wertpapiere in seine Liste der Verletzer des UN Global Compact aufnahm. Infolgedessen erfüllten 4,4 % der gehaltenen Anlagen des Teilfonds nicht die vom Teilfonds beworbenen Hauptausschlusskriterien. Der Unteranlageverwalter verkaufte daraufhin zwei (2) Beteiligungen innerhalb von zehn (10) Geschäftstagen. Bei dem verbleibenden Wertpapier handelte es sich um ein illiquides russisches Wertpapier, das aufgrund des Krieges zwischen Russland und der Ukraine sowie der sanktionsbedingt eingeschränkten Möglichkeiten zur Veräußerung solcher Wertpapiere anders behandelt werden musste.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.



Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts: EUR Investment Grade Credit Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code): 222100EY3STD7DZ3DK79

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

- | | |
|---|--|
| <p><input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: %</p> <p><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: %</p> | <p><input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.</p> <p><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</p> <p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.</p> |
|---|--|



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Teilfonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Verpflichtung, mindestens 5 % des Gesamtvermögens in grünen, nachhaltigen und sozialen Anleihen (GSSS-Anleihen) zu halten.
- Anwendung der zentralen Ausschlüsse und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Untereinverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf

<https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt

Der Teilfonds erfüllte im Bezugszeitraum die oben beschriebenen beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Beworbene E/S-Merkmale / Nachhaltigkeitsindikatoren

Wertentwicklung

<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Mindestens 5 % des Gesamtnettvermögens werden in GSSS-Anleihen gehalten</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Verwendung unabhängiger Bewertungen der Verwendung von Anlageerlösen</p>	<p>Der Teilfonds hielt während des Bezugszeitraums mindestens 5 % seines Gesamtnettvermögens in grünen, nachhaltigen, nachhaltigkeitsgebundenen und sozialen Anleihen (GSSS).</p> <p>Im Bezugszeitraum entfielen im Quartalsdurchschnitt 21,35 % des Portfolios auf GSSS-Anleihen.</p>
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Anwendung der zentralen Ausschlüsse und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Untermanagerverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf https://www.allspringglobal.com/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf dargelegt</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u></p> <ul style="list-style-type: none"> • Ausschluss von Wertpapieren mit dem niedrigsten Rating durch eine unabhängige Drittpartei • Daten zur Produktbeteiligung und zur Prüfung der Einhaltung globaler Standards von einem unabhängigen Datenanbieter 	<p>Der Teilfonds investierte nicht in Wertpapiere, die von einem unabhängigen externen Datenanbieter das niedrigste Rating erhalten hatten und die zentralen Ausschlusskriterien und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Untermanagerverwalters erfüllten (wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf dargelegt).</p>

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Entfällt, da es sich um den ersten Bezugszeitraum für die periodische Berichterstattung gemäß Delegierter Verordnung zur SFDR handelt.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

→ **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

→ **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Details:**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?



Während des Bezugszeitraums berücksichtigte der Unteranlageverwalter im Rahmen seiner ESG- und Anlagenbewertung sowie seines Dialogs mit Emittenten bestimmte wichtigste nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren. Der Unteranlageverwalter berücksichtigte darüber hinaus andere wichtigste nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er Unternehmen aus dem Portfolio ausschloss, die unter seine zentralen spezifischen Ausschlusskriterien und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien fielen, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf

<https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt. Anlageentscheidungen beruhten jedoch nicht ausschließlich auf der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, sondern auf verschiedenen Faktoren, die während der Anlageanalyse berücksichtigt wurden.

Was waren die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?



Die Liste umfasst die Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01.04.2022 – 31.03.2023

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Regierung von Deutschland	Government	2,12	Deutschland
JPMorgan Chase & Co.	Finanzdienstleistungen	1,92	Vereinigte Staaten
BNP Paribas S.A.	Finanzdienstleistungen	1,49	Frankreich
UBS AG London Branch	Finanzdienstleistungen	1,48	Schweiz
Bank of America Corporation	Finanzdienstleistungen	1,46	Vereinigte Staaten
Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA	Finanzdienstleistungen	1,44	Frankreich
McDonald's Corporation	Verbraucherdienstleistungen	1,44	Vereinigte Staaten
ING Groep NV	Finanzdienstleistungen	1,28	Niederlande
ENEL Finance International NV	Versorgung	1,27	Italien
DNB Bank ASA	Finanzdienstleistungen	1,21	Norwegen
Goldman Sachs Group, Inc.	Finanzdienstleistungen	1,15	Vereinigte Staaten
NatWest Group Plc	Finanzdienstleistungen	1,13	Vereinigtes Königreich
Morgan Stanley	Finanzdienstleistungen	1,11	Vereinigte Staaten
Credit Agricole Assurances SA	Finanzdienstleistungen	1,08	Frankreich
SES SA	Kommunikation	1,06	Luxemburg

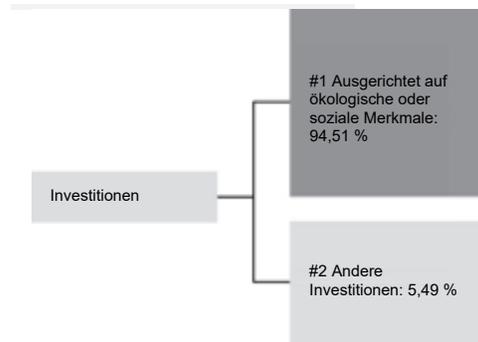
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

94,51 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Anlagen mit Ausrichtung auf die während des Bezugszeitraums beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale. Die übrigen 5,49 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Barmitteln oder barmittelähnlichen Instrumenten.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.





#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% der Vermögenswerte
Asset Backed Securities	0,41
Grundstoffe	2,76
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	5,49
Kommunikation	7,10
Zyklische Konsumgüter	4,40
Nichtzyklische Konsumgüter	9,00
Energie	3,49
Berichts-	54,17
Government	2,93
Industrie	2,29
Mortgage Securities	0,69
Technologie	1,78
Versorgung	5,49

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹**

Ja

In fossiles Gas

In Kernenergie

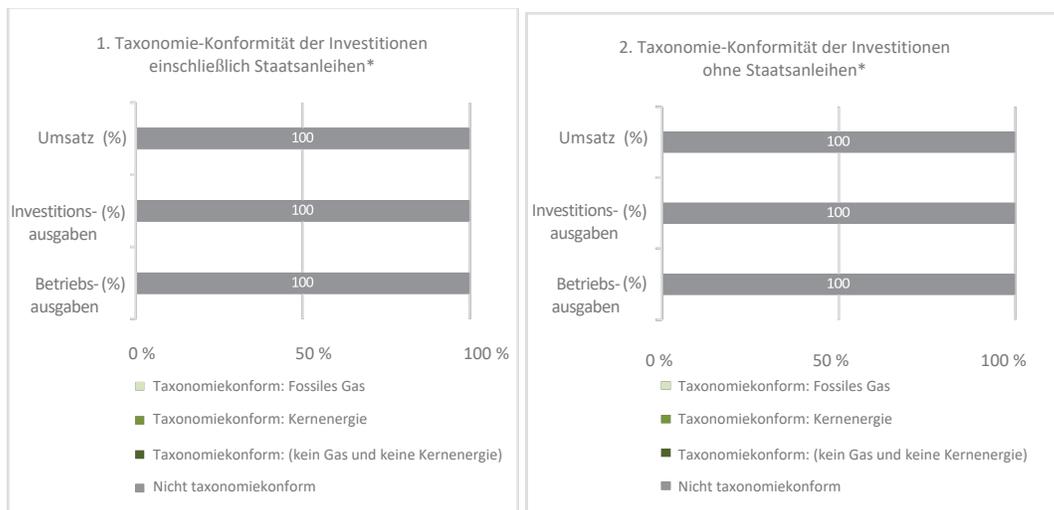
Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonmiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonmie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonmiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

 **Wie hoch war Anteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Anlagen in Barmitteln oder bargeldähnlichen Instrumenten wurden unter „Andere Investitionen“ aufgeführt. Die vom Finanzprodukt gehaltenen liquiden Mittel oder bargeldähnlichen Instrumente wurden im Einklang mit den für Liquiditätsreserven geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben zur effizienten Portfolioverwaltung eingesetzt. Auf die im Finanzprodukt gehaltenen Barmittel oder bargeldähnlichen Instrumente wurde kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz angewandt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Unteranlageverwalter hat die in den Abschnitten „Überwachung ökologischer oder sozialer Merkmale“, „Methoden“ und „Datenquellen und Datenverarbeitung“ der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds (zu finden auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf>) beschriebenen Maßnahmen ergriffen, die dazu führten, dass der Teilfonds die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Bezugszeitraum wie folgt erreichte:

- Mindestens 5 % des Gesamtnettvermögens wurden in grünen, nachhaltigen und sozialen Anleihen (GSSS-Anleihen) gehalten.
- Anwendung der zentralen Ausschlüsse und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Unteranlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf

<https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Name des Produkts: EUR Short Duration Credit Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300MFPLRS3P8YV021

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: %

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Teilfonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Ausschluss von Unternehmen mit schlechtem ESG-Risikoprofil und Bevorzugung von Unternehmen mit vergleichsweise besserem ESG-Risikoprofil.
- Zielvorgabe einer gewichteten durchschnittlichen Kohlenstoffintensität des Portfolios, die niedriger ist als die Kohlenstoffintensität des Bloomberg Euro Aggregate Corporate Bonds 1-5 Yr. Index (EUR Unhedged).
- Anwendung der zentralen Ausschlüsse und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Untereinlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf

<https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Der Teilfonds erfüllte im gesamten Bezugszeitraum die oben beschriebenen beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Beworbene E/S-Merkmale / Nachhaltigkeitsindikatoren	Wertentwicklung
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Ausschluss von Unternehmen mit schlechtem ESG-Risikoprofil</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> • Ausschluss von Wertpapieren mit dem niedrigsten Rating durch eine unabhängige Drittpartei • Anwendung von Allspring ESGiQ-Scores (ESG Information Quotient), einem proprietären Rating-System zur Bewertung von ESG-Risiken und Wesentlichkeit von ESG-Faktoren. Allspring ESGiQ ergänzt die Daten von Drittanbietern um die fundierten Branchenkenntnisse und die Expertise der Analysten des Untieranlageverwalters.¹</p>	<p>Während des Bezugszeitraums investierte der Teilfonds nicht in Wertpapiere, die:</p> <ul style="list-style-type: none"> • das niedrigste Rating einer unabhängigen Drittpartei aufwiesen • einen Allspring ESGiQ-Score von 2 oder weniger hatten • keine Allspring ESGiQ-Bewertung hatten.
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Bevorzugung von Unternehmen mit vergleichsweise gutem ESG-Risikoprofil</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Anwendung von Allspring ESGiQ-Scores (ESG Information Quotient), einem proprietären Rating-System zur Bewertung von ESG-Risiken und Wesentlichkeit von ESG-Faktoren.</p>	<p>Der Teilfonds investierte mindestens zwei Drittel seines Gesamtvermögens in Emittenten, die im Bezugszeitraum einen Gesamt-ESGiQ-Score von 3+ oder höher aufwiesen.</p>
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Zielvorgabe einer gewichteten durchschnittlichen Kohlenstoffintensität² des Portfolios, die niedriger ist als die Kohlenstoffintensität des Referenzwerts Bloomberg Euro Aggregate Corporate Bonds 1-5 Yr. Index (EUR Unhedged)</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Klimabezogene Daten von einem unabhängigen externen Datenanbieter</p>	<p>Der Teilfonds erreichte im gesamten Bezugszeitraum eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität unter der des Referenzwerts Bloomberg Euro Aggregate Corporate Bonds 1-5 Yr. Index (EUR Unhedged).</p>
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Anwendung der zentralen Ausschlüsse und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Untieranlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf https://www.allspringglobal.com/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf dargelegt</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Daten zur Produktbeteiligung und zur Prüfung der Einhaltung globaler Standards von einem unabhängigen Datenanbieter</p>	<p>Der Teilfonds erfüllte während des Bezugszeitraums die zentralen Ausschlusskriterien und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Untieranlageverwalters (wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds dargelegt).</p>

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Entfällt, da es sich um den ersten Bezugszeitraum für die periodische Berichterstattung gemäß Delegierter Verordnung zur SFDR handelt.

¹ Die Methodik verbindet Daten von Drittanbietern mit den fundierten Branchenkenntnissen und der Expertise der Analysten des Untieranlageverwalters. Die Emittenten erhalten ein quantitatives Rating und können darüber hinaus nach qualitativen Kriterien bewertet werden. Die Investmentanalysten führen die Beurteilung durch und erstellen einen ESG-Ausblick, der erfasst, ob das Unternehmen einen positiven Trend (gekennzeichnet durch ein „+“), keine signifikante Veränderung oder einen negativen Trend (gekennzeichnet durch ein „-“) aufweist. Der sich daraus ergebende ESGiQ-Score basiert auf einer Skala von 1 bis 5 für das Gesamtrating, wobei 1 für Emittenten mit schlechten oder hinter den Anforderungen zurückbleibende ESG-Werte und 5 für in Bezug auf ESG gute oder führende Emittenten steht. Der Teilfonds investiert mindestens zwei Drittel seines Gesamtvermögens in Emittenten, die einen ESGiQ-Gesamtscore von 3+ oder höher aufweisen, und schließt Emittenten aus, die einen ESGiQ-Score von 2 oder schlechter oder kein Rating aufweisen. Staatliche Emittenten, Barmittel, Derivate und Anlagen in zugrunde liegende Fonds müssen keine ESGiQ-Bewertung aufweisen.

² Die Kohlenstoffintensität ist ein Maß für die Gesamtemissionen pro Umsatz.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Details:**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Während des Bezugszeitraums berücksichtigte der Untereinlageverwalter im Rahmen seiner ESG- und Anlagenbewertung sowie seines Dialogs mit Emittenten bestimmte wichtigste nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren. Der Teilfonds berücksichtigte darüber hinaus andere wichtigste nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er Unternehmen aus dem Portfolio ausschloss, die unter seine zentralen spezifischen Ausschlusskriterien und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien fielen, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf

<https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt. Anlageentscheidungen beruhten jedoch nicht ausschließlich auf der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, sondern auf verschiedenen Faktoren, die während der Anlageanalyse berücksichtigt wurden.





Was waren die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01.04.2022 – 31.03.2023

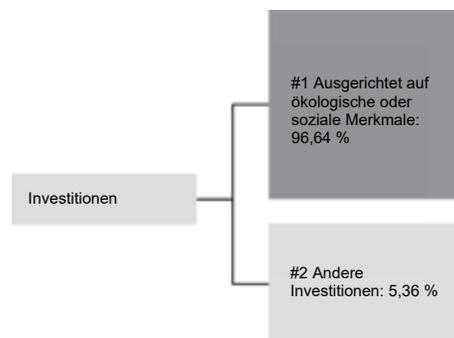
Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Regierung von Deutschland	Government	1,79	Deutschland
BPCE SA	Finanzdienstleistungen	1,60	Frankreich
Coöperatieve Rabobank UA	Finanzdienstleistungen	1,56	Niederlande
BNP Paribas S.A.	Finanzdienstleistungen	1,53	Frankreich
Morgan Stanley	Finanzdienstleistungen	1,51	Vereinigte Staaten
Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA	Finanzdienstleistungen	1,50	Frankreich
Credit Agricole S.A.	Finanzdienstleistungen	1,44	Frankreich
Regierung von Frankreich	Government	1,35	Frankreich
Bank of America Corporation	Finanzdienstleistungen	1,30	Vereinigte Staaten
OP Yrityspankki Oyj	Finanzdienstleistungen	1,20	Finnland
Bankia, S.A.	Finanzdienstleistungen	1,19	Spanien
Argenta Spaarbank NV	Finanzdienstleistungen	1,18	Belgien
ING Groep NV	Finanzdienstleistungen	1,18	Niederlande
DNB Bank ASA	Finanzdienstleistungen	1,16	Norwegen
JPMorgan Chase & Co.	Finanzdienstleistungen	1,10	Vereinigte Staaten

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

94,64 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Anlagen mit Ausrichtung auf die während des Bezugszeitraums beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale. Die übrigen 5,36 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Barmitteln oder barmittelähnlichen Instrumenten.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% der Vermögenswerte
Grundstoffe	3,37
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	5,37
Kommunikation	5,34
Zyklische Konsumgüter	3,98
Nichtzyklische Konsumgüter	9,96
Energie	3,37
Berichts-Government	55,85
Industrie	3,12
Technologie	1,09
Versorgung	2,61
	5,94



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxoniekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**

Ja

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

Ermöglichende Tätigkeiten

wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

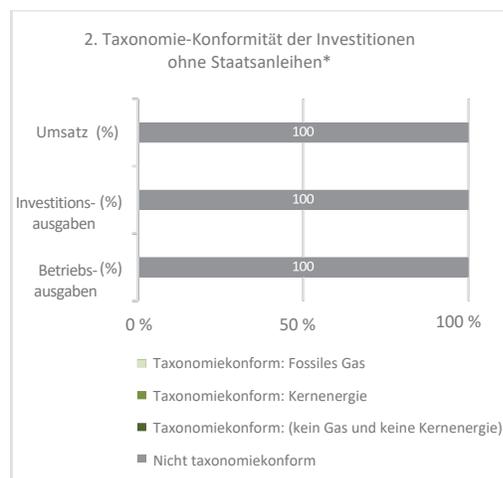
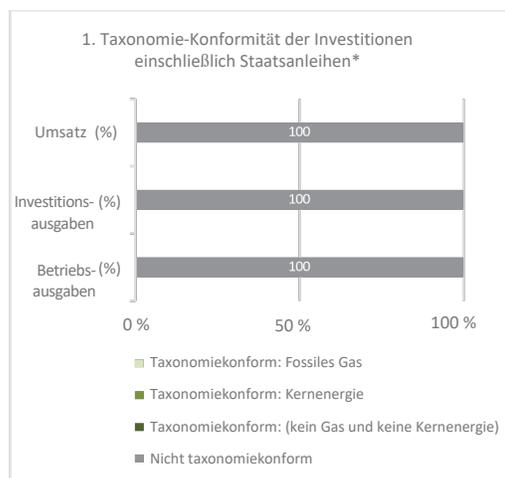
Taxoniekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

³ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxoniekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxoniekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.



- **Wie hoch war Anteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.



- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.



- **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Anlagen in Barmitteln oder bargeldähnlichen Instrumenten wurden unter „Andere Investitionen“ aufgeführt. Die vom Finanzprodukt gehaltenen liquiden Mittel oder bargeldähnlichen Instrumente wurden im Einklang mit den für Liquiditätsreserven geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben zur effizienten Portfolioverwaltung eingesetzt. Auf die im Finanzprodukt gehaltenen Barmittel oder bargeldähnlichen Instrumente wurde kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz angewandt.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Unteranlageverwalter hat die in den Abschnitten „Überwachung ökologischer oder sozialer Merkmale“, „Methoden“ und „Datenquellen und Datenverarbeitung“ der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds (zu finden auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf>) beschriebenen Maßnahmen ergriffen, die dazu führten, dass der Teilfonds die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Bezugszeitraum wie folgt erreichte:

- Ausschluss von Unternehmen mit schlechtem ESG-Risikoprofil und Bevorzugung von Unternehmen mit vergleichsweise besserem ESG-Risikoprofil.
- Erreichung einer gewichteten durchschnittlichen Kohlenstoffintensität des Portfolios, die niedriger ist als die Kohlenstoffintensität des Bloomberg Euro Aggregate Corporate Bonds 1-5 Yr. Index (EUR Unhedged).
- Anwendung der zentralen Ausschlüsse und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Unteranlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf

<https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Name des Produkts: Global Equity Enhanced Income Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code): 254900LOTIXAZON74K97

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?



Ja



Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: %



in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind



in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind



Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: %



Nein



Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es __% an nachhaltigen Investitionen.



mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind



mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind



mit einem sozialen Ziel



Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, aber keine **nachhaltigen Investitionen getätigt**.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Teilfonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- CO2-Bilanz und CO2-Intensität, die insgesamt mindestens 30 % unter denen des MSCI All Country World Index („ACWI“) liegen.
- Portfolio mit höherem gewichteten durchschnittlichen ESG-Score als der MSCI ACWI, basierend auf Daten eines unabhängigen Drittanbieters, der die ESG-Risiken von Unternehmen und das Management dieser Risiken bewertet
- Anwendung der zentralen Ausschlusskriterien des Untereinlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt

Der Teilfonds erfüllte im gesamten Bezugszeitraum die oben beschriebenen beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Beworbene E/S-Merkmale / Nachhaltigkeitsindikatoren	Wertentwicklung
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> CO2-Bilanz¹ und CO2-Intensität, die insgesamt mindestens 30 % unter denen des MSCI All Country World Index liegen</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> CO2-Kennzahlen von einem unabhängigen externen Datenanbieter</p>	<p>Der Teilfonds erzielte während des Bezugszeitraums insgesamt eine mindestens 30 % bessere CO2-Bilanz und 30 % geringere CO2-Intensität als der MSCI All Country World Index.</p>
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Portfolio mit einem höheren gewichteten durchschnittlichen ESG-Score als der MSCI All Country World Index</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> ESG-Bewertungen von einem unabhängigen externen Datenanbieter</p>	<p>Der Teilfonds erreichte während des gesamten Bezugszeitraums einen höheren gewichteten durchschnittlichen ESG-Score als der MSCI All Country World Index.</p>
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Anwendung der zentralen Ausschlusskriterien des Untieranlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf https://www.allspringglobal.com/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf dargelegt</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Daten zur Produktbeteiligung und zur Prüfung der Einhaltung globaler Standards von einem unabhängigen Datenanbieter</p>	<p>Der Teilfonds erfüllte während des Bezugszeitraums die zentralen Ausschlusskriterien des Untieranlageverwalters (wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds dargelegt).</p>

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Entfällt, da es sich um den ersten Bezugszeitraum für die periodische Berichterstattung gemäß Delegierter Verordnung zur SFDR handelt.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

→ **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

¹ Die CO2-Bilanz ist ein Maß für die Menge der von den zugrunde liegenden Unternehmen ausgestoßenen Treibhausgase und wird als „Kohlendioxid-Äquivalente“ (in Tonnen) angegeben. Die Kohlenstoffintensität ist ein Maß für die Gesamtemissionen pro Umsatz.

- **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Details:**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

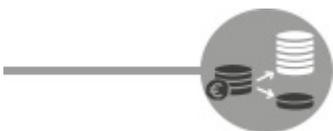


Während des Bezugszeitraums lagen die Kohlenstoffintensität und CO₂-Bilanz des Portfolios um mindestens 30 % unter dem MSCI All Country World Index. Aufgrund der CO₂-Beschränkungen auf Portfolioebene investierte das Portfolio im Durchschnitt stärker in Unternehmen mit geringeren Emissionen. Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren wurden in dieser Form berücksichtigt. Der Teilfonds berücksichtigte andere wichtigste nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er Unternehmen aus dem Portfolio ausschloss, die unter die zentralen spezifischen Ausschlusskriterien des Untermanagementverwalters fielen, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf

<https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt.

Anlageentscheidungen beruhen jedoch nicht ausschließlich auf der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, sondern auf verschiedenen Faktoren, die während der Anlageanalyse berücksichtigt wurden. Zudem wurden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen nur in Bezug auf das Aktienportfolio berücksichtigt.

Was waren die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?



Die Liste umfasst die Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01.04.2022 – 31.03.2023

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Apple Inc.	Informationstechnologie	3,89	Vereinigte Staaten
Microsoft Corporation	Informationstechnologie	3,30	Vereinigte Staaten
Amazon.com, Inc.	Zyklische Konsumgüter	1,82	Vereinigte Staaten
Alphabet Inc. Klasse A	Kommunikationsdienstleistungen	1,36	Vereinigte Staaten
Alphabet Inc. Class C	Kommunikationsdienstleistungen	1,16	Vereinigte Staaten
Arrow Electronics, Inc.	Informationstechnologie	1,03	Vereinigte Staaten
AbbVie, Inc.	Gesundheitswesen	0,88	Vereinigte Staaten
Meta Platforms Inc. Class A	Kommunikationsdienstleistungen	0,75	Vereinigte Staaten
Exxon Mobil Corporation	Energie	0,73	Vereinigte Staaten
Bunge Limited	Basiskonsumgüter	0,70	Vereinigte Staaten
Gilead Sciences, Inc.	Gesundheitswesen	0,62	Vereinigte Staaten
Procter & Gamble Company	Basiskonsumgüter	0,61	Vereinigte Staaten
Tyson Foods, Inc. Class A	Basiskonsumgüter	0,61	Vereinigte Staaten
Pfizer Inc.	Gesundheitswesen	0,61	Vereinigte Staaten
Cognizant Technology Solutions Corporation Class A	Informationstechnologie	0,59	Vereinigte Staaten

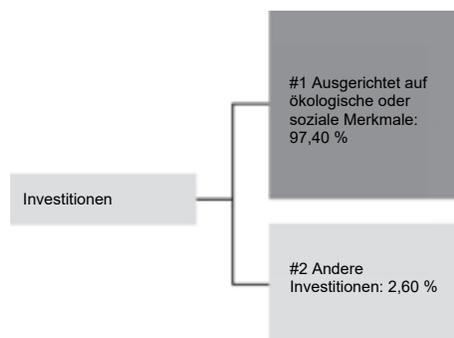


Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

97,40 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Anlagen mit Ausrichtung auf die während des Bezugszeitraums beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale. Die übrigen 2,60 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Barmitteln oder barmittelähnlichen Instrumenten.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% der Vermögenswerte
Barmittel	0,29
Kommunikationsdienstleistungen	6,23
Zyklische Konsumgüter	11,98
Basiskonsumgüter	7,83
Energie	4,03
Finanzen	12,95
Gesundheitswesen	12,90
Industrie	12,59
Informationstechnologie	19,88
Grundstoffe	5,10
Sonstige	2,31
Immobilien	1,92
Versorgung	2,00

„Andere Investitionen“ umfasst Positionen in Futures-Instrumenten innerhalb des Portfolios, die keine ökologischen oder sozialen Merkmale bewerben.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?**

Ja

² Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

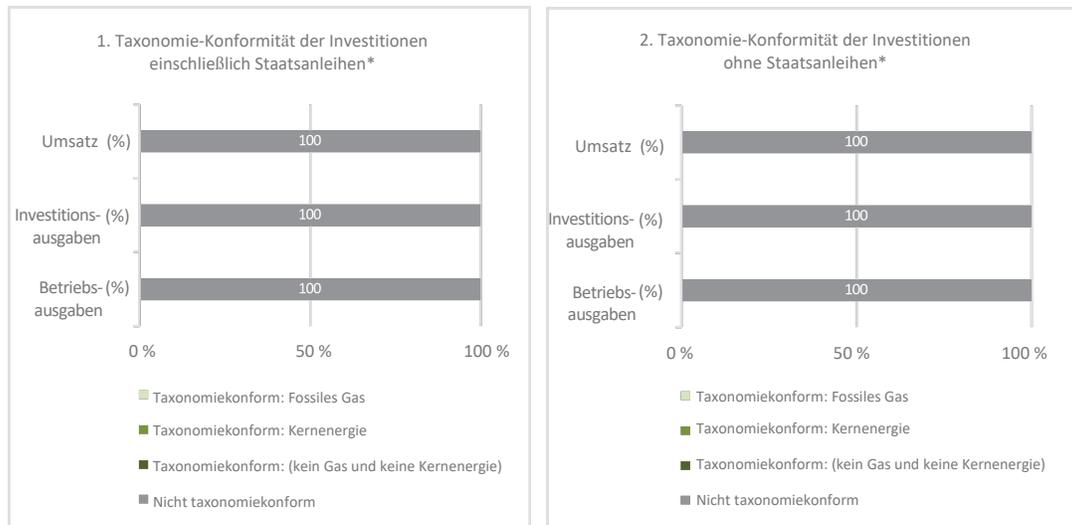
noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- In fossiles Gas
- In Kernenergie
- Nein**

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

🕒 **Wie hoch war Anteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

👤 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

🕒 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Anlagen in Barmitteln oder bargeldähnlichen Instrumenten sowie Derivaten wurden unter „Andere Investitionen“ aufgeführt. Die vom Finanzprodukt gehaltenen liquiden Mittel oder bargeldähnlichen Instrumente sowie Derivate wurden im Einklang mit den für Liquiditätsreserven geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben zur Absicherung und/oder zur effizienten Portfolioverwaltung eingesetzt. Auf die im Finanzprodukt gehaltenen Barmittel oder bargeldähnlichen Instrumente und Derivate wurde kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz angewandt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Unteranlageverwalter hat die in den Abschnitten „Überwachung ökologischer oder sozialer Merkmale“, „Methoden“ und „Datenquellen und Datenverarbeitung“ der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds (zu finden auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf>) beschriebenen Maßnahmen ergriffen, die dazu führten, dass der Teilfonds die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Bezugszeitraum wie folgt erreichte:

- CO2-Bilanz und CO2-Intensität, die insgesamt mindestens 30 % unter denen des MSCI All Country World Index („ACWI“) liegen
- Portfolio mit höherem gewichteten durchschnittlichen ESG-Score als der MSCI All Country World Index, basierend auf Daten eines unabhängigen Drittanbieters, der die ESG-Risiken von Unternehmen und das Management dieser Risiken bewertet
- Anwendung der zentralen Ausschlusskriterien des Unteranlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Name des Produkts: Global Small Cap Equity Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code): 254900OREERUC1P22274

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: %

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es __% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Teilfonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Anlagen in Unternehmen mit guten ESG-Bewertungen oder positiver ESG-Entwicklung; und

- Anwendung der zentralen Ausschlusskriterien des Untereinlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt

Der Teilfonds erfüllte im gesamten Bezugszeitraum die oben beschriebenen beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Beworbene E/S-Merkmale / Nachhaltigkeitsindikatoren	Wertentwicklung
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Anlagen in Unternehmen mit guten ESG-Bewertungen oder positiver ESG-Entwicklung</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Qualitative Prüfung des Untereinlageverwalters und eigenes Scoring-System zur Auswahl von Unternehmen mit guten ESG-Bewertungen oder positivem Trend in Bezug auf ESG</p>	<p>Der Teilfonds investierte im Bezugszeitraum in Wertpapiere von Unternehmen, die gemäß der qualitativen Analyse und proprietären Bewertung des Untereinlageverwalters gute ESG-Bewertungen oder eine positive ESG-Entwicklung aufwiesen.</p>
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Anwendung der zentralen Ausschlusskriterien des Untereinlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf https://www.allspringglobal.com/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf dargelegt</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Daten zur Produktbeteiligung und zur Prüfung der Einhaltung globaler Standards von einem unabhängigen Datenanbieter</p>	<p>Der Teilfonds erfüllte während des Bezugszeitraums die zentralen Ausschlusskriterien des Untereinlageverwalters (wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds dargelegt).</p>

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Entfällt, da es sich um den ersten Bezugszeitraum für die periodische Berichterstattung gemäß Delegierter Verordnung zur SFDR handelt.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltige Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

→ **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

→ **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Details:**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Während des Bezugszeitraums berücksichtigte der Unteranlageverwalter im Rahmen seiner ESG- und Anlagenbewertung sowie seines Dialogs mit Emittenten bestimmte wichtigste nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren. Der Unteranlageverwalter berücksichtigte darüber hinaus bestimmte nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er Unternehmen aus dem Portfolio ausschloss, die unter seine zentralen spezifischen Ausschlusskriterien fielen, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt.

<https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf>.

Anlageentscheidungen beruhen jedoch nicht ausschließlich auf der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, sondern auf verschiedenen Faktoren, die während der Anlageanalyse berücksichtigt wurden.



Was waren die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel:
1. April 2022 –
31. März 2023

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Innospec Inc.	Grundstoffe	4,20	Vereinigte Staaten
Novanta Inc	Informationstechnologie	3,19	Vereinigte Staaten
CSW Industrials, Inc.	Industrie	3,03	Vereinigte Staaten
Gibraltar Industries, Inc.	Industrie	2,62	Vereinigte Staaten
Ansell Limited	Gesundheitswesen	2,29	Australien
Globus Medical Inc Class A	Gesundheitswesen	2,27	Vereinigte Staaten
Progress Software Corporation	Informationstechnologie	2,22	Vereinigte Staaten
Denny's Corporation	Zyklische Konsumgüter	2,11	Vereinigte Staaten
Helen of Troy Limited	Zyklische Konsumgüter	2,03	Vereinigte Staaten
Alten SA	Informationstechnologie	1,96	Frankreich
Azenta, Inc.	Gesundheitswesen	1,87	Vereinigte Staaten
EnPro Industries, Inc.	Industrie	1,78	Vereinigte Staaten
CBIZ, Inc.	Industrie	1,78	Vereinigte Staaten
Stepan Co	Grundstoffe	1,72	Vereinigte Staaten
Spectris plc	Informationstechnologie	1,71	Vereinigtes Königreich

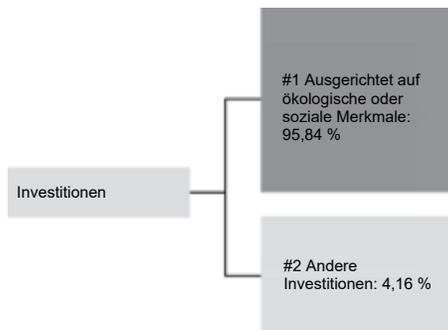


Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

95,84 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Anlagen mit Ausrichtung auf die während des Bezugszeitraums beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale. Die übrigen 4,16 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Barmitteln oder barmittelähnlichen Instrumenten.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Sektor	% der Vermögenswerte
Barmittel	4,16
Kommunikationsdienstleistungen	3,27
Zyklische Konsumgüter	9,51
Basiskonsumgüter	7,15
Energie	1,20
Finanzen	2,52
Gesundheitswesen	13,67
Industrie	24,59
Informationstechnologie	20,99
Grundstoffe	10,40
Immobilien	2,52
Versorgung	0,03

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

Ja

In fossiles Gas In Kernenergie

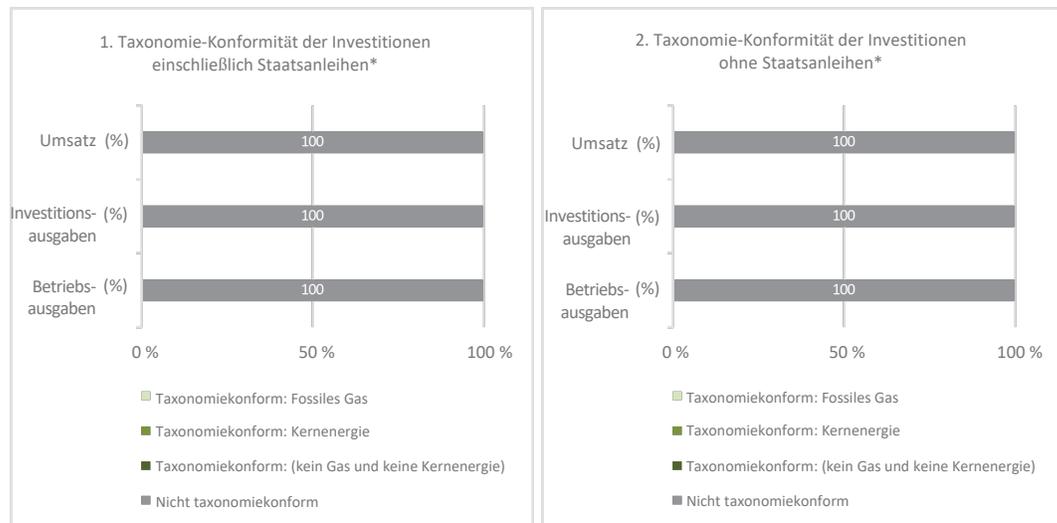
Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

 **Wie hoch war Anteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

 **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Anlagen in Barmitteln oder bargeldähnlichen Instrumenten sowie Derivaten wurden unter „Andere Investitionen“ aufgeführt. Die vom Finanzprodukt gehaltenen liquiden Mittel oder bargeldähnlichen Instrumente sowie Derivate wurden im Einklang mit den für Liquiditätsreserven geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben zur Absicherung und/oder zur effizienten Portfolioverwaltung eingesetzt. Auf die im Finanzprodukt gehaltenen Barmittel oder bargeldähnlichen Instrumente und Derivate wurde kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz angewandt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Untereinlageverwalter hat die in den Abschnitten „Überwachung ökologischer oder sozialer Merkmale“, „Methoden“ und „Datenquellen und Datenverarbeitung“ der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds (zu finden auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf>) beschriebenen Maßnahmen ergriffen, die dazu führten, dass der Teilfonds die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Bezugszeitraum wie folgt erreichte:

- Anlagen in Unternehmen mit guten ESG-Bewertungen oder positiver ESG-Entwicklung; und
- Anwendung der zentralen Ausschlusskriterien des Untereinlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Name des Produkts: U.S. All Cap Growth Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code): 222100BOJ0VE2T6ESR13

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

- | | |
|---|--|
| <p><input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: %</p> <p><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: %</p> | <p><input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input type="radio"/> Nein</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.</p> <p><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</p> <p><input checked="" type="radio"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.</p> |
|---|--|

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Teilfonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

• Anlagen in Unternehmen, die entweder bereits starke Performance in Bezug auf ökologische oder soziale Aspekte in Verbindung mit langfristiger Wertgenerierung aufweisen oder bei denen Entwicklungsprozesse im Gang sind, die zeigen, dass diese Unternehmen in zunehmendem Maß die mit robustem nachhaltigem Wachstum verbundenen Verbesserungsanforderungen in Bezug auf Ökologie und Soziales erfüllen.

• Anwendung der zentralen Ausschlusskriterien des Unteranlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt

Der Teilfonds erfüllte im gesamten Bezugszeitraum die oben beschriebenen beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Beworbene E/S-Merkmale / Nachhaltigkeitsindikatoren

Wertentwicklung

<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Unternehmen, die entweder bereits starke Performance in Bezug auf ökologische oder soziale Aspekte in Verbindung mit langfristiger Wertgenerierung aufweisen oder bei denen Entwicklungsprozesse im Gang sind, die zeigen, dass diese Unternehmen in zunehmendem Maß die mit robustem nachhaltigem Wachstum verbundenen Verbesserungsanforderungen in Bezug auf Ökologie und Soziales erfüllen.</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u></p> <ul style="list-style-type: none"> • Proprietäre quantitative ESG-Risikobewertungen, die aus drei separaten Drittquellen stammen • Verbesserungen bei diesen Bewertungen • Spezifische Kennzahlen für Ökologie und Soziales, die mit robustem und nachhaltigem Wachstum verknüpft sind und die der Untereinlageverwalter für Unternehmen im Portfolio erfasst und beobachtet, die nach den Standards des Sustainability Accounting Standards Board (SASB) für ihre jeweilige Branche berichten • Qualitative Beurteilung der Performance eines Unternehmens durch den Untereinlageverwalter in Bezug auf ökologische oder soziale Aspekte im Zusammenhang mit robustem und nachhaltigem Wachstum • Dokumentation der Interaktionen im Rahmen der Mitwirkung in Unternehmen und Prüfung, ob das jeweilige Unternehmen Handlungsbereitschaft zeigt und Verbesserungskonzepte entwickelt 	<p>Im Bezugszeitraum investierte der Teilfonds nur in Unternehmen, die entweder:</p> <ul style="list-style-type: none"> • starke aktuelle Performance in Bezug auf mit robustem nachhaltigem Wachstum verknüpfte Umwelt-, Sozial- oder Governance-Themen aufweisen (gemessen anhand der proprietären quantitativen ESG-Risikobewertungen, der Daten zur Einhaltung branchenspezifischer SASB-Standards oder der qualitativen Bewertung des Untereinlageverwalters), oder • bei denen Entwicklungsprozesse im Gang sind, die zeigen, dass diese Unternehmen die mit robustem und nachhaltigem Wachstum verbundenen Verbesserungsanforderungen erfüllen (gemessen an der längerfristigen Verbesserung bei proprietären quantitativen ESG-Risikoscores oder der qualitativen Beurteilung des Untereinlageverwalters). <p>In bestimmten Fällen trat der Untereinlageverwalter mit den Unternehmen, in die investiert wird, in den Dialog, um sich über deren ESG-Performance zu informieren, um Erkenntnisse über deren Handlungsbereitschaft zu gewinnen oder um in Zusammenarbeit mit den Unternehmen Konzepte zur Verbesserung ihrer Performance bei ökologischen oder sozialen Themen zu entwickeln, die mit robustem und nachhaltigem Wachstum in Zusammenhang stehen. Dieser Dialog bildete eine Grundlage der qualitativen Bewertungen der Unternehmen, in die investiert wurde, durch den Untereinlageverwalter.</p>
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Anwendung der zentralen Ausschlusskriterien des Untereinlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf https://www.allspringglobal.com/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf dargelegt</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Daten zur Produktbeteiligung und zur Prüfung der Einhaltung globaler Standards von einer unabhängigen Drittpartei</p>	<p>Der Teilfonds erfüllte während des Bezugszeitraums die zentralen Ausschlusskriterien des Untereinlageverwalters (wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds dargelegt).</p>

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Entfällt, da es sich um den ersten Bezugszeitraum für die periodische Berichterstattung gemäß Delegierter Verordnung zur SFDR handelt.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

→ **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

→ **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Details:**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Während des Bezugszeitraums nutzte der Unteranlageverwalter branchenspezifische Kennzahlen des Sustainability Accounting Standards Board (SASB), die sich auf bestimmte Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen beziehen und bei den Unternehmen, in die investiert wird, die Ermittlung von ESG-bezogenen Stärken und Schwächen sowie die Quantifizierung von ESG-Verbesserungen ermöglichen. Der Unteranlageverwalter berücksichtigte darüber hinaus im Rahmen seines Dialogs mit Emittenten bestimmte nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er Unternehmen aus dem Portfolio ausschloss, die unter seine zentralen spezifischen Ausschlusskriterien fielen, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt. Anlageentscheidungen beruhten jedoch nicht ausschließlich auf der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, sondern auf verschiedenen Faktoren, die während der Anlageanalyse berücksichtigt wurden.



Was waren die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Microsoft Corporation	Informationstechnologie	9,63	Vereinigte Staaten
Alphabet Inc. Class A	Kommunikationsdienstleistungen	7,50	Vereinigte Staaten
Apple Inc.	Informationstechnologie	7,01	Vereinigte Staaten
Amazon.com, Inc.	Zyklische Konsumgüter	6,83	Vereinigte Staaten
Mastercard Incorporated Class A	Finanzen	3,53	Vereinigte Staaten
Tradeweb Markets, Inc. Class A	Finanzen	2,61	Vereinigte Staaten
Monolithic Power Systems, Inc.	Informationstechnologie	2,33	Vereinigte Staaten
Copart, Inc.	Industrie	2,21	Vereinigte Staaten
Boston Scientific Corporation	Gesundheitswesen	1,89	Vereinigte Staaten
Microchip Technology Incorporated	Informationstechnologie	1,83	Vereinigte Staaten
LPL Financial Holdings Inc.	Finanzen	1,73	Vereinigte Staaten
Linde plc	Grundstoffe	1,61	Vereinigte Staaten
Allegro MicroSystems, Inc.	Informationstechnologie	1,44	Vereinigte Staaten
Leslie's, Inc.	Zyklische Konsumgüter	1,28	Vereinigte Staaten
Floor & Decor Holdings, Inc. Class A	Zyklische Konsumgüter	1,26	Vereinigte Staaten



Die Liste umfasst die Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 1. April 2022 – 31. März 2023

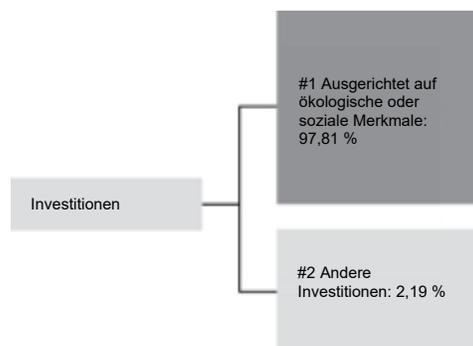


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

97,81 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Anlagen mit Ausrichtung auf die während des Bezugszeitraums beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale. Die übrigen 2,19 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Barmitteln oder barmittelähnlichen Instrumenten.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Sektor	% der Vermögenswerte
Barmittel	2,19
Kommunikationsdienstleistungen	9,83
Zyklische Konsumgüter	17,44
Basiskonsumgüter	0,54
Finanzen	13,83
Gesundheitswesen	14,11
Industrie	6,14
Informationstechnologie	33,62
Grundstoffe	1,61
Immobilien	0,70

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten. **Übergangstätigkeiten** sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?

Ja

In fossiles Gas In Kernenergie

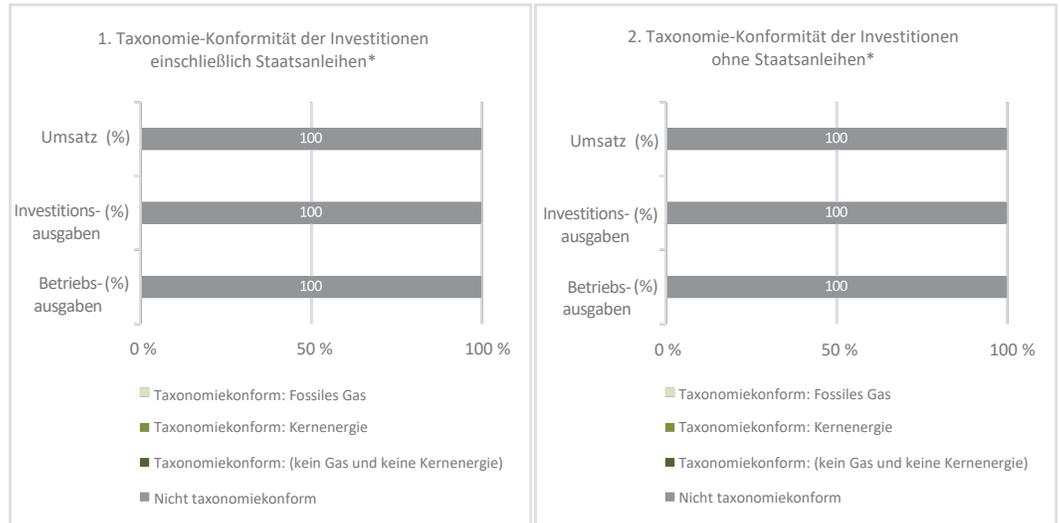
¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

🕒 **Wie hoch war Anteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

👤 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Anlagen in Barmitteln oder bargeldähnlichen Instrumenten sowie Derivaten wurden unter „Andere Investitionen“ aufgeführt. Die vom Finanzprodukt gehaltenen liquiden Mittel oder bargeldähnlichen Instrumente sowie Derivate wurden im Einklang mit den für Liquiditätsreserven geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben zur Absicherung und/oder zur effizienten Portfolioverwaltung eingesetzt. Auf die im Finanzprodukt gehaltenen Barmittel oder bargeldähnlichen Instrumente und Derivate wurde kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz angewandt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Unteranlageverwalter hat die in den Abschnitten „Überwachung ökologischer oder sozialer Merkmale“, „Methoden“ und „Datenquellen und Datenverarbeitung“ der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds (zu finden auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf>) beschriebenen Maßnahmen ergriffen, die dazu führten, dass der Teilfonds die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Bezugszeitraum wie folgt erreichte:

- Anlagen in Unternehmen mit aktuell starker Performance in Bezug auf ökologische oder soziale Aspekte in Verbindung mit robustem und nachhaltigem Wachstum;
- Anlagen in Unternehmen, bei denen Entwicklungsprozesse im Gang sind, die zeigen, dass diese Unternehmen in zunehmendem Maß die mit robustem nachhaltigem Wachstum verbundenen Verbesserungsanforderungen in Bezug auf Ökologie und Soziales erfüllen.
- Anwendung der zentralen Ausschlusskriterien des Unteranlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Name des Produkts: USD Investment Grade Credit Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code): 222100428TQ8GYW59277

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: %

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: %

Nein

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es __% an nachhaltigen Investitionen.

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Teilfonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Verpflichtung, mindestens 5 % des Gesamtnettovermögens in grünen, nachhaltigen und sozialen Anleihen (GSSS-Anleihen) zu halten.
- Anwendung der zentralen Ausschlüsse und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Untieranlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf

<https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt

Der Teilfonds erfüllte im gesamten Bezugszeitraum die oben beschriebenen beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Beworbene E/S-Merkmale / Nachhaltigkeitsindikatoren

Wertentwicklung

<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Mindestens 5 % des Gesamtvermögens werden in GSSS-Anleihen gehalten</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u> Verwendung unabhängiger Bewertungen der Verwendung von Anlageerlösen</p>	<p>Der Teilfonds hielt während des Bezugszeitraums mindestens 5 % seines Gesamtvermögens in grünen, nachhaltigen, nachhaltigkeitsgebundenen und sozialen Anleihen (GSSS).</p> <p>Im Bezugszeitraum entfielen im Quartalsdurchschnitt 6,09 % des Portfolios auf GSSS-Anleihen.</p>
<p><u>Beworbene E/S-Merkmale:</u> Anwendung der zentralen Ausschlüsse und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Unteranlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf https://www.allspringglobal.com/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf dargelegt</p> <p><u>Nachhaltigkeitsindikatoren:</u></p> <ul style="list-style-type: none"> • Ausschluss von Wertpapieren mit dem niedrigsten Rating durch eine unabhängige Drittpartei • Daten zur Produktbeteiligung und zur Prüfung der Einhaltung globaler Standards von einem unabhängigen Datenanbieter 	<p>Der Teilfonds investierte nicht in Wertpapiere, die von einer unabhängigen externen Drittpartei das niedrigste Rating erhalten hatten und die zentralen Ausschlusskriterien und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Unteranlageverwalters erfüllten (wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds dargelegt).</p>

● **...und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Entfällt, da es sich um den ersten Bezugszeitraum für die periodische Berichterstattung gemäß Delegierter Verordnung zur SFDR handelt.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

→ **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

→ **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Details:**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Während des Bezugszeitraums berücksichtigte der Unteranlageverwalter im Rahmen seiner ESG- und Anlagenbewertung sowie seines Dialogs mit Emittenten bestimmte wichtigste nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren. Der Teilfonds berücksichtigte darüber hinaus andere wichtigste nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er Unternehmen aus dem Portfolio ausschloss, die unter seine zentralen spezifischen Ausschlusskriterien und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien fielen, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf

<https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt.

Anlageentscheidungen beruhen jedoch nicht ausschließlich auf der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, sondern auf verschiedenen Faktoren, die während der Anlageanalyse berücksichtigt wurden.



Was waren die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	Government	7,14	Vereinigte Staaten
Bank of America Corporation	Finanzdienstleistungen	3,84	Vereinigte Staaten
JPMorgan Chase & Co.	Finanzdienstleistungen	2,82	Vereinigte Staaten
Verizon Communications Inc.	Kommunikation	2,49	Vereinigte Staaten
Citigroup Inc.	Finanzdienstleistungen	2,44	Vereinigte Staaten
WarnerMedia Holdings, Inc.	Technology Services	1,95	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley	Finanzdienstleistungen	1,82	Vereinigte Staaten
Goldman Sachs Group, Inc.	Finanzdienstleistungen	1,71	Vereinigte Staaten
Oracle Corporation	Technology Services	1,66	Vereinigte Staaten
T-Mobile USA, Inc.	Kommunikation	1,53	Deutschland
Micron Technology, Inc.	Elektroniktechnologie	1,50	Vereinigte Staaten
Sabine Pass Liquefaction LLC	Energiemineraleien	1,43	Vereinigte Staaten
Dell International LLC	Elektroniktechnologie	1,43	Vereinigte Staaten
Truist Financial Corporation	Finanzdienstleistungen	1,40	Vereinigte Staaten
AT&T Inc.	Kommunikation	1,33	Vereinigte Staaten



Die Liste umfasst die Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel:
1. April 2022 – 31. März 2023

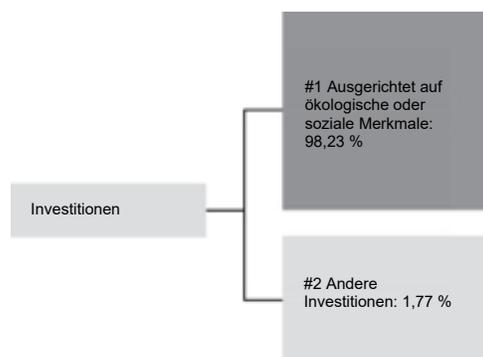


Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

98,23 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Anlagen mit Ausrichtung auf die während des Bezugszeitraums beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale. Die übrigen 1,77 % der Positionen des Finanzprodukts bestanden aus Barmitteln oder barmittelähnlichen Instrumenten.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% der Vermögenswerte
Bankwesen	25,59
Kommunikation	13,94
Technologie	12,42
Zyklische Konsumgüter	6,26
Nichtzyklische Konsumgüter	6,74
Finanzunternehmen	6,39
Versicherung	6,23
Staatsanleihen	7,18
REITS	4,52
Energie	4,25
Transport	2,34
Broker/Vermögensverwalter/Börsen	1,45
Investitionsgüter	0,47
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	1,36
Strom	0,38
Grundstoffindustrie	0,29
Kommunalobligationen	0,19

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

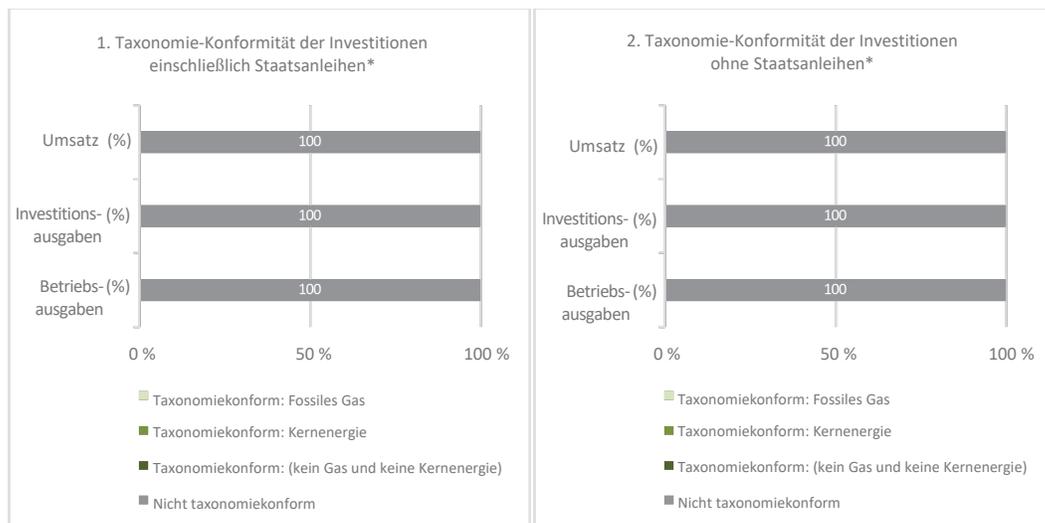
Ja

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.



Wie hoch war Anteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Anlagen in Barmitteln oder bargeldähnlichen Instrumenten wurden unter „Andere Investitionen“ aufgeführt. Die vom Finanzprodukt gehaltenen liquiden Mittel oder bargeldähnlichen Instrumente wurden im Einklang mit den für Liquiditätsreserven geltenden aufsichtsrechtlichen Vorgaben zur effizienten Portfolioverwaltung eingesetzt. Auf die im Finanzprodukt gehaltenen Barmittel oder bargeldähnlichen Instrumente wurde kein ökologischer oder sozialer Mindestschutz angewandt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Untereinlageverwalter hat die in den Abschnitten „Überwachung ökologischer oder sozialer Merkmale“, „Methoden“ und „Datenquellen und Datenverarbeitung“ der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds (zu finden auf <https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf>) beschriebenen Maßnahmen ergriffen, die dazu führten, dass der Teilfonds die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Bezugszeitraum wie folgt erreichte:

- Zu jedem Zeitpunkt entfielen mindestens 5 % des gesamten Nettovermögens auf grüne, nachhaltige und sozialen Anleihen (GSSS-Anleihen). Der durchschnittliche Anteil pro Quartal lag bei 6,09 % des Portfolios).
- Anwendung der zentralen Ausschlüsse und zusätzlichen Negativ-Screening-Kriterien des Untereinlageverwalters, wie in den nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen des Teilfonds auf

<https://www.allspringglobal.com/globalassets/assets/edocs/lux/legal/lux-fund-sustainability-related-disclosures.pdf> dargelegt



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Gilt nicht für dieses Finanzprodukt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.



Zusätzliche Informationen über den Allspring (Lux)
Worldwide Fund sind auf Anfrage kostenlos am
eingetragenen Sitz der Gesellschaft erhältlich.